

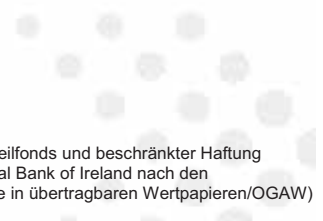


PIMCO

PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

Halbjahresbericht

30. Juni 2021



ALLGEMEINE KENNDATEN

Fondstyp:

OGAW

Anzahl an Teilfonds der Gesellschaft:

53 Teilfonds

Zum 30. Juni 2021 angebotene Anteilsklassen der Gesellschaft:*

Institutional
 Institutional AUD (Hedged)
 Institutional BRL (Hedged)
 Institutional CAD (Hedged)
 Institutional CHF (Hedged)
 Institutional CHF (Partially Hedged)
 Institutional CHF (Unhedged)
 Institutional CZK (Hedged)
 Institutional EUR (Currency Exposure)
 Institutional EUR (Hedged)
 Institutional EUR (Partially Hedged)
 Institutional EUR (Unhedged)
 Institutional GBP (Currency Exposure)
 Institutional GBP (Hedged)
 Institutional GBP (Partially Hedged)
 Institutional GBP (Unhedged)
 Institutional HKD (Unhedged)
 Institutional HUF (Hedged)
 Institutional ILS (Hedged)
 Institutional JPY (Hedged)
 Institutional MXN (Hedged)
 Institutional NOK (Hedged)
 Institutional NOK (Partially Hedged)
 Institutional NZD (Hedged)
 Institutional PLN (Hedged)
 Institutional SEK (Hedged)
 Institutional SGD (Hedged)
 Institutional USD (Currency Exposure)
 Institutional USD (Hedged)
 Investor
 Investor AUD (Hedged)
 Investor CAD (Hedged)
 Investor CHF (Hedged)
 Investor EUR (Hedged)
 Investor EUR (Unhedged)
 Investor GBP (Hedged)
 Investor NOK (Hedged)
 Investor RMB (Hedged)
 Investor SEK (Hedged)
 Investor SGD (Hedged)
 Investor USD (Currency Exposure)
 Investor USD (Hedged)
 Administrative
 Administrative AUD (Hedged)
 Administrative CHF (Hedged)
 Administrative EUR (Hedged)
 Administrative GBP (Hedged)
 Administrative HKD (Unhedged)
 Administrative SEK (Hedged)
 Administrative SGD (Hedged)
 E Class
 E Class AUD (Hedged)
 E Class CHF (Hedged)
 E Class EUR (Currency Exposure)
 E Class EUR (Hedged)
 E Class EUR (Partially Hedged)
 E Class EUR (Unhedged)
 E Class GBP (Hedged)
 E Class HKD (Unhedged)
 E Class JPY (Hedged)
 E Class NOK (Hedged)
 E Class RMB (Hedged)
 E Class SGD (Hedged)
 E Class USD (Currency Exposure)

E Class USD (Hedged)
 G Retail EUR (Hedged)
 G Retail EUR (Unhedged)
 H Institutional
 H Institutional EUR (Hedged)
 H Institutional USD (Currency Exposure)
 H Institutional USD (Hedged)
 M Retail
 M Retail AUD (Hedged)
 M Retail HKD (Unhedged)
 M Retail SEK (Hedged)
 M Retail SGD (Hedged)
 M Retail USD (Hedged)
 N Retail
 R Class
 R Class AUD (Hedged)
 R Class EUR (Hedged)
 R Class GBP (Hedged)
 R Class SEK (Hedged)
 T Class
 T Class EUR (Hedged)
 W Class
 W Class CAD (Hedged)
 W Class CHF (Hedged)
 W Class EUR (Hedged)
 W Class GBP (Hedged)
 W Class NOK (Hedged)
 W Class SEK (Hedged)
 W Class SGD (Hedged)
 W Class USD (Currency Exposure)
 Z Class
 Z Class AUD (Hedged)
 Z Class EUR (Hedged)
 Z Class GBP (Hedged)

Anteilsarten:

Innerhalb jeder Klasse darf die Gesellschaft, vorbehaltlich der jeweiligen Ergänzung, ausschüttende Anteile (Einkommen ausschüttende Anteile), thesaurierende Anteile (Einkommen thesaurierende Anteile) und/oder Income II-Anteile (Anteile, die eine höhere Rendite liefern sollen) ausgeben.

Nettovermögen (Angaben in Tausend):

USD 214.754.619

Mindestbestand:

Der Mindestbestand für die Anteilsklassen Institutional, Investor, Administrative, H Institutional und W Class liegt bei 500.000 USD oder dem entsprechenden Betrag in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse. Der Mindestbestand für die Anteilsklassen E, G Retail, M Retail, N Retail, R und T liegt bei 1.000 USD oder dem Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse. Der Mindestbestand für die Anteilsklassen Z liegt bei 20 Mio. USD oder dem Gegenwert in der jeweiligen Anteilsklassenwährung. Die Pacific Investment Management Company LLC („PIMCO“) ist nach eigenem Ermessen befugt, auf das Erfordernis der Mindestanzahlzeichnung und des Mindestbestandes gemäß dem aktuellen Verkaufsprospekt zu verzichten.

Handelstag:

Für einen Teilfonds bezeichnet er den Tag oder die Tage, die die jeweilige Ergänzung zu diesem Teilfonds vorgibt, wobei es alle vierzehn Tage mindestens einen Handelstag geben muss. Der Verwaltungsrat hat PIMCO die Befugnis erteilt, die Häufigkeit der Handelstage je Fonds zu ändern. Jegliche Änderung an der Häufigkeit der Handelstage erfordert die vorherige Zustimmung der Verwahrstelle, und dies wird den Anteilhabern des/der betroffenen Teilfonds im Voraus mitgeteilt.

Ungeachtet der vorangehenden Ausführungen ist ein Tag für einen Teilfonds kein Handelstag, wenn es entweder aufgrund von Feiertagen oder einer Markt- bzw. Börsenschließung in jeglichem Rechtsgebiet schwierig ist, (i) einen Teilfonds zu verwalten oder (ii) einen Teil des Fondsvermögens zu bewerten. Weitere Einzelheiten über geplante Schließungen von Teilfonds während des Jahres können von Anteilhabern und potenziellen Anlegern beim Administrator erfragt oder dem Feiertagskalender der Teilfonds entnommen werden (eine Kopie desselben kann beim Administrator angefordert werden).

* Eine vollständige Liste aller während des aktuellen und vorangegangenen Berichtszeitraums ausgegebenen Anteilsklassen ist Erläuterung 16 zu entnehmen. Eine Liste aller für die einzelnen Teilfonds angebotenen Anteilsklassen ist dem Verkaufsprospekt zu entnehmen.

ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

Funktionswahrung der Teilfonds:

USD (\$), mit Ausnahme der Teilfonds UK Corporate Bond Fund und UK Long Term Corporate Bond Fund, die auf Pfund Sterling (£) lauten, sowie der Teilfonds Dynamic Multi-Asset Fund, Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, Euro Short-Term Fund, PIMCO European High Yield Bond Fund und PIMCO European Short-Term Opportunities Fund, die auf Euro (€) lauten.

Zulassung in Hongkong:

Die Gesellschaft und bestimmte ihrer Teilfonds sind von der Securities and Futures Commission in Hongkong („SFC“) zugelassen und unterliegen den Anforderungen des von der SFC herausgegebenen Code on Unit Trusts and Mutual Funds („Code“). Derzeit konnen die folgenden Teilfonds Finanzderivate zu Anlagezwecken, zur Absicherung und/oder zur effizienten Portfolioverwaltung erwerben. Der Einsatz von Finanzderivaten erfolgt vorbehaltlich der voraussichtlichen Hochstgrenzen im uberarbeiteten Code, wie nachstehend aufgefuhrt. Die Einstufung der Teilfonds entweder als Derivatfonds oder als Nicht-Derivatfonds ist ebenfalls nachstehend angegeben. Es gibt keine anderungen bezuglich des Einsatzes von Finanzderivaten durch die folgenden Teilfonds:

Fonds	Erwartetes maximales Nettoengagement in Derivaten (% des Nettoinventarwerts)	Einstufung des Fonds
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	bis 50 %	Nicht-Derivatfonds
Asia Strategic Interest Bond Fund	bis 50 %	Nicht-Derivatfonds
Commodity Real Return Fund	uber 100 %	Derivatfonds
Diversified Income Fund	uber 100 %	Derivatfonds
Emerging Local Bond Fund	uber 100 %	Derivatfonds
Emerging Markets Bond Fund	uber 100 %	Derivatfonds
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	uber 100 %	Derivatfonds
Global Bond Fund	uber 100 %	Derivatfonds
Global High Yield Bond Fund	bis 50 %	Nicht-Derivatfonds
Global Investment Grade Credit Fund	uber 100 %	Derivatfonds
Global Real Return Fund	uber 100 %	Derivatfonds
Income Fund	uber 100 %	Derivatfonds
Income Fund II	bis 50 %	Nicht-Derivatfonds
Low Average Duration Fund	uber 100 %	Derivatfonds
Total Return Bond Fund	uber 100 %	Derivatfonds
US High Yield Bond Fund	bis 50 %	Nicht-Derivatfonds

Die folgenden Teilfonds sind in Hongkong nicht zugelassen und fur Einwohner von Hongkong nicht erhaltlich:

PIMCO Capital Securities Fund
 PIMCO Climate Bond Fund
 PIMCO Credit Opportunities Bond Fund
 Diversified Income Duration Hedged Fund
 Dynamic Bond Fund
 Dynamic Multi-Asset Fund
 Emerging Markets Bond ESG Fund
 Emerging Markets Corporate Bond Fund
 PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
 PIMCO ESG Income Fund
 Euro Bond Fund
 Euro Credit Fund
 Euro Income Bond Fund
 Euro Long Average Duration Fund
 Euro Short-Term Fund
 PIMCO European High Yield Bond Fund
 PIMCO European Short-Term Opportunities Fund Global Advantage Fund
 Global Bond ESG Fund
 Global Bond Ex-US Fund
 PIMCO Global Core Asset Allocation Fund
 Global Investment Grade Credit ESG Fund
 Global Libor Plus Bond Fund
 Global Low Duration Real Return Fund
 Inflation Strategy Fund
 Low Duration Global Investment Grade Credit Fund
 Low Duration Income Fund
 PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund
 Mortgage Opportunities Fund
 PIMCO StocksPLUS™ AR Fund
 StocksPLUS™ Fund
 Strategic Income Fund

PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
 UK Corporate Bond Fund
 UK Long Term Corporate Bond Fund
 US Investment Grade Corporate Bond Fund
 US Short-Term Fund

Zulassung in Singapur

Die folgenden Teilfonds werden von der Monetary Authority of Singapore gema dem Securities and Futures Act, Chapter 289 von Singapur, nicht anerkannt und stehen Privatanlegern in Singapur nicht zur Verfugung:

PIMCO Capital Securities Fund
 PIMCO Credit Opportunities Bond Fund
 Emerging Markets Bond ESG Fund
 PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
 Euro Credit Fund
 Euro Income Bond Fund
 Euro Long Average Duration Fund
 Euro Short-Term Fund
 PIMCO European High Yield Bond Fund
 PIMCO European Short-Term Opportunities Fund Global Bond ESG Fund
 Global Investment Grade Credit ESG Fund
 Global Libor Plus Bond Fund
 Global Low Duration Real Return Fund
 Inflation Strategy Fund
 PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund
 Mortgage Opportunities Fund
 PIMCO StocksPLUS™ AR Fund
 PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
 UK Corporate Bond Fund
 UK Long Term Corporate Bond Fund
 US Short-Term Fund

Reuters-Seite:

PAFPPLC

™ Eingetragenes Warenzeichen oder Warenzeichen der Pacific Investment Management Company LLC in den USA und/oder anderen Landern

	Seite
Schreiben des Vorsitzenden*	4
Wichtige Angaben zu den Teilfonds	5
Beschreibungen der Vergleichsindizes	65
Finanzstatus	70
Betriebsergebnisrechnung	88
Ausweis der Nettovermögensänderungen	106
Aufstellung der Wertpapieranlagen	112
Erläuterungen zum Abschluss	724
Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung	779
Begriffsbestimmungen	832
Allgemeine Informationen	834

TEILFONDS	Teilfonds- überblick*	Aufstellung der Wertpapieranlagen
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	6	112
Asia Strategic Interest Bond Fund	7	121
PIMCO Capital Securities Fund	8	129
PIMCO Climate Bond Fund	10	138
Commodity Real Return Fund	11	145
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	12	155
Diversified Income Fund	13	165
Diversified Income Duration Hedged Fund	15	186
Dynamic Bond Fund	16	201
Dynamic Multi-Asset Fund	17	217
Emerging Local Bond Fund	18	228
Emerging Markets Bond Fund	19	248
Emerging Markets Bond ESG Fund	20	263
Emerging Markets Corporate Bond Fund	21	276
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	22	283
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	23	296
PIMCO ESG Income Fund	24	306
Euro Bond Fund	25	310
Euro Credit Fund	26	320
Euro Income Bond Fund	27	327
Euro Long Average Duration Fund	28	337
Euro Short-Term Fund	29	344
PIMCO European High Yield Bond Fund	30	351
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	31	355
Global Advantage Fund	32	363
Global Bond Fund	33	380
Global Bond ESG Fund	35	405
Global Bond Ex-US Fund	36	419
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	37	435
Global High Yield Bond Fund	38	446
Global Investment Grade Credit Fund	39	457
Global Investment Grade Credit ESG Fund	42	483
Global Libor Plus Bond Fund	43	495
Global Low Duration Real Return Fund	44	508
Global Real Return Fund	45	517
Income Fund	46	528
Income Fund II	48	565
Inflation Strategy Fund	49	569
Low Average Duration Fund	50	578
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	51	584
Low Duration Income Fund	52	595
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	53	607

TEILFONDS	Teilfonds- überblick*	Aufstellung der Wertpapieranlagen
Mortgage Opportunities Fund	54	610
StocksPLUS™ Fund	55	622
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	56	631
Strategic Income Fund	57	637
Total Return Bond Fund	58	653
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	59	665
UK Corporate Bond Fund	60	675
UK Long Term Corporate Bond Fund	61	683
US High Yield Bond Fund	62	691
US Investment Grade Corporate Bond Fund	63	701
US Short-Term Fund	64	716

Dieser Halbjahresbericht kann in andere Sprachen übersetzt werden. Eine solche Übersetzung darf nur dieselben Informationen wie der englischsprachige Halbjahresbericht enthalten und muss dieselbe Bedeutung haben. Soweit zwischen dem englischsprachigen Halbjahresbericht und dem Halbjahresbericht in einer anderen Sprache Abweichungen bestehen, hat der englischsprachige Halbjahresbericht Vorrang, es sei denn, es ist in irgendeiner Rechtsordnung, in dem 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 Halbjahresberichts, auf der diese Klage beruht, maßgeblich ist. Etwaige Streitigkeiten bezüglich der Bedingungen des Halbjahresberichts unterliegen unabhängig von der Sprache des Halbjahresberichts irischem Recht und werden in Übereinstimmung mit diesem ausgelegt.

* Dieses Dokument enthält die Meinungen der Gesellschaft und diese Meinungen können sich ohne Vorankündigung ändern. Dieses Material 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. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. 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.

Schreiben des Vorsitzenden

Sehr geehrte Anteilinhaber,

Wir hoffen, dass Sie und Ihre Familie in diesen schwierigen Zeiten sicher und gesund bleiben. Wir arbeiten weiterhin unermüdlich daran, die Märkte zu navigieren und die Vermögenswerte, die Sie uns anvertraut haben, zu verwalten. Im Anschluss an dieses Schreiben folgt der Halbjahresbericht von PIMCO Funds: Global Investors Series plc, der den am Mittwoch, 30. Juni 2021 abgeschlossenen sechsmonatigen Berichtszeitraum umfasst. Auf den nachfolgenden Seiten finden Sie nähere Einzelheiten zu den Anlageergebnissen sowie Daten und Erläuterungen zu den Faktoren, die während des Berichtszeitraums den stärksten Einfluss auf die Wertentwicklung hatten.

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum Mittwoch, 30. Juni 2021

Die Weltwirtschaft litt weiterhin unter den Auswirkungen der COVID-19-Pandemie. In seinem *Wald Economic Outlook Update* vom April 2021 erwartete der Internationale Währungsfonds (IWF) für 2021 ein Wachstum des US-Bruttoinlandsprodukts (BIP) von 6,4 % nach einem Rückgang um 3,5 % im Jahr 2020. Die BIP-Wachstumsprognosen des IWF für 2021 liegen bei 4,4 % für die Eurozone, 5,3 % für Großbritannien und 3,3 % für Japan. Zum Vergleich: Für 2020 wird für diese Volkswirtschaften von einem BIP-Rückgang von 6,6 %, 9,9 % und 4,8 % ausgegangen.

Vor diesem Hintergrund setzten Notenbanken und Regierungen überall auf der Welt ihre entschlossenen und weitreichenden Maßnahmen zur Stützung der Wirtschaft fort. Die Europäische Zentralbank (EZB) beließ die Zinsen auf einem Allzeittief. Sie setzte darüber hinaus ihre Anleihekäufe fort und weitete diese im Juni 2021 gegenüber dem vorherigen Jahresverlauf noch erheblich aus. Im Juli 2021, also nach Ende des Berichtszeitraums, kündigte die EZB ihren ersten Strategiewechsel seit 2003 an und strebt nun ein mittelfristiges Inflationsziel von 2 % an. Zuvor hatte es knapp darunter gelegen. Die Bank of England beließ ihren Leitzins beim Rekordtief von 0,10 % und setzte ihr Anleihekaufprogramm fort. Im Juni gab die britische Notenbank bekannt, sie plane keine Zinserhöhung, solange es keine klaren Anzeichen für signifikanten Fortschritt beim Abbau von Überkapazitäten und das Erreichen des Inflationsziels von 2 % gibt. Unterdessen beließ die Bank of Japan ihren kurzfristigen Zinssatz unverändert bei -0,1 %. Gleichzeitig erhöhte sie das Ziel für ihre Bestände an Unternehmensanleihen. Im Juni 2021 verlängerte sie ihr ursprünglich bis September laufendes Programm zur Bekämpfung der Pandemiefolgen um mindestens weitere sechs Monate.

Trotz verbesserter Wirtschaftsdaten und Inflationsssorgen behielt die Federal Reserve („Fed“) ihre lockere Geldpolitik bei. Sie beließ den Leitzins bei historisch niedrigen 0,00 % bis 0,25 % und kaufte weiterhin monatlich Treasuries im Volumen von 80 Milliarden USD und Agency-MBS für 40 Milliarden USD. Bei ihrer Konferenz im Juni 2021 prognostizierte die Fed jedoch erstmals wieder eine Leitzinserhöhung. Die US-Notenbank erwartet nun zwei Zinserhöhungen bis Ende 2023. In ihrem Lagebericht vom März 2021 war sie noch davon ausgegangen, dass diese in einem längeren Zeitraum bis 2024 erfolgen würden. Fed-Präsident Jerome Powell sagte, sein Institut erwäge mittlerweile eine Reduzierung der Anleihekäufe, und bekräftigte seine Haltung zum Thema Inflation: „Die vorübergehenden Angebotseffekte schwächen sich ab, und die Inflation wird voraussichtlich sinken und sich unserem langfristigen Ziel annähern.“ Darüber hinaus bezeichnete er jede Diskussion über eine Leitzinserhöhung als „stark verfrüht“.

Die Renditen auf kurz- und langfristige US-Treasuries stiegen während des Berichtszeitraums, allerdings von sehr niedrigem Niveau aus. Die Rendite auf die als Benchmark angesetzten 10-jährigen US-Staatsanleihen lag zum Ende des Berichtszeitraums bei 1,45%, nachdem sie zum Donnerstag, 31. Dezember 2020 noch 0,93% betragen hatte. Der Bloomberg Barclays 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 -2,02%. Der Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged), ein weitläufig verwendeter Index für globale Anleihen mit Investment Grade-Rating, rentierte derweil mit -1,04%. Mit höherem Risiko behaftete festverzinsliche Anlageklassen wie etwa hochverzinsliche Unternehmensanleihen und Schuldtitel aus Schwellenländern erzielten unterschiedliche Renditen. Der ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged), ein gängiger Index für Anleihen unterhalb von Investment Grade, verzeichnete eine Rendite von 3,65 %, während Auslandsschulden von Schwellenländern, die vom JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (USD Hedged) abgebildet werden, mit -1,00 % rentierten. Auf Landeswährungen lautende Schwellenmarktanleihen, die vom JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) abgebildet werden, rentierten mit -3,38%.

Trotz volatiler Perioden entwickelten sich globale Aktien insgesamt sehr gut. Insgesamt rentierten die im S&P 500 Index enthaltenen US-Aktien mit 15,25 % – befeuert von lockerer Geld- und Fiskalpolitik sowie verbesserter Anlegerstimmung aufgrund gestiegener Impfquoten. Die im MSCI World Index vertretenen globalen Aktien brachten eine Rendite von 13,05 %, und die im MSCI Emerging Markets Index vertretenen Schwellenmarktaktien rentierten mit 7,45 %. Die japanischen Papiere des Nikkei 225 Index (in JPY) verbuchten ein Plus von 5,74 %, während die vom MSCI Europe Index abgebildeten europäischen Aktien mit 15,35 % rentierten.

Die Rohstoffpreise schwankten, entwickelten sich jedoch insgesamt positiv. Zu Beginn des Berichtszeitraums notierte Brent-Rohöl noch bei etwa 51 USD je Barrel, zum Ende lag der Preis jedoch bei ca. 75 USD je Barrel. Der starke Anstieg der Ölpreise ist unserer Einschätzung nach darauf zurückzuführen, dass zuerst die Produktionsmengen gedrosselt wurden und anschließend weltweit aufgrund verbesserter Konjunktur die Nachfrage anzog. Auch die Kupferpreise entwickelten sich steil nach oben, während die Goldpreise sanken.

An den Devisenmärkten wurden Phasen erhöhter Volatilität verzeichnet, was unserer Einschätzung nach auf Schwankungen des Wirtschaftswachstums, Handelskonflikte, eine veränderte geldpolitische Ausrichtung der Zentralbanken sowie verschiedene geopolitische Ereignisse zurückzuführen war. Der US-Dollar wertete gegenüber anderen wichtigen Währungen auf. Er rentierte beispielsweise mit 2,93 % gegenüber dem Euro und 7,07 % gegenüber dem japanischen Yen. Gegenüber dem britischen Pfund wertete die US-Währung jedoch um 1,18 % ab.

Vielen Dank für das Kapital, das Sie bei PIMCO platziert haben. Wir wissen Ihr Vertrauen sehr zu schätzen und werden weiterhin hart daran arbeiten, Ihren breit gefächerten Anlagebedarf zu erfüllen. Bei Fragen bezüglich Ihrer Anlage in PIMCO Funds: Global Investors Series plc, wenden Sie sich bitte unter **+353 (1) 776 9990** an den Verwalter.

Mit freundlichem Gruß



Craig A. Dawson
Vorsitzender

Die angegebene Performance stellt die Wertentwicklung in der Vergangenheit dar. 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. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

Wichtige Angaben zu den Teilfonds

Dieses Dokument darf nur in Verbindung mit dem aktuellen Verkaufsprospekt der PIMCO Funds: Global Investors Series plc verwendet werden. Anleger sollten vor einer Anlage in den Teilfonds deren Anlageziele, Risiken, Gebühren und Auslagen sorgfältig prüfen. Diese und andere Informationen sind im Verkaufsprospekt enthalten. Bitte lesen Sie den Verkaufsprospekt sorgfältig, bevor Sie eine Anlage tätigen oder Gelder anweisen.

Nach unserer Überzeugung spielen Anleihe-Fonds in einem gut gefächerten Anlageportfolio eine wichtige Rolle. Es gilt jedoch zu beachten, dass in einem Umfeld, in dem die Zinssätze einer Aufwärtstendenz folgen können, steigende Zinsen einen negativen Einfluss auf die Wertentwicklung der meisten Anleihe-Fonds haben und die von einem Teilfonds gehaltenen Rentenpapiere voraussichtlich an Wert verlieren. Die Kursschwankungsintensität von Rentenpapieren kann in Zeiten steigender Zinsen ebenfalls zunehmen und dadurch zu erhöhten Verlusten für die Teilfonds führen. Anleihe-Fonds und einzelne Anleihen mit einer längeren Duration (Maß für die mittlere Restlaufzeit eines Wertpapiers) neigen zu stärkeren Reaktionen auf Zinssatzänderungen, was sie gewöhnlich schwankungsanfälliger macht als Wertpapiere oder Teilfonds mit kürzeren Durationen. Die längerfristige Wertentwicklung der meisten Anleihe-Fonds hat von den Kapitalgewinnen profitiert, die sich zum Teil aus einem längeren Zeitraum fallender Zinsen ergeben. Bei steigenden Zinsen ist nicht davon auszugehen, dass diese Kapitalgewinne wiederkehren.

Die Teilfonds können zusätzlich zu den vorstehend, im Verkaufsprospekt der Fonds und im Abschnitt „Finanzrisiken“ in den Erläuterungen zum Abschluss beschriebenen Risiken weiteren Risiken unterliegen. Bei einigen dieser Risiken kann es sich unter anderem um folgende handeln: Realzinsrisiko, Derivatrisiko, die mit kleinen Unternehmen, Auslandswertpapieren und Hochzinsspapieren verbundenen Risiken, mit einem bestimmten Sektor einhergehende sowie epidemie-/pandemiebezogene Anlagerisiken. Die Teilfonds dürfen zu Absicherungszwecken oder als Teil einer Anlagestrategie derivative Instrumente verwenden. Der Einsatz dieser Instrumente kann mit bestimmten Kosten und Risiken einhergehen, wie zum Beispiel Liquiditätsrisiko, Zinssatzrisiko, Marktrisiko, Kreditrisiko, Verwaltungsrisiko und dem Risiko, dass ein Teilfonds eine Position nicht dann glattstellen kann, wenn es für ihn am vorteilhaftesten wäre. Teilfonds, die in derivative Instrumente anlegen, können einen höheren Betrag als den in diese Instrumente angelegten Kapitalbetrag verlieren. Anlagen in Auslandswerten können Risiken bergen, die von den ausländischen wirtschaftlichen und politischen Entwicklungen abhängen. Dieses Risiko kann bei Anlagen in Schwellenmärkten steigen. Hochzinsanleihen erhalten grundsätzlich eine niedrigere Bonitätsbewertung als andere Anleihen. Anleihen mit niedrigerem Rating sind in der Regel in Bezug auf das Anleihekaptal mit einem höheren Risiko behaftet als höher bewertete Anleihen. Kleinere Unternehmen können schwankungsanfälliger als größere Unternehmen und deshalb mit einem höheren Risiko verbunden sein. Auch die Konzentration von Anlagen auf einzelne Sektoren kann im Gegensatz zu einem diversifizierten Teilfonds mit einem zusätzlichen Risiko und einer zusätzlichen Volatilität einhergehen.

Die Klassifizierung der Portfoliositionen eines Teilfonds 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 Teilfonds verwendet wird. Dies gilt unter anderem für diejenigen, die jeweils im Verkaufsprospekt, in den Anlagezielen oder in aufsichtsrechtlichen und anderen Anlagebeschränkungen und -richtlinien des Teilfonds verwendet werden, welche gegebenenfalls auf anderen Klassifizierungen in Bezug auf Anlageklassen, Sektoren oder geografische Regionen beruhen können. Alle Teilfonds 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 Teilfonds 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 Teilfonds oder auf bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Teilfonds 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 Teilfonds 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 Teilfonds gehaltener Anlagen oder zu einer Verringerung der Wirksamkeit damit verbundener Fondstransaktionen wie z.B. Absicherungen führen. Darüber hinaus kann der Übergangsprozess auch Änderungen bei Anlageziel und Anlagepolitik eines Teilfonds erfordern. Derartige Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR sowie andere unvorhergesehene Auswirkungen könnten dazu führen, dass ein Teilfonds Verluste erleidet oder zusätzliche Kosten tragen muss.

Die Überblicksseiten der einzelnen Teilfonds in diesem Jahresbericht bieten eine Übersicht über die Nettowertentwicklung der Anlage. Hierbei wird davon ausgegangen, dass alle Dividenden und Kapitalgewinnausschüttungen wiederangelegt wurden. In den Erträgen ist der Abzug von Steuern, die ein Anteilinhaber auf (i) Ausschüttungen des Teilfonds oder (ii) die Rückgabe von Investmentanteilen des Teilfonds zu zahlen hat, nicht berücksichtigt. Die Nettowertentwicklung der einzelnen Fonds wird durch Vergleich mit einem breit angelegten Wertpapierindex (Vergleichsindex) ermittelt. Die vergangene Wertentwicklung eines Fonds vor und nach Steuern lässt keine Rückschlüsse auf dessen zukünftige Wertentwicklung zu. Anlagen in einem Teilfonds gelten nicht als Bankeinlagen und werden nicht von der Federal Deposit Insurance Corporation oder einer anderen behördlichen Stelle verbürgt oder versichert. Bei Anlagen in Teilfonds sind finanzielle Verluste möglich.

Anlagen in einem Teilfonds gelten nicht als Bankeinlagen und werden nicht von einer behördlichen Stelle verbürgt oder versichert. Der Wert der und die Einkünfte aus den Anteilen am Teilfonds können steigen oder sinken und eventuell erhalten Sie nicht den ursprünglich in den Teilfonds investierten Betrag zurück.

Angaben zur Wertentwicklung in der Vergangenheit sind kein Indikator für die aktuelle oder zukünftige Wertentwicklung. Bei diesen Angaben sind Gebühren und Kosten für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen nicht berücksichtigt.

PIMCO Funds: Global Investors Series plc wird vertrieben von PIMCO Europe Ltd, 11 Baker Street, London W1U 3AH, Vereinigtes Königreich, PIMCO Europe GmbH, Seidlstrasse 24-24a, 80335 München, Deutschland, PIMCO Asia Pte Ltd., 8 Marina View, #30-01, Asia Square Tower 1, Singapur 018960, PIMCO Asia Limited, Suite 2201, 22nd Floor, Two International Finance Centre, 8 Finance Street, Central Hong Kong und PIMCO Australia Pty Ltd., Level 19, 5 Martin Place, Sydney, New South Wales 2000 Australien; www.pimco.com.

PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	1,04 %	6,69 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	0,99 %	6,69 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2021)	—	(1,20 %)
Investor, ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020)	0,88 %	4,74 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	0,74 %	6,16 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 01. Juli 2020)	0,56 %	8,50 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	0,54 %	5,73 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. März 2021)	—	1,00 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. März 2021)	—	1,04 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	0,55 %	5,73 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	1,37 %	7,42 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade	1,29 %	6,06 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2020)	0,80 %	5,44 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (AUD Hedged)	1,12 %	4,79 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	0,58 %	4,80 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	0,59 %	4,81 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	0,10 %	4,20 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	0,04 %	4,17 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (CHF Hedged)	0,69 %	4,43 %
Auf CNH lautende Klassen		
Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Okt. 2020)	2,09 %	6,92 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (CNH Hedged)	2,47 %	6,48 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	0,57 %	5,30 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	0,68 %	5,36 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Sep. 2020)	0,46 %	3,17 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sept. 2020)	0,19 %	4,70 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	0,23 %	4,65 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (EUR Hedged)	0,81 %	2,66 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 6. Mai 2021)	—	(0,90 %)
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (GBP Hedged)	—	(0,92 %)
Auf HKD lautende Klassen		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	0,71 %	5,29 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	0,83 %	5,32 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (HKD Unhedged)	1,44 %	5,59 %
Auf SGD lautende Klassen		
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020)	0,87 %	4,74 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	0,61 %	5,29 %
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	0,62 %	5,32 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (SGD Hedged)	1,28 %	5,55 % ²

Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er in einen Mix aus festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten, die wirtschaftlich mit asiatischen Ländern, ausgenommen Japan, verbunden sind, sowie verbundenen Derivaten auf diese Wertpapiere investiert. Vom Teilfonds gekaufte Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) sind von Moody's mindestens mit C oder von S&P oder Fitch gleichwertig bewertet (oder weisen, falls sie kein Rating haben, nach Meinung der Anlageberatungsgesellschaft eine vergleichbare Qualität auf). Ausgenommen davon sind hypothekarisch gesicherte Wertpapiere, für die es kein vorgeschriebenes Mindest-Kreditrating gibt.

Kommentare zum Fonds

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

» Anlagen in bestimmten Unternehmensanleihen aus Industrieländern aus dem Finanz- und Industriezweig trugen zur relativen Wertentwicklung bei.

» Die Auswahl von bestimmten indonesischen und indischen Unternehmensanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei.

» Untergewichtung in bestimmten Unternehmensanleihen von Emittenten aus Hongkong, insbesondere aus den Sektoren Finanzdienstleistungen und Versicherungen, beeinträchtigte die Wertentwicklung.

» Untergewichtung in bestimmten chinesischen Local Government Financing Vehicles (LGFV) und Industrieunternehmen beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da sich bestimmte Titel nach einer schwierigen Phase erholten.

» Untergewichtung am langen Ende der US-Kurve beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen sanken.

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 04. Sep. 2020)	0,41 %	2,62 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 04. Sep. 2020)	0,00 %	1,90 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2010)	(0,02 %)	4,17 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Dez. 2020)	0,79 %	1,70 %
JPMorgan Asia Credit Index ³	(0,12 %)	4,72 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 5. Mrz. 2021)	—	0,81 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 5. Mrz. 2021)	—	0,50 %
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Unhedged) ³	—	0,67 %
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jun. 2011)	3,22 %	4,16 %
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Unhedged) ³	3,05 %	5,26 %
Auf HKD lautende Klassen		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Sep. 2020)	0,19 %	2,11 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2011)	0,18 %	2,57 %
JPMorgan Asia Credit Index (HKD Unhedged) ³	0,04 %	3,46 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Okt. 2020)	0,43 %	3,44 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Okt. 2020)	0,01 %	2,82 %
JPMorgan Asia Credit Index (SGD Hedged) ³	(0,09 %)	1,46 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Asia Strategic Interest Bond Fund basiert auf folgenden Faktoren: Von der Auflegung bis 31. Mai 2016: [90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % 1-Month USD LIBOR] * [JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)] / [3-Month USD LIBOR]; Seit 01. Juni 2016: JPMorgan Asia Credit.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Asia Strategic Interest Bond Fund strebt attraktive und stabile Erträge an. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Teilfonds kann gemäß der Definition im Verkaufsprospekt bis zu 50 % seines Gesamtvermögens in hoch verzinsliche Rentenpapiere anlegen. Gemäß Definition im Verkaufsprospekt konzentriert der Teilfonds seine Anlagestrategie auf festverzinsliche Instrumente aus Asien ex Japan, in die er mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens investiert. Er kann jedoch gemäß Definition im Verkaufsprospekt bis zu einem Drittel seines Vermögens in andere festverzinsliche Instrumente von Staats- und Unternehmensemittenten außerhalb Asiens ex Japan investieren.

Kommentare zum Fonds

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

- » Das Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen aus Indien, Indonesien und Macao trug aufgrund der Titelauswahl zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Das Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade aus China und Hongkong trug aufgrund der Titelauswahl zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Das Engagement in Staatsanleihen aus Sri Lanka trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da sich der Sektor insgesamt positiv entwickelte.
- » Das Engagement in einer chinesischen quasi-staatlichen Anleihe aus dem Finanzsektor wirkte sich negativ auf die absolute Wertentwicklung aus.
- » Das Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen aus dem Immobiliensektor beeinträchtigte die absolute Wertentwicklung, da die Anlageklasse negative Renditen aufwies.

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	4,13 %	7,16 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2014)	4,18 %	6,41 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2014)	4,03 %	5,84 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	4,02 %	5,85 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	3,86 %	6,54 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	3,90 %	6,53 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	3,67 %	5,90 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	3,64 %	5,28 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	3,72 %	5,66 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	4,10 %	6,17 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	3,53 %	5,46 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2013)	4,51 %	7,64 %
3 Month USD LIBOR Index	0,11 %	1,04 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	3,83 %	6,15 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Aug. 2015)	4,47 %	7,19 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	0,01 %	1,44 % ²
Auf BRL lautende Klassen		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jan. 2018)	8,67 %	(4,07 %)
ICE BofAML 3 Month USD LIBOR Index Hedged BRL Denominated in USD	4,60 %	(7,81 %)
Auf CAD lautende Klassen		
Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	3,84 %	7,14 %
3 Month USD LIBOR (CAD Hedged) Index	0,08 %	1,22 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	3,63 %	5,01 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	3,13 %	2,84 %
3 Month USD LIBOR (in CHF besichert)	(0,42 %)	(0,87 %) ²
Auf CNH lautende Klassen		
Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	5,23 %	9,31 %
3 Month USD LIBOR (CNH Hedged) Index	1,33 %	2,95 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	3,72 %	5,43 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	3,75 %	5,43 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	3,74 %	4,38 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2016)	3,56 %	6,01 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	3,47 %	4,90 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	3,31 %	4,23 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	3,36 %	3,74 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	3,61 %	4,05 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	3,05 %	3,36 %
3 Month Euribor	(0,27 %)	(0,20 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	4,05 %	6,09 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	4,01 %	6,17 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	3,79 %	4,28 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	3,97 %	4,73 %
3 Month GBP LIBOR Index	0,03 %	0,52 % ²

Der PIMCO Capital Securities Fund strebt Engagements mit Fokus auf Capital Securities (wie im Verkaufsprospekt definiert) zusammen mit einer maximalen Gesamtrendite an, in Übereinstimmung mit der Kapitalerhaltung und umsichtigen Anlageverwaltung durch die Anlage in ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten bestehendes Portfolio (wie im Verkaufsprospekt definiert) und andere Wertpapiere, von denen gemäß den im Verkaufsprospekt des Teilfonds angegebenen Richtlinien mindestens 80 % in Capital Securities angelegt werden.

Kommentare zum Fonds

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

- » Das Engagement bei zusätzlichen Tier-1-Anleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Taktische Allokation auf Bankaktien, die deutlich zulegte, trug zur Wertentwicklung bei.
- » Die Titelauswahl im Bereich Tier-2-Anleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich bestimmte europäische Emittenten überdurchschnittlich entwickelten.
- » Das Engagement und die Titelauswahl bei vorrangigen Anleihen, die vor dem Hintergrund anfänglich engerer Spreads und höherer Anleiherenditen vergleichsweise schwach abschnitten, beeinträchtigte die Wertentwicklung.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf HKD lautende Klassen		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	3,85 %	5,49 %
3 Month HIBOR Index	0,15 %	1,50 %
Auf SGD lautende Klassen		
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	3,98 %	6,69 %
M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 23. Dez. 2013)	3,75 %	5,46 %
3 Month SGD LIBOR Index	0,14 %	1,06 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	(0,20 %)	1,50 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 01. Jun. 2021)	—	0,50 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	0,10 %	1,90 %
Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index (USD Hedged)	(2,12 %)	(0,67 %) ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Nov. 2020)	(0,60 %)	0,00 %
Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index (CHF Hedged)	(2,66 %)	(2,13 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	(0,59 %)	0,80 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Dez. 2020)	(0,64 %)	(0,15 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jun. 2021)	—	0,20 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sept. 2020)	(0,99 %)	0,10 %
Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index (EUR Hedged)	(2,51 %)	(1,34 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	(0,20 %)	1,30 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2021)	—	0,86 %
Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index (GBP Hedged)	(2,16 %)	(0,84 %) ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	—	1,10 %
Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index (SGD Hedged)	(2,08 %)	0,19 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Climate Bond Fund strebt bei umsichtiger Anlageverwaltung optimale risikobereinigte Renditen an und berücksichtigt langfristige Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel. Der Fonds verfolgt sein Anlageziel, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2006)	23,45 %	(1,36 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	23,17 %	(3,45 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	23,05 %	(2,79 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return	21,15 %	(3,00 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2010)	22,78 %	(1,84 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	22,24 %	(4,81 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Hedged)	20,42 %	(3,98 %) ²
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jun. 2021)	—	1,60 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Unhedged)	25,01 %	1,65 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2017)	22,96 %	2,86 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Hedged)	20,82 %	1,17 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Commodity Real Return Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er in (börsennotierte oder im Freiverkehr (OTC) gehandelte) derivative Instrumente investiert. Hierbei kann es sich um Swaps, Futures, Optionen auf Futures und strukturierte Schuldverschreibungen sowie rohstoffindexgebundene Schuldverschreibungen handeln, die es ihm ermöglichen, ein Engagement bei Indizes und Teilindizes (einschließlich unter anderem bei Indizes der Bloomberg Commodity-Indexfamilie) einzugehen, die sich auf Rohstoffe beziehen, die die Anforderungen der irischen Zentralbank erfüllen und gegebenenfalls von dieser freigegeben wurden. Nähere Einzelheiten zu den vom Fonds verwendeten Indizes sowie zu den Arten von Rohstoffen, auf die diese sich beziehen, sind auf Anfrage von der Anlageverwaltungsgesellschaft erhältlich. Diese Instrumente bieten ein Engagement gegenüber den Anlagerenditen der Rohstoffmärkte, ohne direkt in physische Rohstoffe zu investieren, und werden durch ein aktiv verwaltetes Portfolio mit internationalen Rentenwerten besichert (wie im Verkaufsprospekt definiert). Der Fonds kann außerdem in Stamm- und Vorzugsaktien sowie in wandelbare Wertpapiere von Emittenten in rohstoffbezogenen Branchen investieren.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Engagement in breiten Rohstoffkategorien trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da breite Rohstoffkategorien, gemessen am Bloomberg Commodity Index Total Return („BCOM“), Zugewinne verbuchten.
- » Die strukturelle Allokation auf globale kurzfristige US Treasury Inflation-Protected Securities („TIPS“) als Sicherheiten zur Deckung des Rohstoffengagements des Teilfonds trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da globale kurzfristige TIPS, gemessen am Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1- 5 Year Index (USD Hedged), Zugewinne verbuchten.
- » Eine Übergewichtung bei Non-Agency-MBS trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Renditen dieser Wertpapiere vor dem Hintergrund engerer Spreads positiv entwickelten.
- » Eine Übergewichtung bei Schuldtiteln mit Investment Grade trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Kreditspreads verengten.
- » Eine Übergewichtung bei US-Zinssätzen beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Eine Untergewichtung bei britischen Breakeven-Inflationsspreads (BEI) beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da sich die BEI-Spreads erweiterten.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	2,01 %	3,67 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	1,63 %	2,04 %
3 Month USD LIBOR Index	0,11 %	0,93 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2012)	1,47 %	1,19 %
3 Month USD LIBOR (in CHF besichert)	(0,42 %)	(0,55 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	1,61 %	2,44 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	1,15 %	0,69 %
3 Month Euribor	(0,27 %)	(0,04 %) ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund strebt die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche langfristige Rendite an. Der Teilfonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl im Finanzsektor wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich gehaltene Anleihen eines bestimmten Emittenten nach einer Unternehmensumstrukturierung positiv entwickelten.
- » Das Engagement in Non-Agency-MBS begünstigte aufgrund engerer Spreads die Wertentwicklung bei.
- » Das Engagement bei Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor positive Überschussrenditen erzielte.
- » Makrostrategien und insbesondere eine Übergewichtung von US-Duration beeinträchtigten aufgrund steigender Renditen die Wertentwicklung.
- » Das Engagement bei auf Lokalwährungen lautenden Schuldtiteln beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der Sektor negative Überschussrenditen erzielte.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	0,28 %	6,70 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Sep. 2008)	0,31 %	7,09 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	0,14 %	4,55 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	0,11 %	4,54 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	(0,03 %)	5,33 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	(0,16 %)	5,80 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	(0,15 %)	5,88 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2011)	0,23 %	5,65 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Mai 2020)	0,21 %	11,15 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	(0,18 %)	5,10 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(0,15 %)	4,87 %
N Retail, ausschüttend II (Auflegung: 30. Okt. 2020)	(0,19 %)	4,60 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(0,37 %)	4,43 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(0,32 %)	4,43 %
Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	0,38 %	4,40 %
Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	0,28 %	4,33 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged ³	0,30 %	6,21 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mai 2019)	(0,08 %)	5,38 %
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012)	(0,35 %)	4,80 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, AUD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, AUD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, AUD Hedged ³	0,20 %	5,32 % ²
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2019)	0,17 %	7,05 %
Class W CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	0,29 %	4,20 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, CAD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, CAD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, CAD Hedged ³	0,27 %	6,06 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	(0,20 %)	4,08 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	(0,26 %)	3,47 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Sept. 2019)	(0,66 %)	2,64 %
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(0,10 %)	3,30 %
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(0,20 %)	3,31 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, CHF Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, CHF Hedged; und JPMorgan EMBI Global, CHF Hedged ³	(0,28 %)	3,80 % ²

Der Diversified Income Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio mit Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein übergewichtetes Engagement bei Investment Grade-Anleihen aus den Pipeline- und Verkehrssektoren wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich diese Sektoren besser entwickelten als der Investment-Grade-Kreditmarkt insgesamt.
- » Eine Übergewichtung von hochverzinslichen Titeln aus dem Finanzsektor wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich nachrangige Schuldtitel von Banken sowie der Finanzdienstleistungssektor besser entwickelten als der Hochzins-Kreditmarkt insgesamt.
- » Das Engagement in Non-Agency-MBS begünstigte aufgrund engerer Spreads die Wertentwicklung.
- » Eine Übergewichtung in 7- und 30-jähriger US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Zinsen am langen Ende stiegen.
- » Der untergewichtete Hochzins-Energiesektor schmälerte die Wertentwicklung, da dieser Bereich besser abschnitt als der Hochzins-Kreditmarkt insgesamt.

Diversified Income Fund (Forts.)

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2007)	(0,11 %)	5,69 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Okt. 2007)	(0,16 %)	5,78 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2007)	(0,33 %)	5,54 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	(0,23 %)	3,20 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jul. 2007)	(0,34 %)	5,39 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jul. 2007)	(0,53 %)	4,99 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2009)	(0,58 %)	4,64 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(0,76 %)	2,50 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(0,76 %)	2,49 %
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	0,00 %	3,50 %
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	0,00 %	3,52 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, EUR Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, EUR Hedged; und JPMorgan EMBI Global, EUR Hedged ³	(0,13 %)	4,96 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2006)	0,19 %	6,52 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2006)	0,16 %	6,42 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	(0,12 %)	4,67 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	0,29 %	4,10 %
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	0,27 %	4,11 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, GBP Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, GBP Hedged; und JPMorgan EMBI Global, GBP Hedged ³	0,25 %	5,80 % ²
Auf MXN lautende Klassen		
Institutional MXN (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Dez. 2020)	2,24 %	3,39 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, MXN Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, MXN Hedged; und JPMorgan EMBI Global, MXN Hedged ³	2,30 %	3,41 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	0,05 %	5,95 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2020)	(0,23 %)	(0,16 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, SEK Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SEK Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SEK Hedged ³	0,05 %	5,25 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	0,34 %	5,48 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mai 2019)	0,12 %	5,92 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Okt. 2019)	(0,11 %)	4,18 %
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 11. Mrz. 2021)	—	1,90 %
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	0,29 %	4,43 %
jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, SGD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SGD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SGD Hedged ³	0,34 %	5,75 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Diversified Income Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 09. November 2015 jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Component (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global; seit dem 10. November 2015 jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged).

Diversified Income Duration Hedged Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2011)	2,53 %	4,10 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	2,52 %	5,06 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	2,36 %	3,14 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2013)	2,06 %	2,74 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2011)	2,02 %	3,19 %
Gleichgewichtete Mischung von drei Indizes mit einer konstanten Duration von 0,25 Jahren, wie von PIMCO berechnet: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged ²	2,33 %	3,54 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2011)	2,10 %	3,16 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	2,12 %	2,08 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	1,61 %	2,37 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 7. Mai 2013)	1,66 %	0,81 %
Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter 0,25-Jahres-Duration: jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, EUR Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, EUR Hedged; und JPMorgan EMBI Global, EUR Hedged ³	1,96 %	2,83 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2011)	2,31 %	3,94 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2013)	2,30 %	2,54 %
Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter 0,25-Jahres-Duration: jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, GBP Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, GBP Hedged; und JPMorgan EMBI Global, GBP Hedged ³	2,27 %	3,47 % ²

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Diversified Income Duration Hedged Fund versucht, in Übereinstimmung mit umsichtiger Anlageverwaltung die derzeitige Rendite zu maximieren, indem er mindestens 80 % seines Nettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio von variabel und flexibel verzinslichen Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) und Renteninstrumenten mit einer Duration von höchstens einem Jahr sowie fest verzinslichen Renteninstrumenten anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Das Engagement in Non-Agency-MBS begünstigte aufgrund engerer Spreads die Wertentwicklung.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei Investment Grade-Anleihen aus den Pipeline- und Verkehrssektoren wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich diese Sektoren besser entwickelten als der Investment-Grade-Kreditmarkt insgesamt.
- » Eine Übergewichtung von hochverzinslichen Titeln aus dem Finanzsektor wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich nachrangige Schuldtitel von Banken sowie der Finanzdienstleistungssektor besser entwickelten als der Hochzins-Kreditmarkt insgesamt.
- » Eine Übergewichtung in 5-jähriger, 10-jähriger und 30-jähriger US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.
- » Eine Untergewichtung im Hochzins-Energiesektor schmälerte die Wertentwicklung, da dieser Bereich besser abschnitt als der Hochzins-Kreditmarkt insgesamt.

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Diversified Income Duration Hedged Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 9. November 2015: Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch High Yield BB-B Rated Developed Markets Constrained (USD Hedged), JPMorgan EMBI Global; seit dem 10. November 2015: Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged).

Dynamic Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2008)	1,02 %	3,21 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Feb. 2010)	0,97 %	2,89 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	0,88 %	2,20 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	0,80 %	2,19 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	0,79 %	2,35 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2010)	0,49 %	1,82 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2010)	0,52 %	1,83 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	0,90 %	4,44 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	0,97 %	4,39 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,00 %	2,30 %
1 Month USD LIBOR Index	0,06 %	0,65 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	1,34 %	4,45 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	0,01 %	1,66 %
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	1,00 %	3,73 %
1 Month LIBOR Index (CAD Hedged)	0,01 %	0,86 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2010)	0,54 %	1,07 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Apr. 2011)	0,10 %	0,16 %
1 Month CHF LIBOR Index	(0,40 %)	(0,46 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2009)	0,60 %	2,40 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Dez. 2009)	0,59 %	1,97 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2011)	0,44 %	1,26 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	0,32 %	1,38 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2009)	0,17 %	1,05 %
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Dez. 2010)	0,11 %	0,74 %
1 Month Euribor Index	(0,28 %)	0,04 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2009)	0,91 %	2,52 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	0,96 %	2,29 %
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 2010)	0,43 %	1,49 %
1 Month GBP LIBOR Index	0,02 %	0,49 % ²
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Apr. 2011)	0,99 %	2,84 %
1 Month NIBOR Rate Index	0,14 %	1,29 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Mrz. 2018)	0,80 %	1,89 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2011)	0,55 %	1,50 %
1 Month SEK LIBOR Index	(0,04 %)	0,19 % ²

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Dynamic Bond Fund beabsichtigt, einen höchstmöglichen langfristigen Gesamtertrag bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) unterschiedlicher Fälligkeiten anlegt. Der Teilfonds kann in sowohl festverzinsliche Wertpapiere mit Investment Grade-Rating als auch hochverzinsliche Titel investieren, wobei höchstens 40 % der Vermögenswerte in Wertpapiere angelegt werden können, die von Moody's niedriger als Baa bzw. von S&P niedriger als BBB bewertet werden bzw. die von Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben (oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind). Der Teilfonds kann bis zu 50 % seiner Vermögenswerte in festverzinsliche Wertpapiere investieren, die wirtschaftlich mit Schwellenländern verbunden sind.

Kommentare zum Fonds

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

- » Positionen in verbrieften Schuldtiteln, vor allem Non-Agency-MBS, trugen zur Wertentwicklung bei, da die Preise dieser Wertpapiere stiegen.
- » Positionen in Unternehmensanleihen mit Investment Grade, insbesondere aus dem Finanzsektor, trugen durch Carry, durch die Titelauswahl und aufgrund engerer Spreads bei diesen Papieren zur Wertentwicklung bei.
- » Positionen in US-Agency MBS trugen zur Wertentwicklung bei, da der Fonds für diese Wertpapiere Carry erzielte.
- » Long-Engagement in Duration in Lokalwährungen bestimmter Schwellenländer beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Zinsen in diesen Ländern stiegen.
- » Long-Engagement bei US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Long-Engagement bei italienischen Zinssätzen beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die italienischen Zinsen stiegen.

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	2,10 %	6,68 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 25. Feb. 2016)	2,08 %	6,68 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 14. Aug. 2020)	1,93 %	10,90 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	1,60 %	5,58 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Sep. 2020)	1,55 %	11,10 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2016)	1,39 %	4,71 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Aug. 2019)	2,53 %	12,64 %
1 Month Euribor Index	(0,28 %)	(0,41 %) ²
Auf AUD lautende Klassen		
M Retail AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 08. Apr. 2021)	—	2,41 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	0,01 %	0,01 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	1,99 %	6,43 %
1 Month CHF LIBOR Index	(0,40 %)	(0,79 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	2,36 %	7,50 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	2,37 %	11,59 %
1 Month GBP LIBOR Index	0,02 %	0,41 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 18. Dez. 2020)	1,87 %	3,50 %
Compounded SG OvernightRate Avg SORA Index	0,09 %	0,10 %
Auf USD lautende Klassen		
Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	2,54 %	8,88 %
Institutional USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 30. Apr. 2021)	—	2,55 %
Investor USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2021)	—	3,60 %
Class E USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	2,04 %	7,26 %
Class E USD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2021)	—	3,50 %
H Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 5. Aug. 2020)	2,41 %	10,70 %
M Retail USD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 8. Jan. 2020)	1,95 %	12,81 %
1 Month USD LIBOR Index	0,06 %	1,21 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Dynamic Multi-Asset Fund strebt bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung die maximal mögliche Gesamtrendite an, indem er sich an einem breiten Spektrum von Vermögensklassen beteiligt. Hierzu zählen beispielsweise Aktientitel (wie im Verkaufsprospekt definiert), Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) und Währungen sowie mit Rohstoffen und dem Immobiliensektor zusammenhängende Instrumente (wobei jedoch keine Direktanlagen in Rohstoffe und Immobilien vorgenommen werden), die die im Verkaufsprospekt dargestellte Anlagepolitik des Teilfonds vorsieht.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Long-Engagement in Aktien aus Schwellenländern, insbesondere chinesischen und taiwanesischen Titeln, trug zur Rendite bei, da die Kurse stiegen.
- » Ein Long-Engagement in US-Aktien, insbesondere aus den Sektoren Informationstechnologie und Gesundheitswesen, trug zur Rendite bei, da die Kurse dieser Papiere stiegen.
- » Ein Long-Engagement bei japanischen Aktien trug zur Rendite bei, da die Kurse stiegen.
- » Ein Short-Engagement bei europäischen Aktien belastete die Rendite, da die Kurse stiegen.
- » Ein Long-Engagement bei US-amerikanischer und kanadischer Duration schmälerte die Rendite, da die Renditen dieser Staatsanleihen stiegen.
- » Ein Long-Engagement in Gold belastete die Rendite, da das Edelmetall an Wert verlor.

Emerging Local Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 11. Dez. 2007)	(3,61 %)	2,60 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	(3,60 %)	2,38 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2010)	(3,76 %)	0,66 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	(4,06 %)	3,66 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2010)	(4,09 %)	0,41 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	—	(0,10 %)
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	(3,15 %)	5,53 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	(3,38 %)	2,94 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Okt. 2012)	0,84 %	(0,42 %)
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (CHF Unhedged)	1,04 %	0,02 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	(0,53 %)	2,49 %
Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Jun. 2010)	(0,52 %)	1,83 %
Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	(0,74 %)	(3,97 %)
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	(1,02 %)	3,16 %
Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	(1,07 %)	3,46 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	(0,31 %)	2,88 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	(4,62 %)	5,57 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	(4,39 %)	5,90 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Local Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teiffonds legt grundsätzlich mindestens 80 % seiner Vermögenswerte in Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) an, die auf Währungen von Ländern mit Schwellenwertpapiermärkten lauten, die Terminkontrakte oder Derivate wie Optionen, Futures oder Swap-Vereinbarungen enthalten können.

Kommentare zum Fonds

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

- » Übergewichtung in lokaler Duration der Dominikanischen Republik war der Wertentwicklung zuträglich, da die lokalen Zinsen sanken.
- » Untergewichtung in lokaler türkischer Duration war der Wertentwicklung zuträglich, da die lokalen Zinsen stiegen.
- » Ein Engagement bei der Spread-Duration von Schwellenländern beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich die Spreads der Schwellenländer verengten.
- » Übergewichtung in lokaler peruanischer Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die lokalen Zinsen stiegen.
- » Übergewichtung in lokaler chilenischer Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die lokalen Zinsen stiegen.

Emerging Markets Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2001)	(0,68 %)	8,97 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 13. Dez. 2001)	(0,65 %)	8,31 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2002)	(0,84 %)	7,56 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 29. Mai 2003)	(0,94 %)	6,48 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(1,12 %)	5,34 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(1,06 %)	5,47 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 17. Okt. 2002)	(0,77 %)	8,57 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 03. Sep. 2020)	(0,68 %)	2,74 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	(1,17 %)	4,46 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(1,18 %)	4,35 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	(0,26 %)	9,24 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	(1,00 %)	8,07 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012)	(1,32 %)	3,52 %
JPMorgan EMBI Global (AUD Hedged)	(1,11 %)	4,31 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2005)	(1,27 %)	4,37 %
JPMorgan EMBI Global (CHF Hedged)	(1,64 %)	4,50 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2002)	(1,13 %)	7,05 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Dez. 2010)	(1,17 %)	4,20 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	(1,24 %)	2,28 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(1,57 %)	4,12 %
JPMorgan EMBI Global (Euro Hedged)	(1,46 %)	6,86 % ²
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2018)	2,48 %	6,58 %
JPMorgan EMBI Global (EUR Unhedged)	2,14 %	5,89 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	(0,78 %)	6,67 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(0,66 %)	5,75 %
JPMorgan EMBI Global (GBP Hedged)	(1,04 %)	6,86 % ²
Auf PLN lautende Klassen		
Institutional PLN (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2021)	—	0,00 %
JPMorgan EMBI Global (PLN Hedged)	—	—
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2018)	(0,65 %)	6,72 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	(1,12 %)	4,46 %
JPMorgan EMBI Global (SGD Hedged)	(1,00 %)	5,72 % ²

Der Emerging Markets Bond Fund versucht, seine Gesamtrendite in Übereinstimmung mit einer umsichtigen Anlageverwaltung zu maximieren, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten anlegt, die wirtschaftlich an Länder mit aufstrebenden Wertpapiermärkten gebunden sind.

Kommentare zum Fonds

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

- » Übergewichtung in Titeln aus Ecuador trug zur Wertentwicklung bei, da das Land insgesamt den Index übertraf.
- » Das Engagement in brasilianischen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads der betreffenden Titel verengten.
- » Die Auswahl ukrainischer Titel trug zur Wertentwicklung bei, da das Land insgesamt den Index übertraf.
- » Das Engagement in chinesischen quasi-staatlichen Schuldtiteln beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Kurse dieser Titel sanken.
- » Eine Untergewichtung bei der Spread-Duration von Schwellenländern beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich die Spreads der Schwellenländer verengten.

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Emerging Markets Bond ESG Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	(0,50 %)	5,39 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	(0,57 %)	5,22 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 10. Juli 2019)	(0,82 %)	4,70 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	(0,73 %)	4,74 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2021)	—	(0,40 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 05. Feb. 2021)	—	(0,51 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified ³	(1,07 %)	5,81 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Apr. 2021)	—	3,10 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (CHF Hedged) ³	—	2,85 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2013)	(1,01 %)	3,22 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2017)	(0,89 %)	2,24 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2018)	(1,40 %)	4,38 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (EUR Hedged) ³	(1,54 %)	3,73 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2019)	(0,63 %)	3,93 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Hedged) ³	(1,11 %)	2,68 %
Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2020)	(1,44 %)	(3,80 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Unhedged) ³	(2,11 %)	(4,51 %)
Auf NOK lautende Klassen		
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Mrz. 2014)	(0,77 %)	4,23 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (NOK Hedged) ³	(1,12 %)	4,75 %
Auf SEK lautende Klassen		
Investor SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Feb. 2014)	(0,99 %)	3,03 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (SEK Hedged) ³	(1,40 %)	3,84 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Emerging Markets Bond ESG Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 01. August 2019 — JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter; seit 02. August 2019 — JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Bond ESG Fund strebt den maximal möglichen Gesamtertrag, die Gewährleistung des Kapitalerhalts, umsichtige Anlageverwaltung und Nachhaltigkeit an. Um diese Ziele zu erreichen, integriert der Fonds ökologische und soziale Aspekte sowie Corporate Governance (ESG) in den Anlageprozess (s. Erläuterung in der Ergänzung) und investiert mindestens 80 % seines Vermögens in ein aktiv verwaltetes, diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind. Die Beteiligung an solchen Emittenten lässt sich über die direkte Anlage in Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder über den Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten (wie im Fondsnachtrag näher definiert) erreichen. Alle Wertpapiere werden gemäß dem internen verantwortungsbezogenen Auswahlverfahren der Anlageberatungsgesellschaft ausgewählt, das darauf ausgelegt ist, ESG-Faktoren (Umwelt, Soziales und Governance) zu berücksichtigen, und das unter anderem ein ethisches Auswahlverfahren umfasst, das die sozial verantwortliche Anlageberatungsgesellschaft (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Zeit zu Zeit vorgibt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Übergewichtung in Titeln aus Ecuador trug zur Wertentwicklung bei, da das Land insgesamt den Index übertraf.
- » Die Auswahl ukrainischer Titel trug zur Wertentwicklung bei, da das Land insgesamt den Index übertraf.
- » Übergewichtung in Titeln aus Oman trug zur Wertentwicklung bei, da das Land insgesamt den Index übertraf.
- » Das Engagement in chinesischen quasi-staatlichen Schuldtiteln und Unternehmensanleihen beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Kurse dieser Titel sanken.
- » Eine Untergewichtung bei der Spread-Duration von Schwellenländern beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich die Spreads der Schwellenländer verengten.

Emerging Markets Corporate Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Nov. 2009)	1,05 %	5,28 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	0,65 %	3,63 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	1,11 %	6,54 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	0,17 %	1,90 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (CHF Hedged)	0,56 %	4,04 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Feb. 2010)	0,71 %	4,02 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mrz. 2010)	0,22 %	2,96 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (EUR Hedged)	0,69 %	5,23 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Corporate Bond Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den maximal möglichen Gesamtertrag erzielen, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Vermögens in einem aktiv verwalteten breit gefächerten Portfolio aus (im Verkaufsprospekt beschriebenen) Rentenwerten anlegt, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind, einschließlich Rentenwerten, die Emittenten von Industrieschuldverschreibungen begeben haben, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind.

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl bei südafrikanischen Unternehmensanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Papiere eines Minenunternehmens an Wert gewannen.
- » Die Titelauswahl bei chilenischen Unternehmensanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurse der betreffenden Papiere stiegen.
- » Die Titelauswahl bei kolumbischen Unternehmensanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurse der betreffenden Papiere stiegen.
- » Eine Untergewichtung der Spread-Duration von Unternehmensanleihen aus Schwellenländern beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads auf Unternehmensanleihen aus Schwellenländern verengten.
- » Die Titelauswahl bei nigerianischen Unternehmensanleihen beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Anlagen des Fonds in ein Energieunternehmen an Wert verloren.

PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	(0,70 %)	6,49 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged)	(2,18 %)	4,67 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	(0,18 %)	4,71 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index (EUR Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	(0,88 %)	2,36 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er in einen Mix aus festverzinslichen Wertpapieren (diese sind Darlehen ähnlich und zahlen feste oder variable Zinsen) von Unternehmen oder Regierungen, die wirtschaftlich mit Schwellenländern verbunden sind, verbundenen Derivaten auf diese festverzinslichen Wertpapiere sowie Schwellenmarktwährungen investiert.

Kommentare zum Fonds

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

- » Das Engagement bei der externen Spread-Duration von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da sich die externen Spreads der Schwellenländer verengten.
- » Das Engagement bei Spread-Duration von Unternehmensanleihen, die nicht in Schwellenländern emittiert wurden, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads von nicht aus Schwellenländern stammenden Unternehmensanleihen verengten.
- » Das Engagement in lokalen Zinssätzen von Schwellenländern beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die lokalen Zinsen in Schwellenländern stiegen.
- » Das Engagement in Währungen von Schwellenländern wie der türkischen Lira, dem kolumbianischen Peso und der indischen Rupie beeinträchtigte die Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.
- » Das Engagement in US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Renditen auf US-Schatzpapiere stiegen.

Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Sep. 2006)	(0,97 %)	2,45 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	(1,39 %)	1,77 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	(0,60 %)	2,46 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2010)	2,12 %	2,65 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	1,65 %	2,19 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged)	2,55 %	3,10 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in Währungen von Schwellenländern oder Renteninstrumente (wie im Verkaufsprospekt definiert) investiert, die auf solche lauten. Bei der Auswahl von Ländern, die die Gesellschaft als Schwellenmärkte erachtet, verfügt die Anlageberatungsgesellschaft über einen breiten Spielraum. Die Anlageberatungsgesellschaft wählt die Zusammensetzung des Teilfonds nach Ländern und Währungen auf der Grundlage ihrer Bewertung von bestimmten Faktoren aus. Zu diesen Faktoren gehören Zinsprognosen, Inflationsraten, Devisenkurse, Geld- und Fiskalpolitik, Handels- und Leistungsbilanz, aktienmarktspezifische Faktoren und andere spezifische Faktoren, die der Anlageberatungsgesellschaft relevant erscheinen. Der Anlageschwerpunkt des Teilfonds wird wahrscheinlich auf Asien, Afrika, dem Nahen Osten, Lateinamerika und den aufstrebenden Ländern Europas liegen. Der Teilfonds kann in Instrumente investieren, deren Renditen auf den Renditen von Wertpapieren aus den Schwellenmärkten basieren, etwa derivative Instrumente, anstatt direkt in Wertpapiere oder Wertpapiere aus Schwellenmärkten zu investieren. Die durchschnittliche Duration des Portfolios dieses Teilfonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaft. Unter normalen Marktbedingungen wird davon ausgegangen, dass sie nicht länger als zwei Jahre ist. Der Teilfonds kann seine Vermögenswerte insgesamt in hochrentierliche Wertpapiere anlegen, wobei höchstens 15 % der Vermögenswerte in Wertpapiere angelegt werden können, die von Moody's oder S&P niedriger als B bewertet werden bzw. die von Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben (oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind).

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Übergewichtung beim brasilianischen Real trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Währung gegenüber dem U.S.-Dollar aufwertete.
- » Eine Untergewichtung beim peruanischen Sol trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Währung gegenüber dem U.S.-Dollar aufwertete.
- » Eine Übergewichtung bei lokalen Zinssätzen von Schwellenländern beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen in Schwellenländern stiegen.
- » Eine Übergewichtung bei der türkischen Lira im ersten Quartal des Jahres beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da diese Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	—	0,70 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	—	0,61 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	—	0,50 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	—	0,50 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index	(1,60 %)	1,13 %
Auf AUD lautende Klassen		
Class R AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	—	0,68 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (AUD Hedged) Index	(1,72 %)	1,12 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	—	0,50 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	—	0,40 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (CHF Hedged) Index	(2,20 %)	0,98 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	—	0,60 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Mai 2021)	—	0,41 %
E Class EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jun. 2021)	—	0,00 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	—	0,40 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (EUR Hedged) Index	(2,05 %)	1,02 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	—	0,42 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (GBP Hedged) Index	(1,66 %)	1,13 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	—	0,72 %
Bloomberg Barclays US Aggregate (SGD Hedged) Index	(1,58 %)	1,16 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO ESG Income Fund strebt hohe laufende Erträge in Verbindung mit umsichtiger Anlageverwaltung und Nachhaltigkeit an. Um diese Ziele zu erreichen, integriert der Fonds ökologische und soziale Aspekte sowie Corporate Governance (ESG) in den Anlageprozess (s. Erläuterung in der Ergänzung). Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel.

Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 29. April 2021 auf.

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	(2,22 %)	4,42 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Jan. 2003)	(2,25 %)	4,27 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2002)	(2,40 %)	4,19 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2002)	(2,41 %)	4,17 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2001)	(2,45 %)	4,04 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(2,66 %)	3,11 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	(2,66 %)	2,83 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	(2,27 %)	4,16 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2006)	(2,36 %)	3,28 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade (CHF Hedged) Index	(2,40 %)	3,24 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Der Euro Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus auf Euro lautenden Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine steilere Renditekurve in Europa trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen am langen Ende der Kurve sanken.
- » Ein Übergewichtetes Engagement in verbrieften Schuldverschreibungen, insbesondere Residential Mortgage Backed Securities (RMBS), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Wertpapiere stiegen.
- » Die Titelauswahl bei hochwertigen U.S. Agency Mortgage Backed Securities (MBS) trug zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Eine Übergewichtung bei dänischer Duration über gedeckte dänischen Anleihen beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinsstrukturkurve steiler verlief und sich die Spreads weiteten.
- » Ein Short-Engagement bei britischen Breakeven-Titeln beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Inflationserwartungen stiegen.
- » Eine Übergewichtung bei US-Duration, insbesondere im mittleren Bereich der Kurve, beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen anstiegen.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2008)	(0,81 %)	4,10 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	(0,85 %)	3,32 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2010)	(1,23 %)	2,84 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	(0,77 %)	1,54 %
H Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 07. Jun. 2019)	(0,72 %)	1,54 %
Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index	(1,09 %)	3,89 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Credit Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds legt mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein breit gefächertes Portfolio von auf Euro lautenden Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten an. Diese enthalten direkte oder indirekte Beteiligungen an kreditnahen Rentenwerten oder derivativen Instrumenten, wie Optionen, Futures Swaps oder Credit Default Swaps.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung bei europäischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei Banken und im Chemiesektor trug zur Wertentwicklung bei, da diese Sektoren den Gesamtmarkt übertrafen.
- » Ein Long-Engagement beim chinesischen Renminbi trug zur Wertentwicklung bei, da die Währung gegenüber dem Euro an Wert gewann.
- » Eine Untergewichtung in den Sektoren Versorgung und Energie beeinträchtigte die Wertentwicklung, da diese Sektoren den Gesamtmarkt übertrafen.
- » Eine Untergewichtung bei Schwellenländern beeinträchtigte die Wertentwicklung, da Auslandsschulden überdurchschnittliche Renditen brachten.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	0,38 %	4,54 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	0,37 %	4,55 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2019)	0,20 %	1,42 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Mai 2012)	0,18 %	4,33 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	(0,07 %)	3,61 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	(0,08 %)	3,60 %
Class E, ausschüttend Q (Auflegung: 30. Sep. 2019)	(0,04 %)	1,03 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(0,27 %)	1,65 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(0,21 %)	1,66 %
Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index	(0,79 %)	3,00 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Income Bond Fund beabsichtigt, seine laufenden Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Anleihen und anderen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Teilfonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

Kommentare zum Fonds

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

- » Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade-Qualität und Hochzins-Schuldtiteln trug durch Carry, die Titelauswahl und die Verengung von Spreads zur Wertentwicklung bei.
- » Positionen in verbrieften Schuldtiteln einschließlich Agency- und Non-Agency-MBS sowie in besicherten Darlehensverbindlichkeiten trugen zur Wertentwicklung bei, da die Kurse solcher Titel stiegen.
- » Ein Long-Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern trug durch Generierung von Carry zur Wertentwicklung bei.
- » Ein Long-Engagement in US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Renditen anstiegen.
- » Ein Long-Engagement in gedeckten dänischen Anleihen beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Renditen stiegen und sich die Spreads erweiterten.
- » Ein Long-Engagement in verschiedenen Währungen von Schwellenländern beeinträchtigte die Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar abwerteten.

Euro Long Average Duration Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Auflegung von Klassen
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Apr. 2006)	(8,71 %)	7,37 %
Bloomberg Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index ²	(8,72 %)	6,19 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

² Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Long Average Duration Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. März 2011: Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond > 15 Years Index; vom 31. März 2011 bis zum 30. Januar 2012: Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond AAA rated > 15 Years Index; seit dem 31. Januar 2012: Bloomberg Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Long Average Duration Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. Der Teilfonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt. Unter normalen Marktbedingungen leiten sich mindestens zwei Drittel der Duration des Teilfonds von Engagements bei auf Euro lautenden staatlichen und/oder regierungsnahen Rentenwerten ab.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung und die Kurvenposition bei europäischen Staatsanleihen trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die europäischen Renditen am langen Ende stiegen.
- » Eine Übergewichtung in verbrieften Schuldtiteln, insbesondere Residential Mortgage Backed Securities, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Wertpapiere stiegen.
- » Eine Übergewichtung bei dänischer Duration über gedeckte dänischen Anleihen beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die dänische Zinsstrukturkurve steiler verlief und sich die Spreads weiteten.
- » Ein Short-Engagement bei britischen Breakeven-Titeln beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Inflationserwartungen stiegen.
- » Eine Übergewichtung bei US-Duration, insbesondere im mittleren Bereich der Kurve, beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen anstiegen.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Auflegung von Klassen
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2006)	0,00 %	1,19 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(0,37 %)	0,42 %
1 Month Euribor Index	(0,28 %)	0,79 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Short-Term Fund ist bestrebt, bei Kapitalerhaltung und täglicher Liquidität höchstmögliche laufende Erträge zu erzielen. Der Teilfonds verfolgt sein Anlageziel, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Durationen anlegt, obwohl davon auszugehen ist, dass die durchschnittliche Portfolioduration anderthalb Jahre nicht überschreitet.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein moderates Long-Engagement bei hochwertigen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich insbesondere im Finanzsektor die Spreads weiteten.
- » Ein Long Engagement bei verbrieften Schuldverschreibungen, insbesondere Positionen in europäischen Residential Mortgage Backed Securities (RMBS), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Wertpapiere stiegen.
- » Ein Engagement in negativen europäischen Barzinsen belastete die Wertentwicklung.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgeschlossenen Berichtszeitraum¹

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Auflegung von Klassen
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	2,68 %	5,18 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	2,85 %	5,66 %
ICE BofAML BB-B European Currency High Yield Constrained Index	2,55 %	3,35 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO European High Yield Bond Fund strebt maximale Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung an. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hochverzinslichen Rentenpapieren, die von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Moody's oder Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind. Unter normalen Marktbedingungen kann der Fonds bis zu 20 % seines Vermögens in hochverzinsliche Rentenpapiere investieren, die von S&P niedriger als CCC bewertet werden oder von Moody's oder Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind.

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl im Energiebereich trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Energiesektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Bereich Transport trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Transportsektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl bei nicht-zyklischen Konsumgütern trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds in diesem Sektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Baustoffbereich war der Wertentwicklung abträglich, da die Positionen des Fonds in diesem Sektor schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Glücksspiel- und Hotelsektor war der Wertentwicklung abträglich, da die Positionen des Fonds schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Telekommunikationssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Auflegung von Klassen
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2011)	(0,61 %)	1,38 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mrz. 2013)	(0,90 %)	(0,12 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	(0,70 %)	(0,14 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) ³	(0,28 %)	1,16 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 29. September 2012 — PIMCO European Advantage Government 1-3 Year Bond Index; 30 September 2012 bis 16. Januar 2020 — Bloomberg Barclays Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index; ab 17. Januar 2020 — Euro Short-Term Rate (ESTER). Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem 30. Juni 2011 berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO European Short-Term Opportunities Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein breit gefächertes Portfolio von auf paneuropäische Währungen (d.h. die verschiedenen Währungen Europas) lautenden Renteninstrumenten mit unterschiedlichen Laufzeiten. Die durchschnittliche Portfolioduration des Teilfonds bewegt sich normalerweise zwischen 0 und 5 Jahren, je nach der Prognose der Anlageverwaltungsgesellschaften für den Zinssatz.

Kommentare zum Fonds

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

- » Positionen in wichtigen europäischen Zinssätzen trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinsstrukturkurve steiler verlief.
- » Ein moderates Long-Engagement bei hochwertigen Unternehmensanleihen, insbesondere aus dem Finanzsektor, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long Engagement bei verbrieften Schuldverschreibungen, insbesondere U.S. Agency Mortgage Backed Securities (RMBS), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Wertpapiere stiegen.
- » Ein Long-Engagement in dänischer Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Renditen anstiegen.
- » Ein Long-Engagement bei dänischen Hypotheken belastete die Wertentwicklung, da die Kurse dieser Wertpapiere sanken.
- » Ein Short-Engagement in britischen Treasury Inflation-Protected Securities beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Inflationserwartungen stiegen

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 09. Jun. 2009)	(2,19 %)	3,71 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	(2,17 %)	3,19 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Aug. 2011)	0,30 %	2,60 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (CHF, Partially Hedged) (London Close)	(0,28 %)	2,07 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Mai 2010)	(0,14 %)	3,16 %
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mai 2010)	(0,48 %)	2,14 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (EUR, Partially Hedged) (London Close)	(0,46 %)	2,73 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jul. 2012)	(0,89 %)	3,26 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (GBP, Partially Hedged) (London Close)	(1,14 %)	2,81 %
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2012)	(0,52 %)	4,55 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (NOK, Partially Hedged) (London Close)	(0,75 %)	4,09 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Advantage Fund versucht, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung höchstmögliche langfristigen Erträge zu erzielen, indem er 80 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die wirtschaftlich mit mindestens drei Ländern verbunden sind (darunter dürfen sich die USA befinden).

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Übergewichtung bei verbrieften Anlagen, insbesondere hochwertigen Non-Agency Residential Mortgage-Backed Securities ("RMBS"), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Preise dieser Wertpapiere stiegen.
- » Eine Übergewichtung im Finanzsektor trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads stark weiteten.
- » Eine Übergewichtung in Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Eine moderate Übergewichtung bei nationalen Zinssätzen in Brasilien und Peru beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.
- » Eine Übergewichtung in australischer und kanadischer Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen auf breiter Ebene stiegen.
- » Die Positionierung bei Währungen von Industrie- und Schwellenländern gegenüber dem US-Dollar.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 1998)	(1,27 %)	5,63 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2001)	(1,28 %)	5,37 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 1999)	(1,43 %)	5,13 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	(1,45 %)	5,01 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Jun. 2004)	(1,52 %)	4,82 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(1,70 %)	4,40 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(1,72 %)	4,32 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	(1,34 %)	5,10 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	(1,30 %)	3,01 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	(1,66 %)	3,50 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(1,85 %)	3,05 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(1,81 %)	3,06 %
Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(1,27 %)	1,20 %
Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(1,22 %)	1,14 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index ³	(1,52 %)	4,81 % ²
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2002)	(2,95 %)	5,06 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 23. März 2006)	(2,98 %)	4,85 %
Investor (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 31. März 2005)	(3,15 %)	4,01 %
Class E (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2010)	(3,39 %)	3,24 %
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2010)	(3,41 %)	3,23 %
H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	—	(0,60 %)
Class W (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(2,86 %)	1,80 %
Class W (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(2,91 %)	1,74 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index ³	(3,21 %)	4,12 % ²
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	(1,29 %)	5,00 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (CAD Hedged) Index ³	(1,53 %)	4,56 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2003)	(1,77 %)	3,32 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	(1,76 %)	3,36 %
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Jun. 2011)	(1,89 %)	3,06 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2018)	(2,23 %)	1,74 %
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(1,76 %)	0,20 %
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(1,70 %)	0,23 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (CHF Hedged) Index ³	(2,07 %)	2,42 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2003)	(1,68 %)	4,33 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Apr. 2005)	(1,62 %)	4,28 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Feb. 2005)	(1,85 %)	3,90 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(2,08 %)	3,54 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(2,09 %)	1,58 %
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2012)	(2,06 %)	1,80 %
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,84 %)	2,42 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(2,23 %)	1,38 %
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(1,57 %)	0,40 %
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(1,61 %)	0,43 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (EUR Hedged) Index ³	(1,93 %)	3,36 % ²

Der Global Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf führende Weltwährungen lauten.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Übergewichtung bei verbrieften Schuldverschreibungen, insbesondere hochwertigen Non-Agency Residential Mortgage-Backed Securities (RMBS), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Wertpapiere stiegen.
- » Eine Übergewichtung im Finanzsektor trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads stark weiteten.
- » Eine steilere europäische Zinsstrukturkurve trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen am langen Ende der Kurve sanken.
- » Eine Übergewichtung in australischer und kanadischer Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen auf breiter Ebene stiegen.
- » Eine moderate Übergewichtung bei nationalen Zinssätzen in Brasilien und Peru beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.
- » Eine Untergewichtung bei Investment Grade-Unternehmensanleihen außerhalb des Finanzsektors beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads in den meisten Sektoren verengten.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹ (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	0,07 %	4,14 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (EUR Unhedged) Index ³	(0,13 %)	3,52 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2003)	(1,34 %)	5,29 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2004)	(1,33 %)	5,37 %
Investor GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Apr. 2005)	(1,50 %)	4,74 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(1,27 %)	1,00 %
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(1,23 %)	1,03 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Hedged) Index ³	(1,57 %)	4,40 % ²
Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 09. Mrz. 2018)	(4,00 %)	3,71 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Unhedged) Index ³	(4,22 %)	3,31 %
Auf HKD lautende Klassen		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	(1,58 %)	3,43 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (HKD Unhedged) Index ³	(3,06 %)	3,72 %
Auf ILS lautende Klassen		
Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2010)	(1,52 %)	4,79 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (ILS Hedged) Index ³	(1,77 %)	3,50 %
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	(1,32 %)	5,45 %
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Jul. 2006)	(1,49 %)	5,55 %
Class E NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Apr. 2021)	—	0,29 %
Class W NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Apr. 2021)	—	0,51 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (NOK Hedged) Index ³	(1,52 %)	4,45 % ²
Auf NZD lautende Klassen		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Nov. 2004)	(1,28 %)	7,47 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (NZD Hedged) Index ³	(1,50 %)	6,45 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Nov. 2004)	(1,48 %)	4,56 %
M Retail SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2021)	—	0,46 %
Class R SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	(1,62 %)	3,35 %
Class W SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(1,44 %)	0,73 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (SEK Hedged) Index ³	(1,74 %)	3,51 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Aug. 2009)	(1,22 %)	5,73 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (SGD Hedged) Index ³	(1,48 %)	3,98 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Fund repräsentiert Folgendes: Seit Auflegung bis 30. November 2000 — JPMorgan GBI Global Index Hedged in USD; ab 01. Dezember 2000 — Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(1,23 %)	4,21 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 03. Apr. 2020)	(1,22 %)	5,23 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2018)	(1,45 %)	5,50 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2019)	(1,59 %)	4,85 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019)	(1,50 %)	4,89 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	(1,69 %)	4,43 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index	(1,52 %)	3,74 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(1,12 %)	4,45 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (AUD Hedged)	(1,61 %)	3,50 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(1,74 %)	1,63 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (CHF Hedged) Index	(2,07 %)	1,18 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(1,62 %)	2,03 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(1,64 %)	2,03 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2017)	(2,14 %)	1,18 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (EUR Hedged) Index	(1,93 %)	1,61 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jun. 2020)	(1,34 %)	3,16 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(1,29 %)	2,98 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Hedged) Index	(1,57 %)	2,59 % ²
Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2020)	(2,29 %)	(5,22 %)
Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Unhedged) Index	(4,22 %)	(6,80 %)
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(1,37 %)	3,30 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (NOK Hedged) Index	(1,52 %)	2,95 %
Auf NZD lautende Klassen		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Apr. 2017)	(1,29 %)	4,06 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (NZD Hedged) Index	(1,50 %)	3,78 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Mai 2021)	—	0,59 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (SEK Hedged) Index	(1,74 %)	0,86 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond ESG Fund strebt größtmögliche Gesamtrendite in Verbindung mit Schutz des Kapitals, umsichtiger Anlageverwaltung und Nachhaltigkeit an. Um diese Ziele zu erreichen, integriert der Fonds ökologische und soziale Aspekte sowie Corporate Governance in den Anlageprozess (s. Erläuterung in der Ergänzung). Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf führende Weltwährungen lauten.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Übergewichtung bei verbrieften Schuldverschreibungen, insbesondere hochwertigen Non-Agency Residential Mortgage-Backed Securities (RMBS), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Wertpapiere stiegen.
- » Eine Übergewichtung im Finanzsektor trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads stark weiteten.
- » Eine steilere europäische Zinsstrukturkurve trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen am langen Ende der Kurve sanken.
- » Eine Übergewichtung in australischer und kanadischer Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen auf breiter Ebene stiegen.
- » Eine moderate Übergewichtung bei nationalen Zinssätzen in Brasilien und Peru beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.
- » Eine Übergewichtung bei dänischer Duration in Form dänischer Hypotheken beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen sanken.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2003)	(0,99 %)	5,13 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 09. Nov. 2005)	(1,01 %)	5,32 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2006)	(1,21 %)	4,92 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Sep. 2004)	(1,25 %)	4,84 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	(1,46 %)	4,61 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	(1,14 %)	4,66 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Okt. 2019)	(0,75 %)	3,38 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index ³	(1,56 %)	4,09 % ²
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 04. Okt. 2016)	(4,33 %)	1,62 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Unhedged) Index ³	(4,42 %)	1,75 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2006)	(1,40 %)	4,66 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (EUR Hedged) Index ³	(1,94 %)	3,37 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Feb. 2019)	(1,10 %)	3,35 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (GBP Hedged) Index ³	(1,59 %)	2,71 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Ex-US Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis 19. Januar 2016 — FTSE World Government Bond Ex-U.S. Index (USD Hedged); seit 20. Januar 2016 — Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond Ex-US Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens 70 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten anlegt, die ihren eingetragenen Geschäftssitz oder ihre überwiegende Geschäftstätigkeit außerhalb der USA haben und mindestens drei Länder außerhalb der USA repräsentieren.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Übergewichtung bei verbrieften Schuldverschreibungen, insbesondere hochwertigen Non-Agency Residential Mortgage-Backed Securities (RMBS), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Eine Übergewichtung bei Unternehmensanleihen aus dem Finanzsektor trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Eine steiler werdende Zinsstrukturkurve in den USA trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen am langen Ende der Kurve stärker stiegen als am kurzen.
- » Eine Übergewichtung in australischer und kanadischer Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen auf breiter Ebene stiegen.
- » Eine moderate Übergewichtung bei nationalen Zinssätzen in Brasilien und Peru beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.
- » Eine Untergewichtung bei Investment Grade-Unternehmensanleihen außerhalb des Finanzsektors beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da sich die Credit Spreads in den meisten Sektoren verengten.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	6,95 %	7,03 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	6,75 %	5,10 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2009)	6,32 %	5,50 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Jan. 2011)	6,25 %	3,99 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 06. Jul. 2016)	7,46 %	11,04 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged	6,61 %	9,37 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	7,31 %	6,08 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2009)	6,65 %	4,55 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	6,69 %	2,93 %
60 % MSCI All Country World Index EUR Hedged /40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate EUR Hedged	6,80 %	8,20 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2010)	7,48 %	5,14 %
60 % MSCI All Country World Index GBP Hedged /40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate GBP Hedged	7,17 %	7,40 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Global Core Asset Allocation Fund strebt bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung die maximal mögliche Gesamtrendite an, indem er sich an einem breiten Spektrum von Vermögensklassen beteiligt, einschließlich Aktien, Rentenwerte, Rohstoffe und Immobilien (wie im Fondsnachtrag beschrieben). Der Teilfonds kann (gemäß dem Verkaufsprospekt) auch in andere PIMCO-Fonds und andere Organismen für gemeinsame Anlagen anlegen.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein übergewichtetes Engagement in US-Aktien trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Titel generell anstiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in verbrieften Rentenwerten, insbesondere Non-Agency-MBS, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurse solcher Titel generell anstiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in japanischen Aktien trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Titel generell anstiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in US-Duration, insbesondere im Bauch der US-Zinskurve, beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da der Bauch der US-Zinskurve zunahm.
- » Relative-Value-Real Estate Investment Trusts (REITs)-Strategien beeinträchtigten die relative Wertentwicklung, da Long-Engagements in bestimmten Single-Name-Titeln höhere Erträge brachten als Short Engagements über den gesamten Index.
- » Ein übergewichtetes Engagement in anderen Währungen von Industrieländern als dem US-Dollar, insbesondere japanischer Yen, schwedische Krone und Euro, beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar abwerteten.

Global High Yield Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	2,29 %	6,78 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	2,30 %	6,82 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	2,20 %	6,16 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	2,06 %	6,52 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2015)	2,06 %	6,56 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	1,87 %	5,81 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	1,85 %	5,88 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	2,23 %	7,03 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2013)	2,25 %	5,28 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	1,86 %	5,53 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	1,88 %	4,52 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,14 %	5,44 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	1,67 %	4,45 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	1,67 %	4,45 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD ³	2,94 %	7,13 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Feb. 2010)	1,80 %	5,36 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	1,75 %	4,08 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into CHF ³	2,43 %	5,76 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2008)	1,91 %	5,68 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	1,90 %	5,77 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2011)	1,76 %	4,64 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Aug. 2010)	1,71 %	4,85 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,44 %	4,74 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2016)	1,40 %	3,29 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2016)	1,18 %	2,30 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into EUR ³	2,55 %	5,92 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	2,24 %	5,59 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	2,20 %	6,44 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2010)	1,97 %	5,53 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009)	1,82 %	6,71 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into GBP ³	2,88 %	6,63 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2016)	1,88 %	5,16 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into SGD ³	3,00 %	6,63 %

Der Global High Yield Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hoch verzinslichen Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf wichtige Währungen lauten, die von Moody's mit niedriger als Baa oder von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Fitch ein gleichwertiges Rating erhalten haben.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement im Versorgungssektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Die Titelauswahl im Luft-/Raumfahrt- und Bergbausektor trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Bereich Luft-/Raumfahrt und Verteidigung besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Gesundheitssektor trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Sektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Gesundheitssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Energiesektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.
- » Die Titelauswahl im Finanz- und Versicherungssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die entsprechenden Positionen des Fonds schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global High Yield Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 31. März 2014: ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield, BB-B Rated, Constrained Index; seit dem 01. April 2014: ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	(0,63 %)	5,90 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jul. 2003)	(0,64 %)	5,67 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2005)	(0,82 %)	5,13 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(0,83 %)	6,35 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	(0,86 %)	6,19 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	(0,90 %)	6,19 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2008)	(1,10 %)	5,98 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	(1,06 %)	4,89 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	(0,73 %)	5,93 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	(0,74 %)	5,61 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	(1,07 %)	3,61 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(1,02 %)	4,15 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,77 %)	4,13 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,77 %)	4,14 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(1,27 %)	3,36 %
Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(0,68 %)	2,50 %
Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(0,57 %)	2,58 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (USD Hedged)	(1,04 %)	4,78 % ²
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2013)	(1,51 %)	3,98 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 06. Sep. 2016)	(1,48 %)	4,01 %
H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	—	0,80 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (USD Unhedged)	(1,93 %)	3,65 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2020)	(0,73 %)	9,40 %
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	(0,94 %)	4,86 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (AUD Hedged)	(1,14 %)	5,66 % ²
Auf CAD lautende Klassen		
Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	(0,86 %)	5,08 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (CAD Hedged)	(1,05 %)	5,80 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2009)	(1,14 %)	3,98 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Feb. 2015)	(1,07 %)	2,15 %
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mai 2011)	(1,32 %)	2,94 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(1,36 %)	4,81 %
Administrative CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2013)	(1,42 %)	2,03 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mrz. 2012)	(1,60 %)	2,25 %
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(1,17 %)	1,50 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (CHF Hedged)	(1,63 %)	4,15 % ²
Auf CNH lautende Klassen		
Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	0,32 %	7,02 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (CNH Hedged)	0,22 %	7,88 %
Auf CZK lautende Klassen		
Institutional CZK (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2015)	(0,75 %)	3,11 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (CZK Hedged)	(1,10 %)	3,06 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Investment Grade Credit Fund strebt maximal mögliche Gesamtrendite unter Berücksichtigung der Faktoren Kapitalerhalt, umsichtige Anlageverwaltung und nachhaltige Anlagestrategie an. Er integriert hierzu explizit ESG-Faktoren (Umwelt, Soziales und Governance) in den Anlageprozess (s. Erläuterungen im Fondsnachtrag). Der Teilfonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Unternehmensanleihen mit Investment Grade (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl im Bankensektor, insbesondere bei nachrangigen Schuldtiteln von Banken, die sich überdurchschnittlich entwickelten, trug zur Wertentwicklung bei.
- » Die Titelauswahl im Verkehrssektor trug zur Wertentwicklung bei, da Fluglinien sich überdurchschnittlich entwickelten.
- » Eine Übergewichtung in Auslandsschulden von Schwellenländern, die sich im bisherigen Jahresverlauf besser entwickelten als der Gesamtmarkt, trug zur Wertentwicklung bei.
- » Das Engagement bei auf Lokalwährungen lautenden Schuldtiteln beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der Sektor negative Überschussrenditen erzielte.
- » Eine Untergewichtung in regierungsnahen Anleihen, insbesondere in Schuldtiteln regionaler staatlicher Stellen, die sich besser entwickelten als der Gesamtkreditmarkt, beeinträchtigte die Wertentwicklung.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2003)	(1,01 %)	4,82 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2008)	(0,99 %)	5,28 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2006)	(1,16 %)	4,51 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(1,21 %)	5,37 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	(1,28 %)	5,09 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	(1,29 %)	5,09 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(1,48 %)	3,87 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Sep. 2010)	(1,53 %)	3,07 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,19 %)	2,66 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(1,68 %)	1,63 %
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(1,07 %)	1,70 %
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(0,95 %)	1,77 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (EUR Hedged)	(1,47 %)	3,92 % ²
Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2012)	1,64 %	4,09 %
Class E EUR (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	1,10 %	4,55 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (EUR Unhedged)	1,19 %	4,03 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Sep. 2005)	(0,70 %)	5,28 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Jul. 2008)	(0,70 %)	5,78 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(0,86 %)	5,93 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jan. 2009)	(0,95 %)	5,74 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mrz. 2009)	(1,13 %)	5,46 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,80 %)	3,46 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(0,68 %)	2,30 %
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(0,67 %)	2,38 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (GBP Hedged)	(1,09 %)	4,53 % ²
Auf HKD lautende Klassen		
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	(0,78 %)	3,96 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	(0,88 %)	3,56 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (HKD Unhedged) Credit Index	(1,78 %)	4,17 %
Auf HUF lautende Klassen		
Institutional HUF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2015)	(0,54 %)	3,14 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (HUF Hedged)	(0,90 %)	3,02 %
Auf ILS lautende Klassen		
Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2010)	(0,92 %)	4,96 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (ILS Hedged)	(1,31 %)	4,49 %
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jan. 2012)	(0,68 %)	5,17 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (NOK Hedged)	(1,03 %)	4,76 %
Auf PLN lautende Klassen		
Institutional PLN (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Jun. 2015)	(0,79 %)	4,74 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (PLN Hedged)	(1,23 %)	4,69 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Dez. 2009)	(0,85 %)	4,94 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2012)	(1,11 %)	2,59 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (SEK Hedged)	(1,29 %)	4,31 % ²

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(0,62 %)	4,89 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	(0,85 %)	5,02 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Sept. 2017)	(0,90 %)	3,51 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jul. 2012)	(1,07 %)	3,58 %
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 13. Okt. 2020)	(0,56 %)	1,99 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (SGD Hedged)	(1,01 %)	4,23 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Global Investment Grade Credit ESG Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	(0,97 %)	7,52 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 19. Jul. 2019)	(0,95 %)	5,64 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mai 2021)	—	1,10 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,43 %)	2,38 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,38 %)	2,47 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Jun. 2019)	(0,79 %)	6,40 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (USD Hedged)	(1,04 %)	6,75 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	(1,56 %)	4,84 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,54 %)	1,71 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,94 %)	0,82 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,89 %)	0,81 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (CHF Hedged)	(1,63 %)	4,19 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	(1,37 %)	5,24 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,34 %)	2,01 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,84 %)	1,05 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,79 %)	1,04 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (EUR Hedged)	(1,47 %)	4,59 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	(1,01 %)	6,13 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 1. Mai 2019)	(1,03 %)	5,57 %
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,54 %)	1,57 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(1,49 %)	1,58 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (GBP Hedged)	(1,09 %)	5,55 % ²
Auf SEK lautende Klassen		
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Nov. 2019)	(1,45 %)	3,15 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (SEK Hedged)	(1,29 %)	3,13 %

Der Global Investment Grade Credit ESG Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Unternehmensanleihen mit Investment Grade (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich nachrangige Schuldtitel von Banken überdurchschnittlich entwickelten.
- » Ein übergewichtetes Engagement in Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da Auslandsschulden überdurchschnittliche Renditen brachten.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Bereich Elektrizitätsversorgung trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor besser abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Ein übergewichtetes Engagement in 10-jähriger und 30-jähriger US-Duration beeinträchtigte insbesondere im ersten Quartal die Wertentwicklung, da im bisherigen Jahresverlauf die Zinsen am langen Ende stiegen.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Energiesektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	0,59 %	3,29 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019)	0,56 %	3,45 %
1 Month USD LIBOR Index	0,06 %	1,20 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	0,09 %	1,24 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Apr. 2018)	0,15 %	1,14 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2018)	(0,10 %)	0,55 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017)	(0,20 %)	(0,03 %)
1 Month Euribor Index	(0,28 %)	(0,41 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	0,36 %	2,18 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	0,46 %	2,53 %
1 Month GBP LIBOR Index	0,02 %	0,42 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Libor Plus Bond Fund beabsichtigt, einen höchstmöglichen langfristigen Gesamtertrag bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) unterschiedlicher Fälligkeiten anlegt. Der Teilfonds strebt Renditen an, die mittel- bis langfristig den 1-Monats-USD-LIBOR (ein Maß der Rendite von Geldmarktpapieren) übersteigen. Hierfür investiert er auf Basis der Beurteilung globaler Rentenwerte durch die Anlageberatungsgesellschaft flexibel in eine Vielzahl festverzinslicher Instrumente.

Kommentare zum Fonds

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

- » Positionen in Unternehmensanleihen mit Investment Grade sowie hochverzinslichen Schuldtiteln trugen durch Carry, die Titelauswahl und die Verengung von Spreads in diesen Sektoren zur Wertentwicklung bei.
- » Positionen in verbrieften Schuldverschreibungen, insbesondere Non-Agency-MBS, trugen zur Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Wertpapiere stiegen.
- » Short-Engagement in britischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Long-Engagement in US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Zinsen in den Vereinigten Staaten stiegen.
- » Long-Engagement in Duration lokaler Währungen bestimmter Schwellenländer beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Zinsen in den betreffenden Ländern stiegen.
- » Long-Engagement in italienischer Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Zinsen in Italien stiegen.

Global Low Duration Real Return Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	2,18 %	2,17 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 05. Okt. 2016)	1,97 %	2,79 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	1,76 %	1,25 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	2,60 %	2,09 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	1,71 %	0,14 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (CHF Hedged)	2,06 %	0,01 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	1,76 %	0,57 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jan. 2017)	1,84 %	0,97 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	1,35 %	(0,33 %)
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (EUR Hedged)	2,18 %	0,51 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	2,06 %	1,92 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	1,98 %	1,40 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (GBP Hedged)	2,50 %	1,37 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Low Duration Real Return Fund versucht, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung eine höchstmögliche reale Rendite zu erzielen, indem er mindestens 70 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus inflationsgekoppelten Rentenpapieren unterschiedlicher Laufzeiten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, welche von Regierungen, ihren Vertretungen oder Behörden und Unternehmen ausgegeben wurden. Inflationsindexierte Anleihen sind festverzinsliche Wertpapiere, die so strukturiert sind, dass sie Schutz vor Inflation bieten.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement bei nomineller US-Duration steigerte die relative Rendite, da die US-Nominalrenditen anstiegen.
- » Eine Untergewichtung deutscher Nominalzinsen für Staatsanleihen steigerte die relative Rendite, da die deutschen Nominalrenditen anstiegen.
- » Eine Übergewichtung der Realzinsen für italienische Staatsanleihen steigerte die relative Rendite, da die italienischen Realrenditen sanken.
- » Eine Übergewichtung bei verbrieften Schuldtiteln, insbesondere gedeckten dänischen Anleihen, beeinträchtigte die relative Rendite, da sich diese Papiere schlechter entwickelten als der Gesamtmarkt.
- » Ein untergewichtetes Engagement bei britischen Breakeven-Inflationsspreads beeinträchtigte die relative Rendite, da die Breakeven-Inflationsrate in Großbritannien stieg.
- » Eine Übergewichtung in Realzinsen für US-Staatsanleihen reduzierte die relative Rendite, da die Realrenditen in den USA anstiegen.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	0,08 %	5,19 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	0,06 %	4,94 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mrz. 2004)	(0,09 %)	4,67 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	(0,04 %)	5,62 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2004)	(0,13 %)	4,45 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(0,37 %)	4,19 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(0,35 %)	4,05 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2004)	0,00 %	5,03 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,00 %	3,59 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	0,17 %	4,98 % ²
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 01. Sep. 2017)	(0,50 %)	4,81 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Unhedged Index	(0,42 %)	4,62 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2008)	(0,39 %)	3,38 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(0,50 %)	3,03 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	(0,61 %)	4,04 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond CHF Hedged Index	(0,40 %)	3,09 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	(0,28 %)	4,31 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(0,32 %)	3,97 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2004)	(0,45 %)	3,86 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(0,70 %)	3,26 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond EUR Hedged Index	(0,24 %)	4,06 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	0,07 %	5,28 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Apr. 2005)	0,03 %	4,86 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009)	(0,43 %)	4,32 %
Class R GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,16 %)	2,96 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond GBP Hedged Index	0,12 %	5,11 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Feb. 2008)	0,11 %	4,51 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond SGD Hedged Index	0,20 %	4,40 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Real Return Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Realrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus inflationsgekoppelten Rentenpapieren unterschiedlicher Laufzeiten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, welche von Regierungen, ihren Vertretungen oder Behörden und Unternehmen ausgegeben wurden.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement bei nomineller US-Duration steigerte die relative Rendite, da die US-Nominalrenditen anstiegen.
- » Eine Übergewichtung der Realzinsen für französische Staatsanleihen steigerte die relative Rendite, da die französischen Realrenditen sanken.
- » Eine Übergewichtung der Realzinsen für italienische Staatsanleihen steigerte die relative Rendite, da die italienischen Realrenditen sanken.
- » Eine Übergewichtung bei verbrieften Schuldtiteln, insbesondere gedeckten dänischen Anleihen, beeinträchtigte die relative Rendite, da sich diese Papiere schlechter entwickelten als der Gesamtmarkt.
- » Eine Übergewichtung in Realzinsen für US-Staatsanleihen reduzierte die relative Rendite, da die Realrenditen in den USA anstiegen.
- » Ein untergewichtetes Engagement bei britischen Breakeven-Inflationsspreads beeinträchtigte die relative Rendite, da die Breakeven-Inflationsrate in Großbritannien stieg.

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,98 %	6,36 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,00 %	6,38 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2015)	1,76 %	5,21 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2013)	1,80 %	5,03 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 13. Feb. 2017)	1,73 %	4,88 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,75 %	5,84 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,48 %	5,42 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,45 %	5,41 %
Class E, ausschüttend Q (Auflegung: 30. Sep. 2019)	1,51 %	5,28 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2018)	1,79 %	5,80 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	1,92 %	5,81 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	1,76 %	5,90 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2015)	1,91 %	5,12 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	1,33 %	3,98 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	1,23 %	3,98 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,24 %	6,94 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index	(1,60 %)	2,86 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jan. 2018)	1,85 %	4,27 %
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	1,58 %	4,72 %
Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	1,53 %	4,93 %
Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Feb. 2017)	1,32 %	3,93 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Okt. 2015)	2,06 %	6,16 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	(1,72 %)	3,53 % ²
Auf BRL lautende Klassen		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Feb. 2016)	6,23 %	6,15 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (BRL Hedged) Index	(0,69 %)	8,65 %
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Apr. 2016)	1,85 %	5,46 %
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2018)	1,82 %	5,95 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index (CAD Hedged)	(1,62 %)	2,87 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Dez. 2014)	1,40 %	3,23 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	1,39 %	3,15 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,93 %	2,48 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	1,05 %	2,49 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(2,20 %)	1,28 % ²
Auf CNH lautende Klassen		
Investor RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2018)	3,00 %	6,03 %
Class E RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mai 2013)	2,72 %	6,49 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (CNH Hedged) Index	(0,35 %)	5,57 % ²

Der Income Fund ist bestrebt, unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung hohe laufende Erträge zu erzielen, wobei das sekundäre Ziel der langfristige Kapitalzuwachs ist. Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Teilfonds strebt hohe Dividenderträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

Kommentare zum Fonds

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

- » Positionen in hochverzinslichen Unternehmensanleihen trugen zur Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere positive Renditen erzielten.
- » Positionen in Non-Agency-MBS trugen zur Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Titel stiegen.
- » Positionen bei US-Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads dieser Papiere verengten.
- » Ein Engagement in ausgewählten Aktien wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere positive Renditen verbuchten.
- » Ein Engagement in US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die US-Zinsstrukturkurve steiler verlief und die US-Zinsen im Kurvenbereich zwischen 2 und 20 Jahren anstiegen.
- » Engagements in Schuldtiteln in Landeswährung ausgewählter Schwellenmarktländer einschließlich Mexiko und Peru beeinträchtigten die Wertentwicklung, da diese Papiere negative Renditen auswiesen.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,55 %	4,87 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,53 %	4,85 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	1,55 %	3,50 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2015)	1,35 %	2,97 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2015)	1,32 %	3,07 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend A (Auflegung: 16. Dez. 2015)	1,45 %	3,48 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Aug. 2015)	1,27 %	3,08 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	1,27 %	3,04 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,09 %	3,93 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,03 %	3,93 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 31. Aug. 2018)	1,07 %	3,25 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II Q (Auflegung: 30. Sep. 2019)	1,09 %	3,50 %
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Aug. 2017)	1,06 %	1,63 %
H Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jun. 2017)	1,47 %	2,51 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	1,41 %	3,65 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,87 %	2,17 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,94 %	2,18 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	(2,05 %)	1,48 % ²
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
G Retail EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2019)	4,71 %	2,92 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (EUR Unhedged) Index	1,52 %	2,87 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2019)	1,90 %	5,01 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	1,87 %	4,71 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	1,68 %	4,04 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Sept. 2016)	1,56 %	3,62 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	1,38 %	2,95 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,74 %	5,33 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	(1,66 %)	2,32 % ²
Auf HKD lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	2,11 %	5,73 %
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Apr. 2017)	1,88 %	4,64 %
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Feb. 2013)	1,61 %	4,57 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	(1,45 %)	3,04 % ²
Auf JPY lautende Klassen		
Institutional JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sep. 2017)	1,83 %	2,84 %
Class E JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sept. 2017)	1,32 %	1,91 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index	(1,86 %)	1,73 %
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2017)	1,89 %	3,95 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index	(1,61 %)	2,95 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Jul. 2020)	1,96 %	9,40 %
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2015)	1,94 %	5,66 %
Investor SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2020)	1,72 %	4,62 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	1,76 %	5,13 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,77 %	5,69 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Feb. 2013)	1,53 %	4,40 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	(1,58 %)	2,81 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Income Fund II

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	—	1,40 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	—	1,41 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	—	1,03 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index	(1,60 %)	(0,89 %)
Auf AUD lautende Klassen		
Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	—	0,94 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	(1,72 %)	(0,97 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)	—	0,73 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	(2,05 %)	(0,46 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)	—	0,93 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	(1,66 %)	(0,17 %)
Auf HKD lautende Klassen		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	—	1,13 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	(1,45 %)	(0,74 %)
Auf SGD lautende Klassen		
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	—	1,03 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	(1,58 %)	(0,86 %)

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Income Fund II ist bestrebt, unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung hohe laufende Erträge zu erzielen, wobei das sekundäre Ziel der langfristige Kapitalzuwachs ist. Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Teilfonds strebt hohe Dividenden erträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 29. Januar 2021 auf.

Kommentare zum Fonds

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

- » Positionen in hochverzinslichen Unternehmensanleihen trugen zur Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere positive Renditen erzielten.
- » Ein Engagement in verschiedenen Schwellenmarktwährungen einschließlich des russischen Rubel und des brasilianischen Real trug zur Wertentwicklung bei, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar aufwerteten.
- » Ein Engagement in Non-Agency-MBS trug zur Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Titel stiegen.
- » Positionen bei US-Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads dieser Papiere verengten.
- » Ein Engagement in Schultiteln in Landeswährung ausgewählter Schwellenmarktländer einschließlich Brasilien und Peru beeinträchtigte die Wertentwicklung, da diese Papiere negative Renditen auswiesen.
- » Ein Engagement in US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die US-Zinsstrukturkurve steiler verlief und die US-Zinsen im Kurvenbereich zwischen 5 und 20 Jahren anstiegen.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	9,38 %	1,73 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	8,76 %	0,50 %
45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1- 30 Year Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return ²	9,77 %	1,58 %
Auf EUR lautende Klassen		
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	9,34 %	(0,35 %)
Class E EUR (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	9,24 %	(0,35 %)
45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1- 30 Year Index (EUR Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (EUR Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (EUR Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return ²	10,29 %	0,80 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Mai 2014)	8,99 %	2,17 %
45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1- 30 Year Index (GBP Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (GBP Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (GBP Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return ²	9,38 %	1,90 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

² Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Inflation Strategy Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis 31. März 2017: 45 % Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Partial Hedged), 30 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD), 15 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % Bloomberg Gold Total Return Index; seit dem 01 April 2017: 45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Inflation Strategy Fund beabsichtigt, den realen Kapitalwert mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu erhalten. Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und legt primär in ein diversifiziertes Portfolio an, das aus inflationsgekoppelten Anlagen besteht. Der Teilfonds ist bestrebt, sein Anlageziel durch eine Kombination aus globalen inflationsgekoppelten Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert), Schwellenmarktanleihen und -währungen, Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren sowie mit Rohstoffen und dem Immobiliensektor zusammenhängenden Instrumenten zu erreichen. Engagements bei solchen Anlagen können durch direkte Anlagen oder die Verwendung von Finanzderivaten erreicht werden, wie im Verkaufsprospekt näher erläutert. Der Teilfonds verfolgt in Übereinstimmung mit seinen Anlagerichtlinien eine Multi-Asset-Anlagestrategie. Das Ziel der Strategie besteht darin, im Laufe der Zeit den Erhalt des Realkapitals zu erreichen, indem die Allokation zu verschiedenen inflationsgekoppelten Anlageklassen durchgeführt wird. Im Rahmen dieser Anlagestrategie wird die Anlageberatungsgesellschaft eine globale Prognose für Zinsen und Inflationsraten für die verschiedensten Volkswirtschaften sowie einen integrierten Anlageprozess, wie im Verkaufsprospekt beschrieben, verwenden.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Engagement bei Master Limited Partnerships (MLPs) trug zur absoluten Rendite bei, da MLPs positive Renditen verbuchten.
- » Ein Engagement bei Rohstoffen trug zur absoluten Rendite bei, da Rohstoffe positive Renditen auswiesen.
- » Eine Übergewichtung bei italienischen Breakeven-Inflationspreads (Renditedifferenz zwischen nominalen Staatsanleihen und inflationsgebundenen Anleihen mit gleicher Laufzeit) trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die italienische Breakeven-Inflationsrate anstieg.
- » Eine Übergewichtung bei Investment Grade (IG)-Anleihen aus dem Finanzsektor trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads von IG-Finanzunternehmen verengten.
- » Eine Untergewichtung bei brasilianischen Breakeven-Inflationspreads beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die brasilianische Breakeven-Inflationsrate anstieg.
- » Eine Untergewichtung bei britischen Breakeven-Inflationspreads beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die britische Breakeven-Inflationsrate anstieg.

Low Average Duration Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassier
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	(0,12 %)	2,74 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	(0,17 %)	2,73 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2004)	(0,32 %)	2,47 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 03. Jul. 2003)	(0,35 %)	2,31 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2004)	(0,39 %)	2,27 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	(0,54 %)	1,73 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(0,54 %)	1,99 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Nov. 2009)	(0,24 %)	1,88 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	(0,27 %)	2,83 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(0,27 %)	1,23 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index	(0,08 %)	2,09 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2012)	(0,57 %)	0,56 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(0,59 %)	2,00 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jul. 2009)	(1,03 %)	0,38 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (EUR Hedged)	(0,48 %)	1,26 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	(0,19 %)	0,87 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2010)	(0,32 %)	1,56 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (GBP Hedged)	(0,17 %)	0,91 % ²

Der Low Average Duration Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Positionen bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Positionen in verbrieften Schuldverschreibungen trugen zur Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Titel stiegen.
- » Ein Short-Engagement in britischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die lokalen Zinsen stiegen.
- » Eine Übergewichtung in brasilianischer Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die lokalen Zinsen stiegen.

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	0,57 %	0,04 % ²
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2021)	—	0,00 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	0,24 %	2,81 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	0,18 %	1,23 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021)	—	(0,10 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(0,29 %)	0,31 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (EUR Hedged)	(0,17 %)	1,23 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	0,43 %	2,07 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021)	—	(0,10 %)
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (GBP Hedged)	0,16 %	2,09 % ²
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2017)	0,53 %	2,05 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (NOK Hedged)	0,23 %	2,40 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Unternehmens-Rentenpapieren mit Investment Grade-Qualität (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung bei in US-Dollar lautender Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Eine Übergewichtung bei Fluglinien und im Finanzdienstleistungssektor trug zur Wertentwicklung bei, da diese Sektoren den Gesamtmarkt übertrafen.
- » Eine Übergewichtung in asiatischen Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.
- » Die Titelauswahl in regierungsnahen Wertpapieren und im Bankensektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da ausgewählte Emittenten in diesen Sektoren untergewichtet waren, jedoch erhebliche Wertsteigerungen verbuchten.
- » Ein Long-Engagement beim japanischen Yen beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Low Duration Income Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,71 %	3,96 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,72 %	3,97 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,29 %	3,11 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Sep. 2018)	1,25 %	3,24 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 03. Sep. 2020)	1,55 %	4,90 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index	(0,02 %)	2,79 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,16 %	1,41 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,27 %	1,43 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	0,79 %	0,58 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	0,75 %	0,55 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (CHF Hedged)		
Auf EUR lautende Klassen		
	(0,55 %)	0,32 %
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,25 %	1,75 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,07 %	1,38 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,06 %	1,37 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	0,88 %	0,87 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	0,86 %	0,89 %
Class Z EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jun. 2020)	1,61 %	7,06 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (EUR Hedged)		
Auf GBP lautende Klassen		
	(0,43 %)	0,69 % ²
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,59 %	2,62 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,66 %	2,61 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (GBP Hedged)		
Auf SGD lautende Klassen		
	(0,11 %)	1,68 %
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2020)	1,75 %	4,80 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,25 %	2,59 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (SGD Hedged)	0,02 %	2,45 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Income Fund strebt unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung attraktive Erträge an. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Positionen in verbrieften Schuldverschreibungen, in erster Linie Non-Agency-MBS, trugen zur Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Wertpapiere stiegen.
- » Positionen in hochverzinslichen Schuldtiteln trugen durch Carry und die Verengung von Spreads zur Wertentwicklung bei.
- » Positionen in Unternehmensanleihen mit Investment Grade, insbesondere aus dem Finanzsektor, trugen durch Carry, die Titelauswahl und die Verengung von Spreads zur Wertentwicklung bei.
- » Ein Long-Engagement in lokale Zinssätzen bestimmter Schwellenländer beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Renditen in den betreffenden Ländern stiegen.
- » Ein Long-Engagement in US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Renditen anstiegen.
- » Ein Long-Engagement in australischen Zinssätzen beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Renditen anstiegen.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	45,26 %	(3,11 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	45,28 %	(3,10 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 21. Feb. 2018)	45,00 %	0,45 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2018)	44,95 %	0,89 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	44,26 %	(4,30 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	45,97 %	0,63 %
Alerian MLP Index	47,84 %	(6,06 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	44,51 %	(5,04 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	44,28 %	(5,01 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2018)	44,12 %	(1,80 %)
Alerian MLP Index EUR (Hedged)	47,51 %	(7,60 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	44,62 %	(5,00 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	44,12 %	(5,02 %)
Alerian MLP Index GBP (Hedged)	47,54 %	(7,66 %)

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Die vom Teilfonds angestrebte „Gesamtrendite“ besteht aus Ertrag und Kapitalzuwachs. Der Teilfonds ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er unter normalen Umständen zwei Drittel seines Nettovermögens entweder direkt oder indirekt in ein Portfolio aus Aktien anlegt, die verbunden sind mit (i) börsengehandelten Partnerships, die auch als Master Limited Partnerships („MLPs“) bezeichnet werden, (ii) den General Partners, die Eigentümer oder Manager von MLPs sind, (iii) Spin-Offs (Unternehmen, die nach Beteiligungsverkäufen oder Umstrukturierungen von den MLPs oder General Partner ausgegliedert werden) von MLPs, (iv) Unternehmen, die aufgrund dessen, dass sie in derselben Industrie tätig sind oder mit MLPs konkurrieren, MLPs ähnlich sind, (v) anderen juristischen Personen, die ggf. nicht als börsengehandelte Partnership strukturiert sind, jedoch im Midstream-Energiesektor tätig sind (die Transportkomponente des Energieinfrastruktursektors wie Pipelines, Bahn und Öl sowie Öltanker) und (vi) Zweckgesellschaften (d. h. juristische Personen, die für einen bestimmten Zweck errichtet wurden, die ggf. als Anlagevehikel verwendet werden, um Zugang zu hier beschriebenen Anlagen zu erlangen). Der Teilfonds kann in diese Instrumente entweder auf dem Sekundärmarkt oder während einer Neuemission anlegen.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Engagement bei Aktien von Midstream-Energieunternehmen erhöhte die absolute Rendite, da der Sektor positive Renditen verzeichnete.
- » Eine Untergewichtung bei Aktien von Midstream-Energieunternehmen beeinträchtigte die relative Rendite, da der Sektor positive Renditen verzeichnete.
- » Die Titelauswahl im Sektor für Erdgastransport in Pipelines beeinträchtigte die relative Rendite, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Bereich Erdgasförderung und -verarbeitung beeinträchtigte die relative Rendite, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Sektor.
- » Titelauswahl und Untergewichtung im Bereich Pipelinetransport von Erdöl trugen zur relativen Rendite bei, da die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Sektor insgesamt und sich der Sektor schlechter entwickelte als der Vergleichsindex.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,22 %	3,49 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,22 %	3,51 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2017)	1,08 %	2,85 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,15 %	3,16 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,97 %	3,01 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,72 %	2,57 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,77 %	2,58 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mai 2020)	1,13 %	6,53 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 03. Sep. 2019)	1,60 %	4,36 %
3 Month USD LIBOR Index	0,11 %	1,56 % ²
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Jun. 2021)	—	0,50 %
3 Month USD LIBOR (CAD Hedged) Index	0,08 %	0,01 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,68 %	0,98 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2017)	0,31 %	(0,44 %)
3 Month USD LIBOR (in CHF besichert)	(0,42 %)	(0,95 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,85 %	1,37 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,89 %	1,36 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,39 %	0,45 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Jun. 2017)	0,32 %	0,07 %
3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) Index	(0,29 %)	(0,56 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,19 %	2,28 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,11 %	2,28 %
Class Z GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017)	1,48 %	2,51 %
3 Month USD LIBOR (GBP Hedged) Index	0,01 %	0,38 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2017)	0,75 %	1,70 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,87 %	2,11 %
3 Month SGD LIBOR Index	0,14 %	1,15 % ²

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Mortgage Opportunities Fund beabsichtigt, einen höchstmöglichen langfristigen Ertrag bei gleichzeitiger umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Nettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus mit Hypotheken verbundenen festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) investiert, zu denen unter anderem Agency- und Non-Agency-RMBS und CMBS sowie Wertpapiere zur Übertragung von Kreditrisiken zählen können.

Kommentare zum Fonds

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

- » Engagements in vorrangigen Non-Agency-RMBS trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Positionen in konventionellen Agency-MBS trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Engagements in vorrangigen Non-Agency-CMBS trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein US-Zinsengagement beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.
- » Positionen in strukturierten Agency-MBS beeinträchtigten die Wertentwicklung, da der Sektor negative Renditen verzeichnete.
- » Government National Mortgage Association-MBS beeinträchtigten die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	15,21 %	7,79 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2001)	15,20 %	9,24 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Jan. 1999)	15,02 %	7,27 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	14,68 %	9,84 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	15,15 %	22,72 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2017)	14,45 %	16,03 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	15,00 %	7,13 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	14,70 %	14,11 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	14,68 %	9,19 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2017)	14,25 %	13,28 %
S&P (EUR Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	14,58 %	8,20 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2021)	—	1,86 %
S&P (GBP Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	—	15,00 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.
² Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.
³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Strategic Income Fund basiert auf folgenden Faktoren: Von der Auflegung bis 26. Juli 2016—75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate Index Hedged USD/25 % MSCI All Country World Index; Seit 27. Juli 2016—75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25% MSCI World Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der StocksPLUS™ Fund ist bestrebt, eine Rendite zu erzielen, die besser ist als die Entwicklung der Gesamtrendite von Standard & Poor's 500 Composite Stock Price Index („S&P 500“). Zu diesem Zweck wendet der Teilfonds eine gesellschaftseigene Portfoliomanagementstrategie an, die ein aktiv verwaltetes Portfolio festverzinslicher Wertpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit einem Engagement im S&P 500 Index verbindet. Der Teilfonds darf unbeschränkt in Aktien und Wertpapiere anlegen, die sich in Aktien wandeln lassen.

Kommentare zum Fonds

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

- » Das Engagement des Teilfonds bei mit dem S&P 500 verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich in den sechs Monaten bis Juni 2021 positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 eine Rendite von 15,25 % verbuchte.
- » Die Alpha-Anleihenstrategie des Fonds trug zur Rendite bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
- » Positionen bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Engagement in US-Inflationsraten trug zur Wertentwicklung bei, da höhere Inflation erwartet wurde.
- » Positionen in Non-Agency-MBS trugen zur Wertentwicklung bei, da der Kurs dieser Wertpapiere stieg.
- » Die US-Zinsposition beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Renditen auf breiter Basis stiegen.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019)	15,19 %	23,96 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019)	14,64 %	22,83 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	15,00 %	21,79 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mai 2020)	14,64 %	46,22 %
S&P (EUR Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	14,58 %	41,44 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2021)	—	1,90 %
S&P (GBP Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	—	—

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er die unternehmenseigene Portfoliomanagementstrategie der Anlageberatungsgesellschaft, die als „StocksPLUS“ bekannt ist (die ein aktiv verwaltetes, aus Renteninstrumenten bestehendes Portfolio mit Engagements in Aktienwerten kombiniert), verfolgt. Renteninstrumente sind Darlehen ähnlich und zahlen feste oder variable Zinsen.

Kommentare zum Fonds

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

- » Das Engagement des Teilfonds bei mit dem S&P 500 verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich in den sechs Monaten bis Juni 2021 positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 eine Rendite von 15,25 % verbuchte.
- » Die Alpha-Anleihenstrategie des Fonds trug zur Rendite bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
 - » Positionen in Non-Agency-MBS trugen zur Wertentwicklung bei, da der Kurs dieser Wertpapiere stieg.
 - » Positionen bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
 - » Positionen in hochverzinslichen Unternehmensanleihen trugen zur Wertentwicklung bei, da der Kurs dieser Wertpapiere stieg.
 - » Die US-Zinsposition beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Renditen auf breiter Basis stiegen.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	5,86 %	5,47 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	5,38 %	4,86 %
Class E, ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	5,36 %	4,86 %
75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Value Index ³	1,99 %	5,69 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	5,73 %	4,41 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	5,22 %	3,45 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	5,30 %	3,45 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	4,98 %	2,21 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	5,04 %	2,22 %
75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate EUR Hedged/25 % MSCI World Value Index EUR Hedged ³	1,86 %	4,39 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Strategic Income Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis 26. Juli 2016: 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate Index Hedged USD / 25 % MSCI All Country World Index; vom 27. Juli 2016 bis 6. Oktober 2019: 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index; seit dem 7. Oktober 2019: 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Value Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Strategic Income Fund strebt unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung attraktive laufende Erträge an. Das sekundäre Anlageziel besteht im langfristigen Kapitalzuwachs. Der Teilfonds verwendet eine globale Multi-Sektor-Strategie, mit der der Gesamtrendite-Anlageprozess und die Philosophie der Anlageverwaltungsgesellschaften mit der Ertragsmaximierung kombiniert werden sollen. Die Portfoliokonstruktion beruht auf dem Prinzip der Diversifizierung in die verschiedensten internationalen Renten- und Aktienwerte.

Kommentare zum Fonds

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

Festverzinsliche Komponente:

- » Positionen in Non-Agency-MBS trugen zur Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Titel stiegen.
- » Ein Engagement in ausgewählten Aktien wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere positive Renditen verbuchten.
- » Positionen bei US-Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads dieser Papiere verengten.
- » Positionen in hochverzinslichen Unternehmensanleihen trugen zur Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere positive Renditen erzielten.
- » Ein Engagement in US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die US-Zinsstrukturkurve steiler verlief und die US-Zinsen im Kurvenbereich zwischen 2 und 10 Jahren anstiegen.
- » Engagements in Schultiteln in Landeswährung ausgewählter Schwellenmarktländer einschließlich Mexiko und Peru beeinträchtigten die Wertentwicklung, da diese Papiere negative Renditen auswiesen.

Aktienkomponente:

- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Energiesektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Nicht-Basiskonsumgütersektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl im Kommunikationsdienstleistungssektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Es gab keine sonstigen Faktoren mit maßgeblich nachteiligen Auswirkungen auf die Wertentwicklung des Fonds.

Total Return Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 1998)	(1,16 %)	5,38 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2000)	(1,14 %)	5,46 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Jan. 1999)	(1,32 %)	4,85 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2000)	(1,34 %)	4,89 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2003)	(1,39 %)	4,09 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(1,59 %)	4,06 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	(1,59 %)	3,92 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	(1,22 %)	4,72 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	(1,20 %)	5,56 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(1,67 %)	2,46 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index	(1,60 %)	4,81 % ²
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Mai 2013)	(1,22 %)	2,93 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index (CAD Hedged)	(1,62 %)	2,85 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	(1,64 %)	1,80 %
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	(1,78 %)	1,46 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Sept. 2012)	(2,09 %)	0,37 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(2,20 %)	1,59 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2003)	(1,55 %)	3,86 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(1,50 %)	3,94 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2004)	(1,73 %)	3,44 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2009)	(1,85 %)	2,44 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(2,01 %)	3,14 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	(1,99 %)	1,20 %
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(1,66 %)	1,37 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(2,22 %)	0,80 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	(2,05 %)	3,25 % ²
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2002)	2,02 %	3,63 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Mrz. 2021)	—	2,70 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index (EUR Unhedged) Index	1,52 %	3,12 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Mrz. 2010)	(1,22 %)	3,43 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(1,19 %)	4,72 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	(1,66 %)	4,11 % ²
Auf HKD lautende Klassen		
Class E HKD (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	(1,47 %)	2,29 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	(1,42 %)	2,25 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	(1,45 %)	3,06 %
Auf ILS lautende Klassen		
Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2010)	(1,43 %)	3,37 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (ILS Hedged) Index	(1,88 %)	3,31 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jan. 2011)	(1,17 %)	3,55 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	(1,56 %)	3,61 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	(1,58 %)	3,90 % ²

Der Total Return Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Positionen in Non-Agency Mortgage-Backed Securities (MBS) und anderen verbrieften Anlagen trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Short-Engagement bei britischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen anstiegen.
- » Positionen im Hochzinsbereich trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Die Titelauswahl bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade, insbesondere im Finanzsektor, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Eine Untergewichtung bei Agency-MBS trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Überschussrenditen dieser Wertpapiere negativ ausfielen.
- » Ein Engagement in nationalen Zinsen Perus beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.
- » Ein Engagement in nationalen Zinsen Brasiliens beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.
- » Eine Übergewichtung beim mittelfristigen Teil der US-Zinsstrukturkurve belastete die relative Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Gesamterndite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	1,15 %	2,25 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	0,66 %	1,13 %
3 Month USD LIBOR Index	0,11 %	1,30 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	0,69 %	0,43 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	0,10 %	(0,66 %)
3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) Index	(0,29 %)	(0,37 %) ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO TRENDS Managed Future Strategy Fund strebt positive risikobereinigte Renditen unter umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er unter normalen Umständen in Derivate auf Zinsen, Währungen, hypothekarisch besicherte Wertpapiere (wie im Verkaufsprospekt des Teilfonds dargestellt), Schuldtitel, Aktienindizes, volatilitätsbezogene Instrumente (einschließlich u.a. Futures auf volatilitätsbezogene Indizes) und rohstoffbezogene Instrumente (wie im Verkaufsprospekt des Teilfonds dargestellt) investiert.

Kommentare zum Fonds

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

- » Long-Positionen in taiwanesischen und europäischen Aktien trugen aufgrund positiver Kursentwicklungen in diesen Ländern zur Wertentwicklung bei.
- » Positionen im kolumbianischen Peso und der schwedischen Krone beeinträchtigten die Wertentwicklung aufgrund wechselhafter Kursentwicklung in diesen Ländern.
- » Short-Positionen in Duration aus Europa und Hongkong beeinträchtigten die Wertentwicklung aufgrund sinkender Renditen in diesen Märkten.
- » Das Sicherheitenportfolio trug zur Rendite bei, was vor allem Kursgewinnen bei kurzfristigen Unternehmensanleihen zu verdanken war.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Auf GBP lautende Klassen	6 Monate	Auflegung von Klassen
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2007)	(2,24 %)	6,13 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2016)	(2,27 %)	3,91 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 28. Aug. 2019)	(2,31 %)	1,76 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2019)	(2,05 %)	3,07 %
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	(2,48 %)	5,74 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der UK Corporate Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds legt mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf GBP lautenden festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten an. Dabei handelt es sich um direkte Beteiligungen an festverzinslichen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder derivativen Instrumenten, wie insbesondere Optionen, Futures, Swaps oder Credit Default Swaps.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Übergewichtung im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich nachrangige Schuldtitel von Banken überdurchschnittlich entwickelten.
- » Eine Untergewichtung am langen Ende der britischen Zinsstrukturkurve trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen am langen Ende stiegen.
- » Ein Engagement bei forderungsbesicherten Wertpapieren trug zur Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse besser abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Eine Übergewichtung bei staatsnahen Titeln und der integrierten Elektrizitätsversorgung beeinträchtigte die Wertentwicklung, da diese Sektoren schlechter abschnitten als der Gesamtmarkt.
- » Ein Long-Engagement beim australischen Dollar beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem britischen Pfund an Wert verlor.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

Auf GBP lautende Klassen	6 Monate	Auflegung von Klassen
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	(4,09 %)	6,62 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Aug. 2008)	(4,11 %)	8,41 %
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index ³	(5,07 %)	6,15 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den UK Long Term Corporate Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. März 2013: Markt iBoxx Sterling Non-Gilts 10+ Index; seit dem 31. März 2013: ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der UK Long Term Corporate Bond Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Pfund Sterling lautenden Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Übergewichtung im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich nachrangige Schuldtitel von Banken überdurchschnittlich entwickelten.
- » Ein Engagement bei forderungsbesicherten Wertpapieren trug zur Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse besser abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Eine Untergewichtung am langen Ende der britischen Zinsstrukturkurve trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen am langen Ende stiegen.
- » Eine Übergewichtung im staatsnahen Sektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Eine Untergewichtung bei Schwellenländern beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich der Sektor überdurchschnittlich entwickelte.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Mai 1998)	3,28 %	6,23 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	3,20 %	6,67 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 1999)	3,07 %	5,90 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 14. Jan. 1999)	3,11 %	5,87 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	2,80 %	5,31 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	2,78 %	5,42 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	3,16 %	7,57 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	3,23 %	5,47 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 11. Jan. 2012)	2,78 %	5,60 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,09 %	5,65 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 29. Jun. 2016)	3,59 %	7,61 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index ³	3,70 %	6,38 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2020)	2,77 %	18,01 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (CHF Hedged) ³	3,19 %	20,27 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	2,87 %	5,92 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	2,85 %	5,25 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Feb. 2003)	2,65 %	5,87 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	2,38 %	4,27 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (EUR Hedged) ³	3,31 %	6,59 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	3,15 %	6,50 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	3,22 %	5,41 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (GBP Hedged) ³	3,64 %	6,97 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den US High Yield Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 31. März 2015: ICE BofA Merrill Lynch US High Yield, BB-B Rated, Constrained Index; seit dem 01. April 2015: ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US High Yield Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtnettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hoch verzinslichen Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die von Moody's mit Baa oder von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben.

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl im Energiebereich trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Energiesektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Gesundheitssektor trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Sektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Versorgungssektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Energiesektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Gesundheitssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Die Titelauswahl im Medien-, Unterhaltungs- und Verlagssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die entsprechenden Positionen des Fonds schlechter abschnitten als der Gesamtmarkt.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	(1,01 %)	5,22 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	(1,08 %)	5,21 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	(1,48 %)	4,14 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	(1,48 %)	6,71 %
Bloomberg Barclays U.S. Credit Index	(1,28 %)	4,78 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	(1,46 %)	2,91 %
Bloomberg Barclays U.S. Credit Index (EUR Hedged)	(1,73 %)	2,54 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 15. Sep. 2016)	(1,17 %)	3,81 %
Bloomberg Barclays U.S. Credit Index (GBP Hedged)	(1,32 %)	3,52 %

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US Investment Grade Corporate Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein breit gefächertes Portfolio von auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit Investment Grade (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Diese enthalten Beteiligungen an kreditnahen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder derivativen Instrumenten, wie Optionen, Terminkontrakte oder Credit Default Swaps, wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Übergewichtetes Engagement im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da dieser Sektor den Investment Grade-Gesamtmarkt übertraf.
- » Ein Übergewichtetes Engagement bei Fluglinien trug zur Wertentwicklung bei, da dieser Sektor den Investment Grade-Gesamtmarkt übertraf.
- » Ein taktisches Engagement in Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da dieser Sektor den Investment Grade-Gesamtmarkt übertraf.
- » Eine Untergewichtung in Duration in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Renditen sanken.
- » Eine Übergewichtung in Sinclair Broadcasting (Muttergesellschaft von Sinclair Broadcasting) beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.
- » Ein Übergewichtetes Engagement in Versorgungsunternehmen beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor schlechter abschnitt als der Investment Grade-Gesamtmarkt.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	0,18 %	1,88 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 11. Mrz. 2020)	0,27 %	1,99 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	0,09 %	1,53 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	0,00 %	1,49 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	0,10 %	1,86 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 07. Aug. 2014)	0,49 %	2,36 %
FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index	0,03 %	0,84 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(0,20 %)	0,33 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	(0,40 %)	(0,26 %)
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (EUR Hedged)	(0,37 %)	(0,85 %) ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US Short-Term Fund ist bestrebt, bei Kapitalerhaltung und täglicher Liquidität höchstmögliche laufende Erträge zu erzielen. Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten, die von Organisationen des öffentlichen und privaten Sektors in den USA und außerhalb der USA ausgegeben werden. Die durchschnittliche Duration des Portfolios dieses Teilfonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaften. Es wird nicht davon ausgegangen, dass sie länger als ein Jahr ist. Der Teilfonds wird seine Wertentwicklung auf einen Vergleichszinssatz des FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index beziehen. Bei dem FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert.

Kommentare zum Fonds

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

- » Positionen bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Positionen in verbrieften Schuldverschreibungen trugen zur Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Titel stiegen.
- » Positionen bei US-Zinsen trugen zur Wertentwicklung bei, da die US-Zinsstrukturkurve bei Treasuries steiler verlief.
- » Eine Übergewichtung in kanadischer Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die lokalen Zinsen am vorderen Ende der Kurve stiegen.
- » Ein Engagement bei Staatspapieren belastete die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere negative Renditen auswiesen

Beschreibungen der Vergleichsindizes

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
1 Month CHF LIBOR Index	Der 1 Month CHF LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
1 Month Euribor Index	Der 1 Month Euribor (Euro Interbank Offered Rate) Index ist der Vergleichszinssatz des ausgedehnten Euro-Geldmarkts. Dieser Index wird von der European Banking Federation, die 2.800 Banken in den fünfzehn Mitgliedsstaaten der Europäischen Union repräsentiert, und von der EWU-Abteilung der ACI, einer global agierenden Finanzmarktvereinigung, betrieben. Eine repräsentative Auswahl der wichtigsten Banken liefert tägliche Kurse für dreizehn Fälligkeiten von einer Woche bis zu einem Jahr, zu denen auf Euro lautende Interbank-Festgelder in der Eurozone zwischen den wichtigsten Banken gehandelt werden. Der durchschnittliche Zinssatz errechnet sich nach Löschen der höchsten/niedrigsten Kurse (15 % auf beiden Seiten). Der Euribor wird zu Kassavalutierung (T+2) und zu tatsächlichen/360-Tagessatzbedingungen angeboten und seit dem 4. Januar 1999 auf drei Kommastellen genau angegeben. Er wird 11:00 Uhr vormittags Brüsseler Zeit verbreitet.
1 Month GBP LIBOR Index	Der 1 Month GBP LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
1 Month NIBOR Rate Index	Der 1 Month NIBOR (Norwegian Interbank Offered Rate) Index ist ein durchschnittlicher Zinssatz, der von der Norges Bank bestimmt wird. Er leitet sich vom Zinssatz eines vergleichbaren Darlehens am US-Dollarmarkt zuzüglich des Zinssatzdifferentials zwischen der norwegischen Krone und dem US-Dollar am Devisenterminmarkt ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
1 Month SEK LIBOR Index	Der 1 Month SEK LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
1 Month USD LIBOR Index	Der 1 Month USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Jeweils 1/3 Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged)	Der Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (USD Hedged) bietet ein weites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Rentenmärkte von Industrieländern. ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieländern nach, die ihre Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Währungsverbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index beinhaltet auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautenden Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P, sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2%-Deckelung entsprechend proportional. Vor dem 25. September 2009 waren die ICE BofA Merrill Lynch-Indizes als Merrill-Lynch-Indizes bekannt. Der JPMorgan EMBI Global (USD Hedged) bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbrieft Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
3 Month Euribor	Der 3-Monats-Euribor (Euro Interbank Offered Rate) ist ein täglicher Referenzzinssatz auf der Basis der Zinssätze, zu denen sich Banken untereinander im Großhandel (auf dem sog. „Interbankenmarkt“) unbesicherte Darlehen anbieten. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
3 Month GBP LIBOR Index	Der 3 Month GBP LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
3 Month HIBOR Index	Der 3 Month HIBOR (Hong Kong Interbank Offered Rate) Index ist ein Referenzzinssatz, der den durchschnittlichen Zinssatz abbildet, zu dem eine Reihe von Banken, die von der Hong Kong Association of Banks bestimmt wurden, bereit sind, sich untereinander unbesicherte Kredite zu verschiedenen Laufzeiten zu gewähren.
3 Month SGD LIBOR Index	Der 3 Month SGD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
3 Month USD LIBOR Index	Der 3 Month USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1- 30 Year Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged), 10 % Bloomberg Barclays Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return	Der Vergleichsindex besteht aus 45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1- 30 Year Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged), 10 % Bloomberg Barclays Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index und 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index. Der Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1- 30 Year Index misst die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen aus Industrieländern. Er ist nach Marktkapitalisierung gewichtet und umfasst Laufzeiten bis zu 30 Jahren. Der Bloomberg Barclays Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index misst die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen aus Schwellenländern und ist nach Marktkapitalisierung gewichtet. Der Bloomberg Commodity Total Return Index ist ein nicht verwalteter Index aus Terminkontrakten auf eine Reihe von physischen Rohstoffen. Der Index wurde als hoch liquider und diversifizierter Vergleichsindex für Rohstoffe als Vermögensklasse geschaffen. Der FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der darauf ausgelegt ist, die Wertentwicklung börsennotierter Immobilienunternehmen weltweit abzubilden. Der Alerian MLP Total Return Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index und der führende Maßstab für Master Limited Partnership (MLPs) aus dem Energiesektor mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung. Der Bloomberg Gold Subindex Total Return Index spiegelt die Rendite vollständig besicherter Positionen in den zugrundeliegenden Rohstoffterminkontrakten wider.
50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged)	Der Vergleichsindex besteht zu je 50 % aus JPMorgan EMBI Global Index und JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged). Der JPMorgan EMBI Global Index bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, sowie verbrieft Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen und Euro-Anleihen ab. Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
60 % MSCI All Country World Index / 40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged)	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 60 % MSCI All Country World Index und 40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged). Der MSCI All Country World Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrie- und Schwellenländern zu messen. Der Index besteht aus 47 Länderindizes, von denen 23 Indizes von Industrieländern und 23 Indizes von Schwellenländern sind. Der Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) / 25 % MSCI World Value Index	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) und 25 % MSCI World Value Index. Der Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. Der MSCI World Value Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrieländern zu messen. Der MSCI World Value Index besteht aus 23 Industrieländerindizes.
Alerian MLP Index	Der Alerian MLP Index ist der führende Maßstab für Master Limited Partnership (MLPs) aus dem Energiesektor mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung. Es handelt sich um einen um Streubesitz bereinigten, marktkapitalisierungsgewichteten Index, der 50 führende Unternehmen umfasst.
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	Der Bloomberg AusBond Bank Bills Index ist ein nicht verwalteter Index, der die Gesamtertragsleistung australischer Geldmarktpapiere abbildet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index	Der Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1- 10 Year Bond Index repräsentiert die Euro Aggregate 1-10-Jahreskomponente des Bloomberg Barclays Pan-European Aggregate Index. Der Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index	Der Bloomberg Barclays Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) +15 Jahre Index repräsentiert Staatsanleihen aus Deutschland, Frankreich und den Niederlanden mit einer Laufzeit von über 15 Jahren und ist Komponente des Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Index. Dieser besteht wiederum aus Anleihen, die in Euro oder Altwährungen von 17 Mitgliedstaaten der Europäischen Währungsunion (EWU) begeben wurden. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen.

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index	Der Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index ist die Anleihekomponekte des Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Index. Der Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index	Der Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	Beim Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index 1- 5 Years Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade mit einer Laufzeit von mindestens einem 1 Jahr und weniger als 5 Jahren bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade.
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	Beim Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index	Der Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index und der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen, Agency- und Unternehmenstitel sowie US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade.
Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index	Der Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index USD Hedged ist für Anleger eine objektive und robuste Vergleichsgröße für den globalen Markt festverzinslicher Wertpapiere, die der Finanzierung von Projekten mit direkten positiven Umweltauswirkungen haben. Mithilfe einer von unabhängiger Seite bereitgestellten researchbasierten Methodik werden für den Index in Frage kommende „grüne Anleihen“ ermittelt, die die Green Bond Principles einhalten, sowie Anleihen nach der Verwendung ihrer Erträge für den Umweltschutz klassifiziert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index	Der Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf Dollar lauten. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. Diese Hauptsektoren unterteilen sich in spezifischere Indizes, die regelmäßig berechnet und veröffentlicht werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index	Der Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind, auf US-Dollar lauten und eine Laufzeit zwischen einem und drei Jahren haben. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Barclays U.S. Credit Index	Beim Bloomberg Barclays U.S. Credit Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der aus öffentlich begebenen Schuldverschreibungen von Unternehmen und bestimmten nicht US-amerikanischen Emittenten sowie besicherten Anleihen besteht, die bestimmten Anforderungen in Bezug auf Laufzeit, Liquidität und Qualität entsprechen. Um für den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen bei der SEC registriert sein. Dieser Index wurde zuvor als Bloomberg Barclays Credit Investment Grade Index bezeichnet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index	Der Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index misst die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen. Der Index umfasst von den folgenden Ländern emittierte, inflationsgekoppelte Schuldtitel: Australien, Kanada, Frankreich, Schweden, Großbritannien und die USA. Direkte Anlagen in einen nicht gemanagten Index sind nicht möglich.
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	Beim Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) handelt es sich um einen Index, der die Wertentwicklung der weltweiten Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen mit einer Laufzeit zwischen einem und 5 Jahren misst. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Commodity Index Total Return	Der Bloomberg Commodity Index Total Return ist ein nicht verwalteter Index aus Terminkontrakten auf eine Reihe physischer Rohstoffe. Der Index wurde als hoch liquider und diversifizierter Vergleichsindex für Rohstoffe als Vermögensklasse geschaffen. Die Futures-Engagements der Benchmark sind durch US-Schatzwechsel besichert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
Euro Short-Term Rate (ESTER)	ESTER spiegelt die Kosten für unbesicherte Euro-Übernachtungskredite von Banken im Euroraum wider. ESTER wird an jedem Tag veröffentlicht, an dem das Trans-European Automated Real-time Gross Settlement Express Transfer-Zahlungssystem (oder ein Nachfolgesystem) für die Abwicklung von Zahlungen in Euro geöffnet ist. ESTER beruht auf Transaktionen, die am vorangegangenen Geschäftstag (dem Stichtag „T“) mit einer Fälligkeit von T+1 durchgeführt und abgewickelt wurden und von denen angenommen wird, dass sie zu marktüblichen Bedingungen ausgeführt wurden, so dass sie die Marktzinsen unverzerrt widerspiegeln.
FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index	Beim FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der US-Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
FTSE Euro Broad Investment- Grade Index	Bei dem FTSE Euro Broad Investment Grade Index handelt es sich um einen Index des auf Euro basierenden Rentenmarkts der Kategorie Investment Grade, der institutionellen Anlegern (in Euro) zugänglich ist. Direkte Anlagen in einen nicht gemanagten Index sind nicht möglich.
Gleichgewichtete Mischung von drei Indizes mit einer konstanten Duration von 0,25 Jahren, wie von PIMCO berechnet: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets(USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged)	Der Index stellt eine gleichgewichtete Mischung aus den folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 0,25 Jahren dar: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, JPMorgan EMBI Global; All USD Hedged. Der Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index bietet ein breites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Festzinsmärkte unter Ausschluss der Schwellenmärkte. Der ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD bildet die Wertentwicklung von Anleihen ab, die von Emittenten aus Industrieländern begeben werden und von Moody's, S&P und Fitch durchschnittliche Bewertungen zwischen BB1 und B3 erhalten. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2%-Deckelung entsprechend proportional. Der Indexausgleich findet am letzten Kalendertag eines Monats statt. Der JPMorgan EMBI Global bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. Dieser Index bildet lediglich eine bestimmte Region oder ein bestimmtes Land ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofAML 3 Month USD LIBOR Index Hedged BRL Denominated in USD	Der ICE BofAML 3 Month USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index Hedged BRL Denominated in USD ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf dem Eurodollar-Markt des Vereinigten Königreichs berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofAML BB-B European Currency High Yield Constrained Index	Der Index ist so konzipiert, dass er die Wertentwicklung von auf EUR und GBP lautenden Unternehmensanleihen mit einem Rating unterhalb von Investment Grade abbildet, die auf den Eurobond-, GBP- oder EUR-Inlandsmärkten öffentlich begeben wurden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einem Durchschnitt aus Moody's, S&P sowie Fitch verfügen. Das Engagement gegenüber einzelnen Emittenten im Index ist auf 3 % beschränkt. Nähere Einzelheiten zum Index, einschließlich einer aktuellen Beschreibung seiner Duration, sind auf Anfrage von der Anlageberatungsgesellschaft erhältlich.
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index	Beim ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der US Treasuries (ausgenommen inflationsbesicherte Wertpapiere und STRIPS) mit mindestens 1 Milliarde USD umlaufendem Nennwert und einer Restlaufzeit bis zur endgültigen Fälligkeit von mindestens einem und weniger als drei Jahren enthält. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (EUR Hedged)	Der ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (EUR Hedged) umfasst eine einzige Emission, die zu Monatsbeginn gekauft und für einen vollen Monat gehalten wird. Am Monatsende wird diese Emission verkauft und in eine neu ausgewählte Emission angelegt. Die bei der Neugewichtung am Monatsende jeweils gewählte Emission ist der ausstehende Schatzwechsel, dessen Fälligkeitstermin am nächsten am Datum der Neugewichtung liegt, wobei er jedoch nicht mehr als drei Monate nach diesem Datum liegen darf. Um für die Wahl berücksichtigt zu werden, muss eine Emission am oder vor dem Neugewichtungsdatum am Monatsende abgewickelt worden sein. Der Index hält zwar oft den im Rahmen der jüngsten 3-Monats-Auktion ausgegebenen Schatzwechsel, es kann jedoch auch ein älterer 6-Monats-Wechsel gewählt werden.
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD	Der ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Verbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index beinhaltet auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautenden Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P, sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2%-Deckelung entsprechend proportional. Bis 25. September 2009 trugen die ICE BofA Merrill Lynch-Indizes die Bezeichnung Merrill-Lynch-Indizes.
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	Der ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index besteht aus auf Pfund Sterling lautenden Anleihen der Kategorie Investment Grade; ausgenommen sind auf Sterling lautende, von der britischen Regierung begebene Anleihen. Alle im Index vertretenen Anleihen müssen von mindestens einer der großen Ratingagenturen als Anlagen von Investment-Grade eingestuft werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	Der ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index bildet die Wertentwicklung von auf Pfund Sterling lautenden erstklassigen öffentlichen Schuldtiteln von Unternehmens- und quasistaatlichen Emittenten sowie Emittenten außerhalb von Großbritannien ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index	Der ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index bildet die Wertentwicklung von auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade ab, die am US-Inlandsmarkt öffentlich emittiert werden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen Wertpapiere über ein Rating unterhalb von Investment Grade (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch) und ein Risikoland mit Investment Grade-Rating (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch für auf Fremdwährung lautende Staatsanleihen mit langer Laufzeit) verfügen.
JPMorgan EMBI Global (EUR Unhedged)	Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Unhedged) bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden: darunter verbrieftete Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. Vor dem 01. Dezember 2009 wurden die Indexrenditen von PIMCO abgesichert
JPMorgan Asia Credit Index	Der J.P. Morgan Asia Credit Index (JACI) misst die Wertentwicklung des asiatischen Marktes ex-Japan für auf USD lautende Anleihen. Er dient als Vergleichsindex für Anlagemöglichkeiten in fest und variabel verzinsten sowie auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Instrumenten, die von asiatischen Staaten mit Ausnahme Japans, von quasi-staatlichen Stellen, von Banken und von Unternehmen emittiert werden.
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	Bei dem JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) handelt es sich um eine besondere, gewichtete Version des CEMBI-Index. Er beschränkt den Anteil der Indexländer mit umfangreicheren Industrieschuldverschreibungen, indem er nur einen bestimmten Anteil des aktuell bankfähigen Nennwerts der Schulden dieser Länder einbezieht. Der CEMBI Diversified führt zu gut verteilten, ausgeglicheneren Gewichtungen für die im Index enthaltenen Länder. Die vom CEMBI Diversified abgedeckten Länder sind mit den vom CEMBI abgedeckten identisch. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 22 Schwellenmarktländern mit mindestens 10 Milliarden USD Außenhandel nach. Direkte Anlagen in einen nicht gemanagten Index sind nicht möglich.
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden: Verbrieftete Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen und Euro-Anleihen.
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	Der JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden: darunter verbrieftete Forderungen, Darlehen, Euroanleihen und lokale Marktinstrumente; ausgeschlossen sind Emittenten, die der SRI-Berater nicht zulässt.
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
JP Morgan JACI Non-Investment Grade	Der JACI Non-IG umfasst festverzinsliche, auf US-Dollar lautende hochverzinsliche Anleihen, die von Staaten, quasi-staatlichen Stellen, Banken und Unternehmen in Asien begeben wurden. Der bestehende JACI Non-IG enthält sowohl fest- als auch variabel verzinsliche Anleihen, die von in Asien ansässigen Körperschaften begeben wurden und einen ausstehenden Nennbetrag von mindestens 150 Mio. USD sowie eine Restlaufzeit von mehr als einem Jahr aufweisen.
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	Der PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) ist ein diversifizierter globaler Index, der ein breites Spektrum von Gelegenheiten bei internationalen Rentenpapieren und Sektoren, von Industrieländern zu Schwellenmärkten, nominalem zu realem Vermögen, sowie von Barmitteln zu derivativen Instrumenten abdeckt. Abweichend von den herkömmlichen Indizes, die häufig aus Anleihen bestehen, die entsprechend ihrer Marktkapitalisierung gewertet werden, verwendet der GLADI eine BIP-Gewichtung, die sich auf schneller wachsende Gebiete der Welt konzentriert und so dem Index einen auf die Zukunft ausgerichteten Charakter verleiht. PIMCOs GLADI-Methode ist geistiges Eigentum, das durch das US-Patent Nr. 8.306.892 geschützt ist. GLOBAL ADVANTAGE und GLADI sind Markenzeichen von Pacific Investment Management Company LLC.
S&P 500 Index	Der S&P 500 ist ein nicht gemanagter Marktindex, der allgemein als repräsentativ für den Aktienmarkt insgesamt gilt. Der Index konzentriert sich auf das Large Cap-Segment des US-Aktienmarkts. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

Finanzstatus

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.878.760	\$ 799.818	\$ 280.657	\$ 148.688
Investmentfonds	202.101	71.640	19.103	16.097
Pensionsgeschäfte	0	1.302	0	1.299
Finanzderivate	3.728	3.644	861	381
Zahlungsmittel	0	5.029	747	13
Einlagen bei Kontrahenten	12.226	3.609	2.691	223
Forderungen aus Einkünften	28.954	12.886	3.319	1.741
Forderungen aus verkauften Anlagen	28.248	0	4.630	198
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	4.196	4.072	8.252	288
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	3.187	588	233	180
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	2.161.400	902.588	320.493	169.108
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(18.271)	(2.294)	(3.523)	(249)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(40.556)	(5.643)	(7.016)	(1.064)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(1)	(198)	(141)	(16)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(1.089)	(305)	(141)	(61)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(8.753)	(1.523)	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(109)	(47)	0	(2)
Überziehungskredit	(12.691)	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(680)	(1.650)	(30)	0
Sonstige Verbindlichkeiten	(25)	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(82.175)	(11.660)	(10.851)	(1.392)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 2.079.225	\$ 890.928	\$ 309.642	\$ 167.716

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
\$ 9.012.582	\$ 9.025.916	\$ 264.442	\$ 88.461	\$ 1.084.155	\$ 509.577	\$ 127.226	\$ 130.883
838.364	777.569	0	0	18	18	14.190	8.981
98.000	139.444	0	12.100	60.400	10.072	0	495
177.153	90.088	2.634	1.083	23.748	14.855	864	2.329
44.113	1.690	1.571	976	2.659	1.805	538	225
156.544	119.668	5.764	271	15.525	5.718	4.863	3.615
75.281	76.842	1.352	639	1.983	1.332	1.301	1.219
0	95.452	0	0	89	59	1.605	532
0	0	0	0	27.655	89.032	2.422	2.394
22.158	13.025	1.081	0	4.893	754	409	33
6.965	3.175	322	0	3.727	0	425	249
0	0	0	0	0	0	0	0
10.431.160	10.342.869	277.166	103.530	1.224.852	633.222	153.843	150.955
(164.826)	(102.466)	(8.210)	(640)	(18.658)	(7.441)	(3.53)	(677)
0	0	0	0	0	0	0	(519)
(4.877)	0	(6.489)	(207)	(8.360)	(297)	(1.700)	(511)
0	0	0	0	(49.640)	(136.640)	(2.627)	(3.236)
(21.458)	(10.448)	(739)	0	(959)	(245)	(185)	(17)
(7.004)	(6.175)	(123)	(38)	(944)	(261)	(125)	(126)
(924.164)	(2.130.472)	0	0	0	(153.550)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(358)	(696)	0	0	(15)	(3)	0	(7)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.096)	(1.655)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	(16)	0	(214)	0	0
(138.972)	(132.635)	(1.400)	(760)	(2.606)	(9.462)	0	(1.350)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.262.755)	(2.384.547)	(16.961)	(1.661)	(81.182)	(308.113)	(8.167)	(6.443)
\$ 9.168.405	\$ 7.958.322	\$ 260.205	\$ 101.869	\$ 1.143.670	\$ 325.109	\$ 145.676	\$ 144.512

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 16.043.337	\$ 16.283.835	\$ 1.452.289	\$ 1.228.715
Investmentfonds	1.862.015	1.782.474	165.550	146.844
Pensionsgeschäfte	642.417	46.261	0	39.170
Finanzderivate	292.971	421.412	32.952	49.160
Zahlungsmittel	51.814	48.380	17.864	9.131
Einlagen bei Kontrahenten	489.832	515.061	63.929	52.976
Forderungen aus Einkünften	163.102	163.321	14.431	14.871
Forderungen aus verkauften Anlagen	399	1.261	1.237	63
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	1.431.037	0	147.221
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	35.750	42.168	960	281
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	0	0	306
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	19.581.637	20.735.210	1.749.212	1.688.738
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(374.022)	(136.455)	(52.571)	(24.375)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(261.529)	(12.455)	(15.257)	(582)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	(1.427.406)	0	(146.906)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(15.507)	(43.845)	(162)	(482)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(15.974)	(16.400)	(1.200)	(1.112)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(94.426)	(68.836)	(1.982)	(989)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(229)	(328)	(5)	(24)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(10.669)	(8.806)	(2.577)	(2.245)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(80.615)	(98.872)	(6.570)	0
Einlagen von Kontrahenten	(69.848)	(279.946)	(7.180)	(25.092)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(922.819)	(2.093.349)	(87.504)	(201.807)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 18.658.818	\$ 18.641.861	\$ 1.661.708	\$ 1.486.931

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund		Emerging Markets Bond Fund	
Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
\$ 2.868.401	\$ 3.984.661	€ 6.591.005	€ 4.042.122	\$ 3.083.095	\$ 3.172.822	\$ 4.962.155	\$ 4.949.737
372.938	310.368	409.398	688.135	149.117	204.721	301.709	381.348
498.300	49.813	111.821	271.399	0	0	0	3.386
39.409	69.574	53.108	64.096	115.231	298.287	40.431	58.738
16.090	9.369	215.669	5.885	26.421	12.592	6.260	1.468
95.967	59.256	132.809	66.364	34.234	20.848	75.325	20.624
17.494	18.791	5.190	3.080	54.582	54.506	65.037	61.707
1.001	131	38.743	0	159.345	45.650	18.538	0
689.169	1.096.877	0	0	0	0	40.579	40.878
7.513	5.870	19.768	59.522	5.900	4.822	5.502	30.896
42.310	48.533	7.994	8.434	4.395	0	2.231	5.864
0	0	0	0	34	48	0	0
4.648.592	5.653.243	7.585.505	5.209.037	3.632.354	3.814.296	5.517.767	5.554.646
(129.339)	(76.674)	(90.317)	(22.032)	(93.647)	(193.468)	(95.312)	(19.870)
(35.677)	0	0	0	0	0	0	0
(17.395)	(6.583)	(25.853)	(662)	(127.255)	(170.958)	(23.305)	(1.483)
(662.995)	(2.106.480)	0	0	0	0	(68.308)	(68.678)
(3.899)	(1.479)	(9.948)	(9.205)	(917)	(709)	(5.734)	(7.861)
(2.994)	(2.537)	(7.833)	(5.035)	(2.229)	(2.206)	(3.902)	(3.937)
(4.767)	(205.836)	0	0	(598.815)	(470.467)	(141.920)	(138.092)
0	0	0	0	0	0	0	0
(41)	(192)	(41)	(19)	(443)	(936)	(520)	(18)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.331)	(1.427)	0	0	0	0	(763)	(672)
0	0	0	0	0	(45.161)	0	0
(9.349)	(47.175)	(18.233)	(43.158)	(40.713)	(81.107)	(11.493)	(51.020)
0	0	0	0	0	0	0	0
(867.787)	(2.448.383)	(152.225)	(80.111)	(864.019)	(965.012)	(351.257)	(291.631)
\$ 3.780.805	\$ 3.204.860	€ 7.433.280	€ 5.128.926	\$ 2.768.335	\$ 2.849.284	\$ 5.166.510	\$ 5.263.015

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.532.106	\$ 1.413.297	\$ 243.140	\$ 262.961
Investmentfonds	0	0	3.435	821
Pensionsgeschäfte	113.008	138.321	0	921
Finanzderivate	14.586	17.638	712	5.453
Zahlungsmittel	16.835	361	962	84
Einlagen bei Kontrahenten	29.937	2.384	5.150	658
Forderungen aus Einkünften	29.824	16.995	2.861	3.196
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	0	934	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	4.080	4.104	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	53.134	3.547	306	54
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	220	317	822	744
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	2.793.730	1.596.964	258.322	274.892
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(53.132)	(4.724)	(7.366)	(1.805)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(79.867)	(608)	(3.479)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(7.512)	(7.531)	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(5.047)	(247)	(98)	(147)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(1.655)	(1.073)	(252)	(279)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(257.435)	(122.795)	(4.262)	(4.527)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	(2.338)
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(1)	(1)	(23)	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(463)	(39)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(8.452)	(18.489)	(60)	(4.560)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(413.564)	(155.507)	(15.540)	(13.656)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 2.380.166	\$ 1.441.457	\$ 242.782	\$ 261.236

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

⁽¹⁾ Der PIMCO ESG Income Fund wurde am 29. April 2021 aufgelegt.

PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund ⁽¹⁾		Euro Bond Fund	
Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 30. Jun. 2021	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
\$ 331.967	\$ 228.967	\$ 26.961	\$ 22.934	\$ 4.984	€ 2.527.477	€ 3.233.815	
5.141	12.673	2.922	3.168	0	222.034	316.864	
0	1.565	0	7.136	0	14.100	147.655	
10.272	14.708	1.759	2.073	59	21.214	27.019	
4.779	2.447	585	0	1.561	2.725	2.874	
11.306	3.259	270	211	61	33.595	33.030	
3.350	3.082	274	159	25	10.858	9.707	
5.164	1.000	0	1.500	0	2.547	46	
0	38.617	0	0	0	9.816	683.449	
8	105	7	5	59	670	4.099	
0	0	135	375	0	6.734	0	
0	0	0	0	0	0	0	
371.987	306.423	32.913	37.561	6.749	2.851.770	4.458.558	
(17.440)	(8.990)	(1.768)	(1.751)	(65)	(38.059)	(11.468)	
0	0	0	0	0	0	0	
(9.083)	(3.224)	(198)	(2.223)	(516)	(3.025)	(18.385)	
0	(61.775)	0	0	0	(9.805)	(1.161.584)	
(15)	0	(17)	(104)	0	(1.109)	(1.679)	
(264)	(155)	(38)	(42)	(3)	(1.216)	(1.392)	
(9.796)	(3.770)	0	0	0	0	0	
0	0	0	0	0	0	0	
(64)	(1)	0	0	0	(9)	(14)	
0	0	0	0	0	0	0	
0	0	0	0	0	0	0	
(139)	(3.059)	0	0	(1)	0	(4.268)	
(1.860)	(5.130)	(50)	(870)	0	(2.846)	(16.313)	
(15)	(10)	0	0	0	0	0	
(38.676)	(86.114)	(2.071)	(4.990)	(585)	(56.069)	(1.215.103)	
\$ 333.311	\$ 220.309	\$ 30.842	\$ 32.571	\$ 6.164	€ 2.795.701	€ 3.243.455	

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	€ 958.210	€ 1.080.854	€ 2.521.096	€ 3.414.315
Investmentfonds	24.198	19.350	127.368	127.470
Pensionsgeschäfte	8.300	16.413	0	2.872
Finanzderivate	3.808	5.942	13.622	36.039
Zahlungsmittel	9.525	7.545	8.202	14.065
Einlagen bei Kontrahenten	32.972	21.895	70.281	63.724
Forderungen aus Einkünften	6.480	8.597	20.937	24.723
Forderungen aus verkauften Anlagen	19	12	96	41.013
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	58.681	0	643.118
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	265	416	2.012	5.807
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	4.522	0	0
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	1.043.777	1.224.227	2.763.614	4.373.146
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(5.886)	(3.779)	(21.351)	(4.722)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	(6.091)	(13.947)	(17.166)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	(58.534)	0	(1.122.848)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(4.320)	(318)	(10.276)	(3.738)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(392)	(453)	(2.376)	(2.903)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	(3.916)	(2.600)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	(25)	(40)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(547)	0	(4.835)	(6.719)
Einlagen von Kontrahenten	(780)	(4.994)	(6.004)	(29.543)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(11.925)	(74.169)	(62.730)	(1.190.279)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	€ 1.031.852	€ 1.150.058	€ 2.700.884	€ 3.182.867

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	
Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
€ 187.714	€ 187.453	€ 686.589	€ 739.079	€ 149.088	€ 133.203	€ 363.617	€ 359.007
0	10.189	0	0	10.100	10.121	39.577	34.027
1.900	168	9.600	62.900	0	0	5.800	6.767
2.053	1.692	2.798	5.908	299	265	1.693	3.095
282	9.251	796	2.436	1.018	20.473	887	786
2.693	3.062	2.770	266	858	570	3.865	3.362
510	960	4.564	4.843	1.640	1.321	1.571	1.251
209	7	0	0	3.502	0	2.300	1.408
3.067	43.373	3.407	0	0	0	174	81.579
0	1	546	44.259	4.457	0	1.401	1.440
603	0	295	219	0	0	225	0
0	0	0	0	0	0	0	0
199.031	256.156	711.365	859.910	170.962	165.953	421.110	492.722
(2.787)	(407)	(5.257)	(3.904)	(582)	(48)	(5.998)	(3.725)
0	0	0	0	0	0	0	0
(998)	(5.637)	(2.585)	(42.651)	(3.957)	(3.374)	(1.410)	(1.772)
(3.064)	(64.278)	(3.395)	0	0	0	(174)	(133.809)
0	0	(424)	(691)	0	0	(1.464)	(10)
(70)	(66)	(176)	(269)	0	0	(116)	(98)
0	(2.169)	0	(1.58)	0	0	(1.467)	(1.020)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	(748)	0	0	(253)	(20)	0	(1.054)
(120)	(390)	0	(3.274)	0	(450)	(235)	(485)
0	0	0	0	0	0	0	0
(7.039)	(73.695)	(11.837)	(52.372)	(4.792)	(3.892)	(10.864)	(141.973)
€ 191.992	€ 182.461	€ 699.528	€ 807.538	€ 166.170	€ 162.061	€ 410.246	€ 350.749

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global Advantage Fund		Global Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 611.360	\$ 766.011	\$ 16.276.256	\$ 23.548.213
Investmentfonds	8.842	19.995	1.220.926	1.349.256
Pensionsgeschäfte	0	1.298	0	19.238
Finanzderivate	9.408	18.435	400.877	394.868
Zahlungsmittel	4.542	2.132	39.635	27.106
Einlagen bei Kontrahenten	12.395	7.959	300.625	223.417
Forderungen aus Einkünften	3.158	3.290	84.204	95.785
Forderungen aus verkauften Anlagen	9.058	8.457	282.611	270.079
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	112.582	445.605	2.484.303	10.837.484
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	65	80	30.067	55.993
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	1.810	1.094	0	0
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	773.220	1.274.356	21.119.504	36.821.439
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(16.428)	(10.701)	(421.975)	(266.336)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(18.210)	(44.384)	(373.373)	(1.765.552)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(12.285)	(15.685)	(395.886)	(400.814)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(157.783)	(609.061)	(3.999.448)	(16.129.756)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(178)	(157)	(13.138)	(63.436)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(312)	(314)	(7.605)	(8.526)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(36.756)	(47.469)	(1.032.521)	(1.587.112)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(12.745)	(12.495)	(46.114)	(88.111)
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(38)	(78)	(174)	(235)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(1.393)	(1.477)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	(21.510)	(48.386)
Einlagen von Kontrahenten	(2.820)	(9.728)	(107.134)	(159.389)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(257.555)	(750.072)	(6.420.271)	(20.519.130)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 515.665	\$ 524.284	\$ 14.699.233	\$ 16.302.309

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund		PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		Global High Yield Bond Fund	
Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
\$ 1.760.612	\$ 2.052.641	\$ 1.110.631	\$ 1.449.661	\$ 418.034	\$ 421.912	\$ 4.934.118	\$ 4.866.996
6.577	6.629	59.123	5.862	319.240	230.921	481.359	471.018
22.400	50.741	0	1.069	0	981	0	0
37.147	46.890	18.372	15.382	19.189	27.605	47.652	100.388
9.018	3.492	5.330	3.511	27.083	8.681	5.618	1.821
40.227	18.942	16.749	23.267	56.195	39.252	45.333	27.005
9.349	7.646	6.608	6.879	2.339	2.020	62.583	62.695
31.402	34.716	16.753	15.641	388	2.218	5.942	51
245.010	943.062	252.291	751.400	17.903	209	0	0
1.582	4.649	375	533	9.057	408	19.878	19.078
1.087	0	4.571	2.330	0	0	616	0
0	15	0	0	0	0	0	0
2.164.411	3.169.423	1.490.803	2.275.535	869.428	734.207	5.603.099	5.549.052
(57.779)	(22.497)	(14.710)	(22.358)	(33.774)	(8.356)	(92.372)	(30.292)
(36.419)	(123.927)	(78.180)	(101.358)	(17.738)	0	0	0
(46.996)	(44.562)	(27.251)	(23.116)	(3.644)	(519)	(24.973)	(7.951)
(367.114)	(1.403.943)	(261.636)	(1.040.528)	(309)	(313)	0	0
(1.744)	(1.925)	(33)	(722)	(6.048)	(608)	(15.734)	(11.462)
(708)	(642)	(440)	(420)	(839)	(764)	(3.178)	(3.087)
0	(25.562)	(84.471)	(145.327)	0	0	(19.639)	(7.478)
0	(5.461)	0	(7.510)	0	0	0	0
(5)	(5)	(10)	(13)	(3)	(3)	(43)	(155)
0	0	0	0	0	0	0	0
(305)	(231)	0	0	(59)	(55)	(7.329)	(8.379)
0	(2.111)	0	0	(5.436)	(7.733)	0	(2.781)
(6.250)	(28.963)	(10.010)	(4.203)	(3.895)	(13.426)	(18.184)	(73.924)
0	0	0	0	0	0	0	0
(517.320)	(1.659.829)	(476.741)	(1.345.555)	(71.745)	(31.777)	(181.452)	(145.509)
\$ 1.647.091	\$ 1.509.594	\$ 1.014.062	\$ 929.980	\$ 797.683	\$ 702.430	\$ 5.421.647	\$ 5.403.543

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund	
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 20.321.585	\$ 27.439.093	\$ 639.632	\$ 366.476
Investmentfonds	1.275.100	2.719.020	0	0
Pensionsgeschäfte	0	30.802	0	111
Finanzderivate	299.214	491.396	7.671	5.472
Zahlungsmittel	83.608	75.541	2.662	637
Einlagen bei Kontrahenten	556.215	357.452	12.424	3.488
Forderungen aus Einkünften	178.105	218.831	3.351	1.896
Forderungen aus verkauften Anlagen	6.248	997	2.247	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	861.550	1.194.059	0	21.087
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	40.736	37.411	1.716	1.578
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	0	949	926
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	23.622.361	32.564.602	670.652	401.671
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(432.658)	(180.805)	(16.864)	(3.824)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(17.435)	(13.586)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(11.906)	(19.302)	(15.274)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(1.559.728)	(3.623.792)	0	(42.892)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(24.470)	(34.066)	(845)	(95)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(11.026)	(14.489)	(265)	(157)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(29.606)	(69.409)	(28.142)	(1.276)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	(66.740)	(5.776)	(18.658)
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(740)	(1.009)	(35)	(18)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(25.053)	(33.718)	(295)	(50)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(9.171)	(15.140)	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(141.907)	(314.376)	(840)	(2.683)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	(19)	(8)
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(2.263.700)	(4.386.432)	(68.355)	(69.661)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 21.358.661	\$ 28.178.170	\$ 602.297	\$ 332.010

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Global Libor Plus Bond Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund		Income Fund	
Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
\$ 2.721.691	\$ 2.936.209	\$ 1.246.640	\$ 1.119.289	\$ 4.141.660	\$ 3.634.557	\$ 78.764.927	\$ 94.258.066
323.381	113.341	20.062	41.757	88.189	43.486	2.928.341	2.527.206
227.500	20.967	0	1.551	0	906	2.219.187	14.587
35.234	65.981	19.070	19.143	74.981	46.975	1.959.616	2.511.526
20.262	4.753	4.207	4.568	9.453	5.835	138.196	74.966
30.116	27.726	22.779	9.522	51.481	29.865	1.659.288	1.445.737
13.662	11.305	2.305	2.037	6.516	5.620	412.830	459.399
1.048	29	72	73	419	389	96.123	82.733
309.884	554.369	55.454	179.347	174.690	432.340	13.308.475	24.805.267
5.036	604	3.418	2.475	55.070	11.313	151.540	182.247
22.897	25.254	2.136	0	12.493	1.557	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
3.710.711	3.760.538	1.376.143	1.379.762	4.614.952	4.212.843	101.638.523	126.361.734
(107.886)	(44.595)	(34.334)	(13.857)	(91.692)	(50.731)	(1.304.772)	(603.512)
(29.338)	0	0	(1.840)	0	0	(575.584)	(318.991)
(56.053)	(33.093)	0	0	(76.995)	0	(397.509)	(234.747)
(280.705)	(990.426)	(103.591)	(284.186)	(344.218)	(784.177)	(25.999.680)	(43.288.331)
(518)	(171)	(490)	(691)	(1.559)	(2.544)	(95.758)	(105.878)
(1.311)	(1.045)	(503)	(374)	(1.617)	(1.388)	(54.953)	(56.071)
(1.142)	0	0	0	(771.271)	(769.368)	(62.965)	(8.273.723)
0	0	(178.774)	(279.761)	(65.760)	(1.770)	0	(44.153)
(4)	(4)	(1)	(1)	(63)	(58)	(4.604)	(5.749)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.908)	(1.905)	(915)	(68)	(4.202)	0	(1.925)	(1.786)
0	0	0	(768)	0	0	(958.133)	(952.576)
(14.230)	(44.698)	(3.457)	(10.345)	(31.805)	(24.745)	(300.106)	(1.200.906)
0	0	0	0	0	0	0	0
(493.095)	(1.115.937)	(322.065)	(591.891)	(1.389.182)	(1.634.781)	(29.755.989)	(55.086.423)
\$ 3.217.616	\$ 2.644.601	\$ 1.054.078	\$ 787.871	\$ 3.225.770	\$ 2.578.062	\$ 71.882.534	\$ 71.275.311

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Erträge Fund II ⁽²⁾		Inflation Strategy Fund	
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 24.859	\$ 96.818	\$ 94.181	
Investmentfonds	2.400	8.464	5.897	
Pensionsgeschäfte	0	0	571	
Finanzderivate	148	2.427	3.413	
Zahlungsmittel	479	1.016	310	
Einlagen bei Kontrahenten	86	1.301	1.439	
Forderungen aus Einkünften	116	170	177	
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	32	42	
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	2.461	6.193	32.011	
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	0	424	67	
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	296	0	
Sonstige Aktiva	0	0	0	
Summe Aktiva	30.549	117.141	138.108	
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(49)	(1.888)	(1.791)	
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(248)	(2)	(60)	
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(4.918)	(10.612)	(48.931)	
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	0	(159)	(3)	
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(12)	(92)	(64)	
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	(4.212)	(15.360)	
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	0	
Überziehungskredit	0	0	0	
Zu zahlende Dividende	0	0	0	
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(3)	0	(1.807)	
Einlagen von Kontrahenten	0	(850)	(60)	
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(5.230)	(17.815)	(68.076)	
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 25.319	\$ 99.326	\$ 70.032	

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

⁽²⁾ Der Income Fund II wurde am 29. Januar 2021 aufgelegt.

Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
\$ 970.481	\$ 1.204.487	\$ 688.631	\$ 623.281	\$ 1.266.296	\$ 1.264.313	\$ 86.764	\$ 79.241
108.580	116.497	75.038	43.112	63.473	93.313	8.027	325
105.100	8.275	8.200	2.680	0	27.569	0	0
4.635	4.387	6.199	13.218	16.481	27.557	1.968	320
3.211	965	1.760	1.177	10.610	1.381	562	835
5.992	6.360	16.045	3.285	38.114	26.639	450	440
2.745	3.128	4.474	4.255	5.877	5.384	44	30
2	1	4.138	1	1.159	130	0	685
359.116	738.561	32.125	67.252	356.444	658.051	0	0
855	966	261	3.184	10.567	17	244	43
4.628	315	1.177	491	3.547	8.392	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
1.565.345	2.083.942	838.048	761.936	1.772.568	2.112.746	98.059	81.919
(7.612)	(6.199)	(20.279)	(4.578)	(43.890)	(20.924)	(2.237)	(3.448)
(133.991)	(236.203)	(1.411)	(2.489)	0	0	0	0
(3.483)	(5.827)	(3.007)	0	(16.687)	(326)	0	(170)
(302.266)	(647.980)	(49.661)	(111.999)	(629.313)	(1.102.965)	0	0
(1.005)	(717)	(477)	(414)	(52)	0	(45)	(597)
(477)	(550)	(324)	(275)	(493)	(445)	(79)	(70)
0	0	(3.184)	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(16)	(18)	0	(1)	0	(15)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(10)	(33)	0	0	(409)	0	(2)	(3)
0	0	0	0	0	0	0	0
(3.336)	(3.002)	(400)	(9.661)	(6.186)	(27.408)	0	0
0	0	0	0	(24)	(24)	0	0
(452.196)	(900.529)	(78.743)	(129.417)	(697.054)	(1.152.107)	(2.363)	(4.288)
\$ 1.113.149	\$ 1.183.413	\$ 759.305	\$ 632.519	\$ 1.075.514	\$ 960.639	\$ 95.696	\$ 77.631

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund	
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 3.757.741	\$ 3.629.137	\$ 1.710.044	\$ 2.725.827
Investmentfonds	4.809	94.493	278.166	317.877
Pensionsgeschäfte	0	1.590	996.500	928.169
Finanzderivate	45.942	48.504	136.067	180.556
Zahlungsmittel	2.343	1.548	10.103	1.225
Einlagen bei Kontrahenten	43.503	13.408	98.815	87.471
Forderungen aus Einkünften	7.057	4.294	3.711	4.322
Forderungen aus verkauften Anlagen	1.541	7.237	40	71.942
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	2.254.307	3.436.975	6.701	286.520
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	619	310	19.409	13.695
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	950	0	0
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	6.117.862	7.238.446	3.259.556	4.617.604
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(44.230)	(27.245)	(47.557)	(20.180)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(392.358)	(199.988)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(67.507)	(62.712)	(12.919)	(400.000)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(3.060.329)	(4.928.820)	(6.701)	(431.918)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(40.214)	(232)	(1.368)	(14.921)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(1.111)	(884)	(1.516)	(1.727)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(85.751)	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	(2.224)	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(19)	(25)	(6)	(6)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(49)	(32)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(20.597)	0	(7.347)	(23.258)
Einlagen von Kontrahenten	(17.960)	(39.277)	(87.427)	(186.761)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(3.730.125)	(5.261.439)	(164.841)	(1.078.771)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 2.387.737	\$ 1.977.007	\$ 3.094.715	\$ 3.538.833

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
\$ 6.619	\$ 5.839	\$ 997.912	\$ 1.262.487	\$ 5.904.364	\$ 6.926.141	\$ 61.823	\$ 26.952
1.004	804	871	4.768	425.266	625.562	7.376	3.877
2.900	3.039	0	528	0	136.163	0	13.645
789	145	12.571	32.307	86.646	75.731	4.122	5.012
209	112	4.718	4.985	12.870	9.305	1.574	363
205	55	31.823	11.904	97.137	72.128	6.107	1.327
20	16	5.222	5.803	27.247	28.989	24	24
0	598	2.496	401	0	1	0	0
748	1.553	266.213	387.767	1.685.738	2.976.253	0	0
0	0	3.382	1.235	3.419	10.639	129	0
26	20	6.622	11.635	0	3.403	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
12.520	12.181	1.331.830	1.723.820	8.242.687	10.864.315	81.155	51.200
(90)	(83)	(36.594)	(23.836)	(83.307)	(53.882)	(4.875)	(2.093)
0	0	(11.171)	0	(170.889)	(34.311)	0	0
0	0	(724)	(203)	0	(88.180)	0	(31)
(1.498)	(3.072)	(446.208)	(643.263)	(2.376.281)	(4.196.335)	0	0
0	(97)	(19.658)	(1.594)	(7.833)	(13.981)	0	(12)
(6)	(5)	(844)	(995)	(3.505)	(4.233)	(90)	(53)
0	0	(36.555)	(52.542)	(163.054)	0	0	0
0	0	(1.834)	(2.866)	(7.840)	0	0	0
0	0	(8)	(26)	(241)	(309)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	(203)	(199)	0	0
0	0	0	0	(2.432)	0	(427)	(650)
(440)	(507)	(2.756)	(23.830)	(32.133)	(48.832)	(310)	(1.140)
(1)	0	(1)	(1)	0	0	0	0
(2.035)	(3.764)	(556.353)	(749.156)	(2.847.718)	(4.440.262)	(5.702)	(3.979)
\$ 10.485	\$ 8.417	\$ 775.477	\$ 974.664	\$ 5.394.969	\$ 6.424.053	\$ 75.453	\$ 47.221

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	£ 546.953	£ 712.455	£ 403.266	£ 409.471
Investmentfonds	38.518	38.188	1.153	6.808
Pensionsgeschäfte	11.700	46.150	0	5.260
Finanzderivate	1.846	4.631	3.674	3.448
Zahlungsmittel	3.072	2.811	4.110	2.121
Einlagen bei Kontrahenten	9.155	11.310	10.545	8.610
Forderungen aus Einkünften	5.441	7.478	4.467	4.029
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	49	2	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	8.199	316	19	15
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	885	2.853	0	0
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	625.769	826.241	427.236	439.762
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(3.685)	(3.041)	(1.427)	(410)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(162)	(2.038)	0	(892)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(158)	(257)	(57)	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(181)	(256)	(155)	(138)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(33.647)	(50.468)	(10.799)	(70.444)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	(1)	0	(2)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(1.785)	(3.105)	(73)	(117)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	(3.066)	(694)
Einlagen von Kontrahenten	0	(2.716)	0	(2.434)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(39.618)	(61.882)	(15.577)	(75.131)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	£ 586.151	£ 764.359	£ 411.659	£ 364.631

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

* Die Summe der Gesellschaft zum 30. Juni 2021 und zum 31. Dezember 2020 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

** Bei der Berechnung der Summe der Gesellschaft zum 30. Juni 2020 wurde die Schließung folgender Fonds nicht berücksichtigt: Global Advantage Real Return Fund, PIMCO RAE Emerging Markets Fund, PIMCO RAE Europe Fund, PIMCO RAE Global Developed Fund, PIMCO RAE US Fund, PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund, PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund, PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund, PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund.

US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*	
Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020**
\$ 3.883.310	\$ 3.573.957	\$ 1.134.015	\$ 1.261.305	\$ 2.842.679	\$ 3.068.243	\$ 218.473.017	\$ 248.527.843
300.356	393.709	7.272	13.289	314.037	378.292	11.390.550	12.955.358
0	30.800	0	2.887	0	213.234	5.189.764	2.654.737
10.635	27.563	5.964	21.022	11.878	11.282	4.156.822	5.431.804
0	420	2.561	1.487	9.507	2.444	897.411	441.352
31.577	23.823	32.989	9.334	17.288	26.464	4.587.964	3.568.575
58.534	51.464	9.949	10.309	8.001	8.452	1.456.429	1.517.743
5.575	1.597	223	49	1.069	984	746.009	696.948
0	0	32.618	141.154	0	0	23.608.236	53.588.291
27.606	20.430	545	2.704	29.986	5.501	611.999	602.922
0	0	656	1.077	7.075	5.236	155.578	143.032
27	123	0	0	0	0	61	198
4.317.620	4.123.886	1.226.792	1.464.617	3.241.520	3.720.132	271.273.840	330.128.803
(26.467)	(2.025)	(25.528)	(2.552)	(18.039)	(16.685)	(4.238.512)	(2.091.263)
0	0	(1.713)	0	0	0	(1.893.487)	(2.843.148)
(17.740)	(16.243)	(4.384)	(2.422)	(10.842)	(35.639)	(1.874.821)	(1.718.585)
0	0	(47.847)	(213.835)	0	0	(40.820.422)	(87.594.280)
(9.941)	(7.824)	(1.044)	(1.382)	(1.863)	(4.409)	(332.011)	(357.237)
(2.247)	(2.184)	(465)	(526)	(925)	(1.174)	(147.787)	(148.207)
(6.926)	(15.262)	(1.155)	0	0	0	(4.481.454)	(14.485.046)
0	0	(72.610)	(42.596)	0	0	(391.453)	(574.683)
(132)	(135)	0	0	(6)	(6)	(8.045)	(9.755)
(2.006)	0	0	0	0	0	(14.697)	(11)
(126)	(108)	(317)	(3.593)	0	0	(63.966)	(71.336)
(3.723)	(2.666)	0	0	0	0	(1.127.022)	(1.221.819)
(32)	(22.512)	(1.702)	(17.563)	(5.133)	(8.034)	(1.125.460)	(3.062.909)
0	0	0	0	0	0	(84)	(47)
(69.340)	(68.959)	(156.765)	(284.469)	(36.808)	(65.947)	(56.519.221)	(114.178.326)
\$ 4.248.280	\$ 4.054.927	\$ 1.070.027	\$ 1.180.148	\$ 3.204.712	\$ 3.654.185	\$ 214.754.619	\$ 215.950.477

Betriebsergebnisrechnung

(Angaben in Tausend)

	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	\$ 45.674	\$ 8.700	\$ 4.587	\$ 806
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	3.529	(7.977)	(127)	10
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	7.804	(85)	1.142	458
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	112	(23)	(20)	(16)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(36.785)	(12.465)	(1.969)	(432)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(15.595)	(1.779)	(2.777)	(20)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	19	3	(48)	(2)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	4.758	(13.626)	788	804
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(4.565)	(408)	(586)	(296)
Servicegebühr	(352)	0	0	0
Bestandspflegegebühr	(102)	(15)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(8)	(7)	0	0
Gesamtaufwendungen	(5.027)	(430)	(586)	(296)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	9	9	2	2
Betriebskosten, netto	(5.018)	(421)	(584)	(294)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(260)	(14.047)	204	510
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(18)	(2)	0	0
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(13.228)	(1.387)	(2.084)	(527)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	1.068	29	487	4
Summe Finanzierungskosten	(12.178)	(1.360)	(1.597)	(523)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	(12.438)	(15.407)	(1.393)	(13)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(249)	(10)	(35)	(1)
Kapitalertragsteuer	1	(2)	1	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	(12.686)	(15.419)	(1.427)	(14)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (12.686)	\$ (15.419)	\$ (1.427)	\$ (14)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

⁽¹⁾ Der PIMCO Climate Bond Fund wurde am 23. September 2020 aufgelegt.

PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund ⁽¹⁾		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 168.147	\$ 156.354	\$ 1.278	\$ 12.565	\$ 1.304	\$ 2.675	\$ 3.024	
0	5	0	0	0	132	0	
119.227	(96.338)	(119)	780	5.328	2.599	(3.395)	
58.604	(63.249)	3.334	114.952	(114.198)	2.494	2.572	
(52.013)	76.382	370	(643)	(255)	(61)	(51)	
(91.010)	(490.304)	(1.409)	(9.132)	(1.312)	(3.423)	(4.090)	
27.039	5.862	(5.970)	(1.598)	2.954	(4.350)	(2.852)	
39.247	(1.657)	(17)	43	(49)	15	(10)	
269.241	(412.945)	(2.533)	116.967	(106.228)	81	(4.802)	
(40.540)	(34.326)	(537)	(3.334)	(1.988)	(749)	(785)	
(1.003)	(789)	0	(52)	(12)	0	0	
(869)	(864)	0	0	0	0	0	
(195)	(198)	0	0	0	0	0	
(42.607)	(36.177)	(537)	(3.386)	(2.000)	(749)	(785)	
1.069	1.206	0	0	18	1	1	
(41.538)	(34.971)	(537)	(3.386)	(1.982)	(748)	(784)	
227.703	(447.916)	(3.070)	113.581	(108.210)	(667)	(5.586)	
(1.475)	(8.439)	(10)	(40)	(880)	(54)	(7)	
0	0	0	0	0	0	0	
(37.414)	(33.929)	(287)	0	0	0	0	
1.118	(2.998)	(99)	0	0	0	0	
(37.771)	(45.366)	(396)	(40)	(880)	(54)	(7)	
189.932	(493.282)	(3.466)	113.541	(109.090)	(721)	(5.593)	
(759)	0	0	0	0	(1)	(9)	
0	0	0	0	0	0	0	
189.173	(493.282)	(3.466)	113.541	(109.090)	(722)	(5.602)	
\$ 189.173	\$ (493.282)	\$ (3.466)	\$ 113.541	\$ (109.090)	\$ (722)	\$ (5.602)	

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	\$ 286.530	\$ 223.474	\$ 24.851	\$ 22.392
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	59.790	9.520	10.369	3.811
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	246.964	(32.154)	71.327	(67.619)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(72.892)	51.844	(3.250)	(283)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(263.854)	(344.341)	(21.982)	(44.642)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(373.043)	(112.013)	(44.798)	(46.227)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	4.434	(89)	109	(93)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(112.071)	(203.759)	36.626	(132.661)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(98.701)	(71.816)	(6.820)	(5.614)
Servicegebühr	(347)	(158)	(24)	(11)
Bestandspflegegebühr	(730)	(435)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(317)	(231)	0	(1)
Gesamtaufwendungen	(100.095)	(72.640)	(6.844)	(5.626)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	1.665	529	136	82
Betriebskosten, netto	(98.430)	(72.111)	(6.708)	(5.544)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(210.501)	(275.870)	29.918	(138.205)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(73)	(7.382)	(8)	(8)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(100.440)	(88.181)	(6.792)	(4.627)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	631	1.341	(52)	824
Summe Finanzierungskosten	(99.882)	(94.222)	(6.852)	(3.811)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	(310.383)	(370.092)	23.066	(142.016)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(77)	(84)	(4)	(6)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	(310.460)	(370.176)	23.062	(142.022)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (310.460)	\$ (370.176)	\$ 23.062	\$ (142.022)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund		Emerging Markets Bond Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 47.516	\$ 50.492	€ 23.272	€ 6.507	\$ 80.289	\$ 86.330	\$ 123.773	\$ 94.686
0	0	0	0	0	36	4	11
36.309	79.987	269.469	29.330	(45.520)	(102.719)	6.964	(64.874)
90.559	(96.059)	(71.633)	21.435	54.898	(97.197)	14.801	33.979
(3.018)	(5.475)	20.306	7.732	7.724	(33.932)	(3.045)	(857)
(66.453)	(32.031)	12.437	46.413	(120.316)	(176.129)	(141.930)	(200.910)
(82.895)	(112.007)	(83.963)	(21.805)	(84.992)	(2.769)	(97.346)	(28.609)
173	47	(17)	677	18.706	21.409	(13)	(456)
22.191	(115.046)	169.871	90.289	(89.211)	(304.971)	(96.792)	(167.030)
(16.589)	(16.149)	(43.532)	(10.490)	(13.834)	(11.910)	(23.256)	(16.885)
(112)	(116)	(15)	0	(54)	(29)	(21)	(18)
(123)	(108)	0	0	0	0	(89)	(73)
0	(2)	(195)	(17)	(2)	(1)	(3)	(2)
(16.824)	(16.375)	(43.742)	(10.507)	(13.890)	(11.940)	(23.369)	(16.978)
234	233	631	108	36	28	0	0
(16.590)	(16.142)	(43.111)	(10.399)	(13.854)	(11.912)	(23.369)	(16.978)
5.601	(131.188)	126.760	79.890	(103.065)	(316.883)	(120.161)	(184.008)
(55)	(243)	(2.316)	(112)	(4.278)	(7.508)	(501)	(1.669)
0	0	0	0	0	0	0	0
(4.719)	(4.886)	(4.590)	(680)	(11.100)	(16.931)	(30.550)	(29.364)
174	(125)	(164)	(265)	(105)	(3.244)	2.129	(2.553)
(4.600)	(5.254)	(7.070)	(1.057)	(15.483)	(27.683)	(28.922)	(33.586)
1.001	(136.442)	119.690	78.833	(118.548)	(344.566)	(149.083)	(217.594)
(7)	7	(2.362)	(1.050)	(963)	(329)	(615)	(50)
0	0	0	0	468	84	(502)	0
994	(136.435)	117.328	77.783	(119.043)	(344.811)	(150.200)	(217.644)
\$ 994	\$ (136.435)	€ 117.328	€ 77.783	\$ (119.043)	\$ (344.811)	\$ (150.200)	\$ (217.644)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	\$ 42.313	\$ 16.959	\$ 5.298	\$ 5.442
Sonstige Erträge	0	0	5	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	4.109	212	(30.385)	(4.141)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	7.710	9.716	2.477	1.322
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(885)	(562)	(198)	(51)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(38.583)	(32.989)	28.742	(9.961)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(51.470)	(874)	(10.266)	(761)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(379)	(201)	(9)	(25)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(37.185)	(7.739)	(4.336)	(8.175)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(8.449)	(3.308)	(1.541)	(1.417)
Servicegebühr	(4)	(4)	0	0
Bestandspflegegebühr	(3)	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	0	0	0
Gesamtaufwendungen	(8.457)	(3.312)	(1.541)	(1.417)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(8.457)	(3.312)	(1.541)	(1.417)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(45.642)	(11.051)	(5.877)	(9.592)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(307)	(463)	(4)	(19)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(8.981)	(3.285)	0	(1)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	3.754	0	0	0
Summe Finanzierungskosten	(5.534)	(3.748)	(4)	(20)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	(51.176)	(14.799)	(5.881)	(9.612)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(175)	(10)	(4)	(7)
Kapitalertragsteuer	0	0	(23)	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	(51.351)	(14.809)	(5.908)	(9.619)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (51.351)	\$ (14.809)	\$ (5.908)	\$ (9.619)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund	Euro Bond Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Berichtszeitraum vom 29. April 2021 bis 30. Juni 2021	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 5.278	\$ 3.454	\$ 400	\$ 1.589	\$ 11	€ 13.192	€ 11.854
1	0	0	0	0	0	0
1.513	(70)	(310)	(2.252)	3	10.915	659
5.845	322	193	(2.562)	3	(29.778)	9.916
282	(1.086)	26	122	0	13.318	2.177
(4.923)	(6.033)	(340)	(2.585)	(16)	(33.261)	1.639
(12.528)	4.061	(346)	(1.063)	(3)	(27.907)	20.178
293	(75)	27	(9)	(1)	(15.638)	5.462
(4.239)	573	(350)	(6.760)	(3)	(69.159)	51.885
(1.216)	(683)	(235)	(467)	(6)	(8.274)	(7.880)
0	0	0	0	0	(53)	(55)
0	0	0	0	0	(10)	(13)
(7)	(4)	0	0	0	(2)	(2)
(1.223)	(687)	(235)	(467)	(6)	(8.339)	(7.950)
1	3	3	4	0	490	310
(1.222)	(684)	(232)	(463)	(6)	(7.849)	(7.640)
(5.461)	(111)	(582)	(7.223)	(9)	(77.008)	44.245
(41)	(179)	(7)	(6)	0	(215)	(40)
0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	(6)	(634)	(1.022)
0	0	0	0	0	(162)	18
(41)	(179)	(7)	(6)	(6)	(1.011)	(1.044)
(5.502)	(290)	(589)	(7.229)	(15)	(78.019)	43.201
(108)	(6)	(16)	(6)	0	170	(9)
(64)	(2)	0	(1)	0	0	0
(5.674)	(298)	(605)	(7.236)	(15)	(77.849)	43.192
\$ (5.674)	\$ (298)	\$ (605)	\$ (7.236)	\$ (15)	€ (77.849)	€ 43.192

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	€ 7.617	€ 7.931	€ 30.337	€ 32.708
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	1.127	3.648	20.234	7.400
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(14.455)	(7.584)	11.305	(24.428)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	1.333	2.487	14.210	7.728
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	1.009	(17.645)	(1.217)	(74.862)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(5.163)	(699)	(41.439)	(48.480)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	1.606	545	(16.922)	9.639
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(6.926)	(11.317)	16.508	(90.295)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(2.550)	(2.200)	(15.512)	(17.180)
Servicegebühr	0	0	(45)	(39)
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)	(113)	(114)
Gesamtaufwendungen	(2.551)	(2.201)	(15.670)	(17.333)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	57	53	13	412
Betriebskosten, netto	(2.494)	(2.148)	(15.657)	(16.921)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(9.420)	(13.465)	851	(107.216)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(27)	(70)	(56)	(180)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(879)	(868)	(9.423)	(11.184)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	55	133	(103)	(203)
Summe Finanzierungskosten	(851)	(805)	(9.582)	(11.567)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	(10.271)	(14.270)	(8.731)	(118.783)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(1)	0	3	(24)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	(10.272)	(14.270)	(8.728)	(118.807)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	€ (10.272)	€ (14.270)	€ (8.728)	€ (118.807)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Berichtszeitraum vom 31. Jan. 2020 bis 30. Juni 2020	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
€ 736	€ 718	€ 1.201	€ 859	€ 2.821	€ 1.353	€ 1.781	€ 1.042
0	0	0	0	0	0	3	0
815	3.573	(2.145)	1.141	2.223	(2.415)	(478)	(3.533)
(3.968)	1.262	(884)	(812)	(605)	946	2.722	(1.988)
565	(126)	785	432	68	(97)	882	(726)
(10.855)	2.309	6.557	(5.956)	554	(4.123)	(2.607)	(1.494)
(1.797)	1.839	(4.286)	(98)	(521)	359	(2.514)	73
(773)	213	207	(2)	(1)	(3)	(1.473)	1.109
(15.277)	9.788	1.435	(4.436)	4.539	(3.980)	(1.684)	(5.517)
(400)	(385)	(1.485)	(2.006)	(15)	(10)	(715)	(610)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(400)	(385)	(1.485)	(2.006)	(15)	(10)	(715)	(610)
8	11	0	0	18	12	63	16
(392)	(374)	(1.485)	(2.006)	3	2	(652)	(594)
(15.669)	9.414	(50)	(6.442)	4.542	(3.978)	(2.336)	(6.111)
(6)	(3)	(103)	(106)	(28)	(14)	(28)	(24)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(6)	(3)	(103)	(106)	(28)	(14)	(28)	(24)
(15.675)	9.411	(153)	(6.548)	4.514	(3.992)	(2.364)	(6.135)
0	0	(1)	0	0	0	0	1
0	0	0	0	0	0	0	0
(15.675)	9.411	(154)	(6.548)	4.514	(3.992)	(2.364)	(6.134)
€ (15.675)	€ 9.411	€ (154)	€ (6.548)	€ 4.514	€ (3.992)	€ (2.364)	€ (6.134)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

	Global Advantage Fund		Global Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
(Angaben in Tausend)				
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	\$ 7.020	\$ 6.564	\$ 159.037	\$ 160.640
Sonstige Erträge	0	0	138	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	5.172	3.527	55.387	116.151
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	6.643	(7.900)	48.141	19.573
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	517	1.564	(33.641)	50.739
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(21.685)	(4.474)	(563.019)	(33.729)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(14.224)	(1.874)	(138.555)	36.681
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	1.122	595	22.841	(11.622)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(15.435)	(1.998)	(449.671)	338.433
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(1.853)	(1.610)	(49.997)	(45.470)
Servicegebühr	0	0	(1.010)	(1.002)
Bestandspflegegebühr	0	0	(55)	(27)
Sonstige Aufwendungen	0	0	(118)	(93)
Gesamtaufwendungen	(1.853)	(1.610)	(51.180)	(46.592)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	1.653	1.631
Betriebskosten, netto	(1.853)	(1.610)	(49.527)	(44.961)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(17.288)	(3.608)	(499.198)	293.472
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(23)	(253)	(604)	(3.532)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(1.569)	(1.520)	(16.667)	(17.659)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	2	(247)	(345)
Summe Finanzierungskosten	(1.592)	(1.771)	(17.518)	(21.536)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	(18.880)	(5.379)	(516.716)	271.936
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(12)	(17)	719	(1.254)
Kapitalertragsteuer	24	(1)	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	(18.868)	(5.397)	(515.997)	270.682
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (18.868)	\$ (5.397)	\$ (515.997)	\$ 270.682

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund		PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		Global High Yield Bond Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 11.983	\$ 8.739	\$ 10.878	\$ 15.078	\$ 5.772	\$ 6.726	\$ 119.533	\$ 98.770
0	0	1	27	83	0	0	0
1.163	7.217	5.789	11.380	(238)	(2.605)	30.344	(53.941)
39.864	(11.803)	(670)	(4.683)	65.239	(9.650)	122.898	(73.915)
(3.981)	(509)	(3.218)	2.272	(31)	(2.498)	(12.250)	(4.473)
(50.080)	2.283	(42.646)	(8.467)	3.494	(11.902)	(65.508)	(165.516)
(44.505)	(7.944)	11.489	(2.653)	(33.979)	(2.930)	(115.236)	(26.787)
885	45	5.631	(1.459)	484	(242)	(348)	143
(44.671)	(1.972)	(12.746)	11.495	40.824	(23.101)	79.433	(225.719)
(4.039)	(2.179)	(2.634)	(2.924)	(4.883)	(4.392)	(19.494)	(15.297)
(28)	(2)	(33)	(30)	(16)	(14)	(26)	(25)
(5)	0	(28)	(24)	0	0	(211)	(169)
(1)	0	0	(1)	0	(1)	(24)	(24)
(4.073)	(2.181)	(2.695)	(2.979)	(4.899)	(4.407)	(19.755)	(15.515)
0	0	1	1	102	143	0	156
(4.073)	(2.181)	(2.694)	(2.978)	(4.797)	(4.264)	(19.755)	(15.359)
(48.744)	(4.153)	(15.440)	8.517	36.027	(27.365)	59.678	(241.078)
(18)	(87)	(42)	(2.953)	(12)	(99)	(27)	(123)
0	0	0	0	0	0	(519)	(362)
(2.446)	(2.259)	(1.037)	(1.370)	(1.378)	(1.027)	(34.864)	(31.722)
91	69	49	40	132	(16.968)	216	(820)
(2.373)	(2.277)	(1.030)	(4.283)	(1.258)	(18.094)	(35.194)	(33.027)
(51.117)	(6.430)	(16.470)	4.234	34.769	(45.459)	24.484	(274.105)
19	(26)	30	30	191	(296)	0	(11)
0	0	0	0	1	4	0	0
(51.098)	(6.456)	(16.440)	4.264	34.961	(45.751)	24.484	(274.116)
\$ (51.098)	\$ (6.456)	\$ (16.440)	\$ 4.264	\$ 34.961	\$ (45.751)	\$ 24.484	\$ (274.116)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	\$ 341.145	\$ 363.443	\$ 4.461	\$ 1.409
Sonstige Erträge	1.286	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	313.264	108.551	252	576
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	289.660	(480.000)	6.199	1.711
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(83.508)	43.917	(760)	(32)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(853.421)	(92.661)	(11.252)	3.299
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(470.920)	(73.477)	(10.636)	(1.245)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	6.327	(2.439)	(47)	(5)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(456.167)	(132.666)	(11.783)	5.713
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(73.848)	(66.970)	(1.264)	(275)
Servicegebühr	(2.939)	(2.853)	0	0
Bestandspflegegebühr	(1.598)	(1.200)	(141)	(1)
Sonstige Aufwendungen	(148)	(122)	(11)	(3)
Gesamtaufwendungen	(78.533)	(71.145)	(1.416)	(279)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	456	454	0	0
Betriebskosten, netto	(78.077)	(70.691)	(1.416)	(279)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(534.244)	(203.357)	(13.199)	5.434
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(558)	(10.802)	(10)	(8)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(102.007)	(113.347)	(1.327)	(300)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(9.501)	6.157	288	62
Summe Finanzierungskosten	(112.066)	(117.992)	(1.049)	(246)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	(646.310)	(321.349)	(14.248)	5.188
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(318)	(157)	(26)	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	(646.628)	(321.506)	(14.274)	5.188
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (646.628)	\$ (321.506)	\$ (14.274)	\$ 5.188

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Global Libor Plus Bond Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund		Income Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 23.377	\$ 20.814	\$ 17.764	\$ 957	\$ 46.705	\$ 2.234	\$ 1.204.329	\$ 1.336.359
0	0	0	14	0	0	1.104	0
(11.483)	37.770	10.394	10.055	41.584	16.352	149.327	782.132
162.597	(103.211)	16.616	(11.320)	7.256	(13.112)	1.548.693	(1.766.338)
(2.961)	(718)	(1.702)	(242)	(4.620)	8.793	(106.384)	66.390
(36.082)	(9.661)	(23.594)	(1.838)	(121.195)	60.802	(956.195)	(1.623.449)
(93.813)	(65.230)	(20.105)	(7.846)	(11.581)	18.144	(1.267.092)	(1.567.154)
227	(257)	(65)	1.219	(153)	1.874	46.030	(22.981)
41.862	(120.493)	(692)	(9.001)	(42.004)	95.087	619.812	(2.795.041)
(7.139)	(4.642)	(2.635)	(2.263)	(9.223)	(5.993)	(327.323)	(321.800)
(24)	(23)	(7)	(8)	(213)	(103)	(9.265)	(8.608)
0	0	0	0	(150)	(147)	(15.721)	(16.853)
(2)	(1)	0	0	(1)	(1)	(2.239)	(2.166)
(7.165)	(4.666)	(2.642)	(2.271)	(9.587)	(6.244)	(354.548)	(349.427)
108	108	0	0	0	0	512	510
(7.057)	(4.558)	(2.642)	(2.271)	(9.587)	(6.244)	(354.036)	(348.917)
34.805	(125.051)	(3.334)	(11.272)	(51.591)	88.843	265.776	(3.143.958)
(20)	(139)	(117)	(1.303)	(317)	(2.604)	(5.404)	(66.838)
0	0	0	0	0	0	0	0
(4.297)	(3.630)	(1.875)	(279)	(7.941)	0	(675.984)	(676.957)
450	(14)	216	134	(532)	29	4.510	(6.881)
(3.867)	(3.783)	(1.776)	(1.448)	(8.790)	(2.575)	(676.878)	(750.676)
30.938	(128.834)	(5.110)	(12.720)	(60.381)	86.268	(411.102)	(3.894.634)
(2)	3	0	0	15	0	4.713	(6.349)
0	0	0	0	0	0	0	304
30.936	(128.831)	(5.110)	(12.720)	(60.366)	86.268	(406.389)	(3.900.679)
\$ 30.936	\$ (128.831)	\$ (5.110)	\$ (12.720)	\$ (60.366)	\$ 86.268	\$ (406.389)	\$ (3.900.679)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Erträge	Inflation	
	Fund II	Strategy Fund	
	Berichtszeitraum vom 29. Jan. 2021 bis 30. Juni 2021	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge			
Zins- und Dividenderträge	\$ 216	\$ 1.399	\$ 434
Sonstige Erträge	0	1	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(2)	826	1.079
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	29	5.888	(3.260)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	3	(17)	(78)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	43	270	(1.863)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	99	(1.018)	(689)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	0	(7)	(4)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	388	7.342	(4.381)
Betriebskosten			
Verwaltungsgebühr	(60)	(433)	(350)
Servicegebühr	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	0
Gesamtaufwendungen	(60)	(433)	(350)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0
Betriebskosten, netto	(60)	(433)	(350)
Anlageerträge/(-verluste), netto	328	6.909	(4.731)
Finanzierungskosten			
Zinsaufwendungen	0	(6)	(97)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(5)	(22)	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(1)	4	1
Summe Finanzierungskosten	(6)	(24)	(96)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	322	6.885	(4.827)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	(74)	(68)
Kapitalertragsteuer	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	322	6.811	(4.895)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ 322	\$ 6.811	\$ (4.895)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 5.792	\$ 13.251	\$ 6.431	\$ 6.187	\$ 13.521	\$ 7.624	\$ 769	\$ 1.687
1	0	37	0	2	0	0	0
(1.849)	3.738	5.550	(982)	42	1.718	1.325	(22.461)
3.068	3.812	10.349	(1.921)	25.900	4.014	17.962	(34.733)
903	(221)	(1.150)	(855)	2.326	(431)	(9)	382
(7.932)	(7.718)	(11.783)	(876)	(13.302)	(2.111)	7.205	(5.892)
(1.147)	837	(22.641)	(4.657)	(34.459)	(16.617)	2.859	(9.833)
27	(68)	65	3	117	(2)	(5)	(6)
(1.137)	13.631	(13.142)	(3.101)	(5.853)	(5.805)	30.106	(70.856)
(3.255)	(2.845)	(1.731)	(1.351)	(2.794)	(1.548)	(412)	(678)
(66)	(68)	0	0	0	0	(2)	(7)
(36)	(39)	0	0	0	0	0	0
(1)	(1)	0	0	(1)	(5)	0	0
(3.358)	(2.953)	(1.731)	(1.351)	(2.795)	(1.553)	(414)	(685)
85	104	0	0	0	0	0	0
(3.273)	(2.849)	(1.731)	(1.351)	(2.795)	(1.553)	(414)	(685)
(4.410)	10.782	(14.873)	(4.452)	(8.648)	(7.358)	29.692	(71.541)
(1)	(432)	(16)	(49)	(13)	(26)	(1)	(7)
0	0	0	0	0	0	0	0
(202)	(937)	0	0	(2.240)	(37)	(1.214)	(2.667)
(7)	48	11	0	65	2	(53)	(267)
(210)	(1.321)	(5)	(49)	(2.188)	(61)	(1.268)	(2.941)
(4.620)	9.461	(14.878)	(4.501)	(10.836)	(7.419)	28.424	(74.482)
0	(32)	0	(4)	(14)	0	(139)	(201)
0	0	0	0	0	0	0	0
(4.620)	9.429	(14.878)	(4.505)	(10.850)	(7.419)	28.285	(74.683)
\$ (4.620)	\$ 9.429	\$ (14.878)	\$ (4.505)	\$ (10.850)	\$ (7.419)	\$ 28.285	\$ (74.683)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividenerträge	\$ 29.779	\$ 30.772	\$ 10.303	\$ 25.602
Sonstige Erträge	0	0	1	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(10.448)	43.400	4.308	9.867
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	26.993	(60.228)	514.734	(327.885)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(529)	253	(193)	(1.167)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(8.902)	(23.360)	(16.190)	8.246
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(15.679)	(3.246)	(71.518)	66.613
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	168	(11)	114	23
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	21.382	(12.420)	441.559	(218.701)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(6.432)	(4.857)	(9.435)	(8.753)
Servicegebühr	(117)	(60)	(33)	(8)
Bestandspflegegebühr	(1)	(2)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)	(6)	(4)
Gesamtaufwendungen	(6.551)	(4.920)	(9.474)	(8.765)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(6.551)	(4.920)	(9.474)	(8.765)
Anlageerträge/(-verluste), netto	14.831	(17.340)	432.085	(227.466)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(22)	(1.640)	(81)	(198)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(5.818)	(4.494)	0	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	94	282	32	1
Summe Finanzierungskosten	(5.746)	(5.852)	(49)	(197)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	9.085	(23.192)	432.036	(227.663)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	0	0	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	9.085	(23.192)	432.036	(227.663)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ 9.085	\$ (23.192)	\$ 432.036	\$ (227.663)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 46	\$ 55	\$ 18.219	\$ 18.566	\$ 61.603	\$ 72.692	\$ 103	\$ 212
0	0	142	0	3	0	2	0
42	93	41.846	(47.137)	8.198	124.091	(11)	(28)
712	(591)	12.063	5.238	(18.769)	69.523	4.457	905
12	(3)	57	(1.206)	(5.284)	3.385	(248)	113
(98)	(56)	(10.028)	(25.974)	(164.099)	30.068	(9)	(92)
638	266	(32.438)	(29.306)	(18.460)	6.813	(3.707)	(700)
0	0	757	(149)	(294)	914	36	(15)
1.352	(236)	30.618	(79.968)	(137.102)	307.486	623	395
(32)	(21)	(5.382)	(6.166)	(23.351)	(21.032)	(485)	(214)
0	0	0	0	(1.128)	(987)	0	0
0	0	0	0	(461)	(469)	0	0
0	0	(58)	(67)	(35)	(20)	0	0
(32)	(21)	(5.440)	(6.233)	(24.975)	(22.508)	(485)	(214)
1	1	0	0	575	573	4	4
(31)	(20)	(5.440)	(6.233)	(24.400)	(21.935)	(481)	(210)
1.321	(256)	25.178	(86.201)	(161.502)	285.551	142	185
(1)	0	(90)	(95)	(19)	(2.456)	(16)	(10)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(2.849)	(2.673)	(7.237)	(8.359)	0	0
0	0	(38)	(59)	(148)	39	0	0
(1)	0	(2.977)	(2.827)	(7.404)	(10.776)	(16)	(10)
1.320	(256)	22.201	(89.028)	(168.906)	274.775	126	175
0	0	(945)	(1.132)	(44)	(162)	0	0
0	0	0	2	0	0	0	0
1.320	(256)	21.256	(90.158)	(168.950)	274.613	126	175
\$ 1.320	\$ (256)	\$ 21.256	\$ (90.158)	\$ (168.950)	\$ 274.613	\$ 126	\$ 175

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividenerträge	£ 7.095	£ 7.665	£ 5.119	£ 6.276
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	8.302	1.283	6.666	17.562
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	6.115	(9.783)	1.247	(6.783)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(890)	1.211	(521)	508
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(34.806)	15.335	(24.327)	(5.768)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(3.725)	(7.508)	(919)	(8.076)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	56	108	156	84
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(17.853)	8.311	(12.579)	3.803
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(1.332)	(1.140)	(848)	(830)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	0	0
Gesamtaufwendungen	(1.332)	(1.140)	(848)	(830)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	67	85	3	7
Betriebskosten, netto	(1.265)	(1.055)	(845)	(823)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(19.118)	7.256	(13.424)	2.980
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(28)	(104)	(21)	(417)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(3.782)	(4.339)	(682)	(866)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(270)	6	(10)	(383)
Summe Finanzierungskosten	(4.080)	(4.437)	(713)	(1.666)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	(23.198)	2.819	(14.137)	1.314
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	12	(1)	(2)	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	(23.186)	2.818	(14.139)	1.314
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	£ (23.186)	£ 2.818	£ (14.139)	£ 1.314

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2021 und zum 30. Juni 2020 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

** Bei der Berechnung der Summe der Gesellschaft zum 30. Juni 2020 wurde die Schließung folgender Fonds nicht berücksichtigt: Global Advantage Real Return Fund, PIMCO RAE Emerging Markets Fund, PIMCO RAE Europe Fund, PIMCO RAE Global Developed Fund, PIMCO RAE US Fund, PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund, PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund, PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund, PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund

US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum**
\$ 99.900	\$ 78.764	\$ 17.261	\$ 14.610	\$ 16.020	\$ 26.303	\$ 3.182.457	\$ 3.076.923
51	0	18	0	1	0	3.017	101
(614)	(39.899)	6.487	10.146	11.962	17.503	1.220.849	998.462
32.665	(29.599)	31.188	(28.708)	(4.846)	(10.710)	3.539.566	(3.320.000)
(1.053)	727	(442)	(2.649)	24	1.053	(325.592)	273.895
31.716	(155.106)	(36.580)	26.291	(18.959)	(18.428)	(3.887.387)	(3.479.142)
(41.544)	(14.249)	(38.247)	(11.260)	(683)	14.579	(3.456.429)	(2.075.185)
(93)	15	204	(38)	664	(294)	107.803	3.763
121.028	(159.347)	(20.111)	8.392	4.183	30.006	384.284	(4.521.183)
(13.405)	(9.252)	(2.806)	(2.345)	(6.289)	(4.300)	(891.959)	(751.565)
(722)	(342)	0	0	(39)	(65)	(17.773)	(15.446)
0	0	0	0	0	0	(20.335)	(20.440)
(3)	(1)	(1)	0	(2)	(1)	(3.560)	(3.106)
(14.130)	(9.595)	(2.807)	(2.345)	(6.330)	(4.366)	(933.627)	(790.557)
0	0	0	0	564	66	8.857	6.997
(14.130)	(9.595)	(2.807)	(2.345)	(5.766)	(4.300)	(924.770)	(783.560)
106.898	(168.942)	(22.918)	6.047	(1.583)	25.706	(540.486)	(5.304.743)
(28)	(105)	(35)	(147)	(2)	(1.212)	(17.771)	(123.288)
(332)	(257)	0	0	0	0	(851)	(619)
(15.601)	(13.904)	(8.828)	(8.472)	(5.005)	(7.254)	(1.124.319)	(1.096.827)
695	(753)	(213)	407	(127)	135	4.252	(26.245)
(15.266)	(15.019)	(9.076)	(8.212)	(5.134)	(8.331)	(1.138.689)	(1.246.979)
91.632	(183.961)	(31.994)	(2.165)	(6.717)	17.375	(1.679.175)	(6.551.722)
0	1	(27)	1	14	(68)	(1.539)	(11.942)
0	0	0	0	0	0	(94)	599
91.632	(183.960)	(32.021)	(2.164)	(6.703)	17.307	(1.680.808)	(6.563.065)
\$ 91.632	\$ (183.960)	\$ (32.021)	\$ (2.164)	\$ (6.703)	\$ 17.307	\$ (1.680.808)	\$ (6.563.065)

Ausweis der Nettovermögensänderungen

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund		PIMCO Capital Securities Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	\$ 890.928	\$ 226.380	\$ 167.716	\$ 38.513	\$ 7.958.322	\$ 7.944.483
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	1.451.271	211.742	155.799	8.048	2.941.670	2.164.580
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	578	247	23	6	4.337	3.313
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(250.866)	(69.786)	(12.469)	(5.301)	(1.925.097)	(2.766.038)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(12.686)	(15.419)	(1.427)	(14)	189.173	(493.282)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	\$ 2.079.225	\$ 353.164	\$ 309.642	\$ 41.252	\$ 9.168.405	\$ 6.853.056

(Angaben in Tausend)	Diversified Income Duration Hedged Fund		Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	\$ 1.486.931	\$ 1.269.937	\$ 3.204.860	\$ 3.888.271	€ 5.128.926	€ 1.604.773
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	335.303	433.209	938.505	288.697	3.391.097	1.270.157
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	12	62	972	1.149	40	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(183.600)	(188.030)	(364.526)	(998.413)	(1.204.111)	(753.411)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	23.062	(142.022)	994	(136.435)	117.328	77.783
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	\$ 1.661.708	\$ 1.373.156	\$ 3.780.805	\$ 3.043.269	€ 7.433.280	€ 2.199.302

(Angaben in Tausend)	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Berichtszeitraum vom 29. April 2021 bis 30. Juni 2021	
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	\$ 220.309	\$ 155.506	\$ 32.571	\$ 74.289	\$ 0	
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	126.441	28.279	17.779	30.707	6.403	
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	0	5	
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(7.765)	(11.584)	(18.903)	(17.949)	(229)	
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(5.674)	(298)	(605)	(7.236)	(15)	
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	\$ 333.311	\$ 171.903	\$ 30.842	\$ 79.811	\$ 6.614	

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

⁽¹⁾ Der PIMCO Climate Bond Fund wurde am 23. September 2020 aufgelegt.

PIMCO Climate Bond Fund ⁽¹⁾		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		Diversified Income Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 101.869		\$ 325.109	\$ 564.401	\$ 144.512	\$ 149.347	\$ 18.641.861	\$ 12.274.587
164.292		859.368	106.390	14.740	24.097	3.721.772	5.589.722
0		0	0	0	0	10.036	6.771
(2.490)		(154.348)	(222.042)	(12.854)	(28.388)	(3.404.391)	(3.126.640)
0		0	0	0	0	0	0
(3.466)		113.541	(109.090)	(722)	(5.602)	(310.460)	(370.176)
\$ 260.205		\$ 1.143.670	\$ 339.659	\$ 145.676	\$ 139.454	\$ 18.658.818	\$ 14.374.264
Emerging Local Bond Fund		Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 2.849.284	\$ 2.772.000	\$ 5.263.015	\$ 4.001.722	\$ 1.441.457	\$ 724.120	\$ 261.236	\$ 224.432
859.332	967.879	1.619.483	1.841.072	1.379.091	271.928	35.909	90.019
876	1.672	2.212	3.820	18	5	0	0
(822.114)	(1.360.454)	(1.568.000)	(1.940.693)	(389.049)	(95.270)	(48.455)	(82.114)
0	0	0	0	0	0	0	0
119.043)	(344.811)	(150.200)	(217.644)	(51.351)	(14.809)	(5.908)	(9.619)
\$ 2.768.335	\$ 2.036.286	\$ 5.166.510	\$ 3.688.277	\$ 2.380.166	\$ 885.974	\$ 242.782	\$ 222.718
Euro Bond Fund		Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
€ 3.243.455	€ 3.013.450	€ 1.150.058	€ 961.445	€ 3.182.867	€ 3.165.112	€ 182.461	€ 162.478
381.251	488.312	234.135	466.338	355.269	765.527	36.974	37.923
0	0	245	69	924	797	0	0
(751.156)	(581.188)	(342.314)	(345.081)	(829.448)	(621.656)	(11.768)	(48.839)
0	0	0	0	0	0	0	0
(77.849)	43.192	(10.272)	(14.270)	(8.728)	(118.807)	(15.675)	9.411
€ 2.795.701	€ 2.963.766	€ 1.031.852	€ 1.068.501	€ 2.700.884	€ 3.190.973	€ 191.992	€ 160.973

Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Berichtszeitraum vom 31. Jan. 2020 bis 30. Juni 2020	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	€ 807.538	€ 710.026	€ 162.061	€ 0	€ 350.749	€ 353.235
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	109.378	504.422	4.517	150.125	152.859	119.248
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	0	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(217.234)	(539.408)	(4.922)	0	(90.998)	(176.921)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(154)	(6.548)	4.514	(3.992)	(2.364)	(6.134)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	€ 699.528	€ 668.492	€ 166.170	€ 146.133	€ 410.246	€ 289.428

(Angaben in Tausend)	PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		Global High Yield Bond Fund		Global Investment Grade Credit Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	\$ 702.430	\$ 814.354	\$ 5.403.543	\$ 4.341.308	\$ 28.178.170	\$ 21.938.396
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	142.029	37.282	1.913.884	2.494.283	4.508.571	10.906.241
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	5	1.754	1.435	6.280	6.921
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(81.743)	(249.284)	(1.922.018)	(1.604.149)	(10.687.732)	(8.023.789)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	34.961	(45.751)	24.484	(274.116)	(646.628)	(321.506)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	\$ 797.683	\$ 556.606	\$ 5.421.647	\$ 4.958.761	\$ 21.358.661	\$ 24.506.263

(Angaben in Tausend)	Income Fund		Income Fund II	Inflation Strategy Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Berichtszeitraum vom 29. Jan. 2021 bis 30. Juni 2021	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	\$ 71.275.311	\$ 81.080.459	\$ 0	\$ 70.032	\$ 70.015
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	17.722.603	22.541.981	24.992	30.022	3.069
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	45.438	43.382	5	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(16.754.429)	(35.475.351)	0	(7.539)	(4.447)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(406.389)	(3.900.679)	322	6.811	(4.895)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	\$ 71.882.534	\$ 64.289.792	\$ 25.319	\$ 99.326	\$ 63.742

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

Advantage Fund		Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 524.284	\$ 467.498	\$ 16.302.309	\$ 15.000.575	\$ 1.509.594	\$ 762.434	\$ 929.980	\$ 1.092.298
42.044	36.875	2.275.964	3.339.270	471.804	435.448	222.021	87.686
0	1.519	1.269	4.483	1.118	629	457	991
(31.795)	(53.137)	(3.364.312)	(3.483.840)	(284.327)	(122.453)	(121.956)	(287.472)
0	0	0	0	0	0	0	0
(18.868)	(5.397)	(515.997)	270.682	(51.098)	(6.456)	(16.440)	4.264
\$ 515.665	\$ 447.358	\$ 14.699.233	\$ 15.131.170	\$ 1.647.091	\$ 1.069.602	\$ 1.014.062	\$ 897.767
Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Libor Plus Bond Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 332.010	\$ 83.800	\$ 2.644.601	\$ 2.011.215	\$ 787.871	\$ 997.469	\$ 2.578.062	\$ 1.831.308
386.733	86.435	994.421	193.447	432.470	177.850	1.280.265	588.434
247	1	333	175	2	0	1.272	0
(102.419)	(10.969)	(452.675)	(188.395)	(161.155)	(455.460)	(573.463)	(772.952)
0	0	0	0	0	0	0	0
(14.274)	5.188	30.936	(128.831)	(5.110)	(12.720)	(60.366)	86.268
\$ 602.297	\$ 164.455	\$ 3.217.616	\$ 1.887.611	\$ 1.054.078	\$ 707.139	\$ 3.225.770	\$ 1.733.058
Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 1.183.413	\$ 1.189.920	\$ 632.519	\$ 510.334	\$ 960.639	\$ 478.805	\$ 77.631	\$ 238.171
391.155	558.485	199.858	188.381	355.275	361.435	17.848	29.744
44	105	0	0	13	8	1	4
(456.843)	(692.231)	(58.194)	(82.640)	(229.563)	(15.723)	(28.069)	(96.905)
0	0	0	0	0	0	0	0
(4.620)	9.429	(14.878)	(4.505)	(10.850)	(7.419)	28.285	(74.683)
\$ 1.113.149	\$ 1.065.708	\$ 759.305	\$ 611.570	\$ 1.075.514	\$ 817.106	\$ 95.696	\$ 96.331

Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	\$ 1.977.007	\$ 1.675.111	\$ 3.538.833	\$ 3.009.851	\$ 8.417	\$ 5.977
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	821.900	728.948	1.197.570	1.670.462	777	1.103
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.096	1.320	0	0	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(422.351)	(496.368)	(2.073.724)	(1.327.265)	(29)	(54)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	9.085	(23.192)	432.036	(227.663)	1.320	(256)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	\$ 2.387.737	\$ 1.885.819	\$ 3.094.715	\$ 3.125.385	\$ 10.485	\$ 6.770

(Angaben in Tausend)	UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	£ 364.631	£ 406.944	\$ 4.054.927	\$ 2.798.116	\$ 1.180.148	\$ 796.420
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	100.391	25.253	1.372.068	1.717.443	256.184	630.755
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	507	616	3.609	3.946	6.738	5.828
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(39.731)	(101.787)	(1.273.956)	(1.071.205)	(341.022)	(173.208)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(14.139)	1.314	91.632	(183.960)	(32.021)	(2.164)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	£ 411.659	£ 332.340	\$ 4.248.280	\$ 3.264.340	\$ 1.070.027	\$ 1.257.631

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2021 und zum 30. Juni 2020 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

** Bei der Berechnung der Summe der Gesellschaft zum 30. Juni 2020 wurde die Schließung folgender Fonds nicht berücksichtigt: Global Advantage Real Return Fund, PIMCO RAE Emerging Markets Fund, PIMCO RAE Europe Fund, PIMCO RAE Global Developed Fund, PIMCO RAE US Fund, PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund, PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund, PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund, PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund

Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund	
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
\$ 974.664	\$ 1.169.920	\$ 6.424.053	\$ 5.139.388	\$ 47.221	\$ 25.717	£ 764.359	£ 557.068
93.992	65.036	626.294	1.216.479	32.740	14.122	98.367	218.980
6	4	3.923	4.482	0	0	14	33
(314.441)	(174.235)	(1.490.351)	(1.006.066)	(4.634)	(15.737)	(253.403)	(52.653)
0	0	0	0	0	0	0	0
21.256	(90.158)	(168.950)	274.613	126	175	(23.186)	2.818
\$ 775.477	\$ 970.567	\$ 5.394.969	\$ 5.628.896	\$ 75.453	\$ 24.277	£ 586.151	£ 726.246
US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*					
Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum**				
\$ 3.654.185	\$ 2.361.042	\$ 215.950.477	\$ 195.657.520				
628.091	1.636.090	56.904.066	65.715.682				
4.666	7.133	100.526	101.188				
(1.075.527)	(1.244.290)	(55.984.002)	(71.429.297)				
0	0	(535.640)	(67.556)				
(6.703)	17.307	(1.680.808)	(6.563.065)				
\$ 3.204.712	\$ 2.777.282	\$ 214.754.619	\$ 183.414.472				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
Huarong Finance Co. Ltd. 1,275 % fällig am 24.02.2023	\$ 3.600	\$ 2.692	0,13	ITALIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Oman Sovereign Sukuk Co. 4,875 % fällig am 15.06.2030	\$ 5.100	\$ 5.241	0,25	
2,031 % fällig am 27.04.2022	8.300	6.806	0,33	UniCredit SpA 7,500 % fällig am 03.06.2026 (e)(g) €	3.100	\$ 4.369	0,21	Summe Oman		19.935	0,96	
2,125 % fällig am 30.09.2023	5.100	3.889	0,19	JAPAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				PAKISTAN STAATSEMISSIONEN				
2,500 % fällig am 24.02.2023	5.500	4.250	0,20	Asahi Mutual Life Insurance Co. 4,100 % fällig am 27.01.2031 (e) \$	10.500	10.728	0,51	Pakistan Government International Bond				
2,875 % fällig am 14.09.2021 (e)	3.800	3.090	0,15	6,500 % fällig am 05.09.2023 (e)	900	972	0,05	6,000 % fällig am 08.04.2026	17.700	17.966	0,86	
3,250 % fällig am 13.11.2024	1.300	962	0,04	Summe Japan		11.700	0,56	6,875 % fällig am 05.12.2027	17.900	18.641	0,90	
4,500 % fällig am 24.01.2022 (e)	3.800	2.576	0,12	JERSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				8,250 % fällig am 15.04.2024	6.500	7.109	0,34	
Lenovo Group Ltd. 5,875 % fällig am 24.04.2025	29.000	32.846	1,58	West China Cement Ltd. 4,950 % fällig am 08.07.2026 (a)	8.700	8.820	0,42	8,250 % fällig am 30.09.2025	6.300	6.990	0,34	
Yanford Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026	10.200	10.426	0,50	MALAYSIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				8,875 % fällig am 08.04.2051	4.600	4.894	0,23	
6,800 % fällig am 27.02.2024	8.500	8.946	0,43	Cerah Capital Ltd. 0,000 % fällig am 08.08.2024 (c)	10.400	10.377	0,50	Summe Pakistan		55.600	2,67	
Summe Hongkong		132.954	6,39	MAURITIUS UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				PHILIPPINEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
		133.749	6,43	Dua Capital Ltd. 2,780 % fällig am 11.05.2031	8.400	8.376	0,40	Globe Telecom, Inc. 3,000 % fällig am 23.07.2035	15.850	14.664	0,70	
INDIEN WANDELANLEIHEN & WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				JGSH Philippines Ltd. 4,125 % fällig am 09.07.2030	3.230	3.478	0,17	
Bharti Airtel Ltd. 1,500 % fällig am 17.02.2025	7.700	8.958	0,43	Petronas Capital Ltd. 3,404 % fällig am 28.04.2061	11.500	11.820	0,57	Jollibee Worldwide Pte. Ltd. 3,900 % fällig am 23.01.2025 (e)	400	399	0,02	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,750 % fällig am 24.06.2030	3.300	3.509	0,17	
Adani Green Energy UP Ltd. 6,250 % fällig am 10.12.2024	3.800	4.217	0,20	Summe Malaysia		30.573	1,47	Megaworld Corp. 4,125 % fällig am 30.07.2027	6.799	7.296	0,35	
JSW Steel Ltd. 5,250 % fällig am 13.04.2022	1.300	1.333	0,06	MAURITIUS UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Royal Capital BV 4,875 % fällig am 05.05.2024 (e)	3.571	3.733	0,18	
Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023	3.500	3.610	0,17	Azure Power Energy Ltd. 5,500 % fällig am 03.11.2022	6.195	6.296	0,30	5,000 % fällig am 05.02.2026 (e)	900	956	0,04	
6,125 % fällig am 31.10.2022	9.333	9.704	0,47	Azure Power Solar Energy Pvt Ltd. 5,650 % fällig am 24.12.2024 (i)	7.060	7.507	0,36	5,875 % fällig am 05.05.2022 (e)	1.140	1.181	0,06	
Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	5.100	5.543	0,27	Greenko Dutch BV 3,850 % fällig am 29.03.2026	3.200	3.282	0,16	SMC Global Power Holdings Corp. 5,450 % fällig am 09.12.2026 (e)	4.700	4.702	0,23	
ReNew Power Pvt Ltd. 4,500 % fällig am 14.07.2028	4.400	4.484	0,21	Greenko Investment Co. 4,875 % fällig am 16.08.2023	5.600	5.695	0,27	6,500 % fällig am 25.04.2024 (e)	1.800	1.851	0,09	
6,450 % fällig am 27.09.2022	10.550	10.919	0,52	Greenko Mauritius Ltd. 6,250 % fällig am 21.02.2023	1.820	1.879	0,09	7,000 % fällig am 21.10.2025 (e)	6.190	6.560	0,31	
ReNew Power Synthetic 6,670 % fällig am 12.03.2024	2.900	3.051	0,15	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026	4.900	5.289	0,26	Summe Philippinen		60.791	2,92	
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 4,400 % fällig am 13.03.2024	1.000	1.005	0,05	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	21.150	22.158	1,07	STAATSEMISSIONEN				
4,400 % fällig am 27.02.2022	17.000	17.217	0,83	India Green Power Holdings 4,000 % fällig am 22.02.2027	2.500	2.514	0,12	Philippines Government International Bond 3,200 % fällig am 06.07.2046 (a)	12.400	12.462	0,60	
5,950 % fällig am 24.10.2022	16.385	16.788	0,81	Summe Mauritius		54.620	2,63	Summe Philippinen		60.791	2,92	
TML Holdings Pte. Ltd. 5,500 % fällig am 03.06.2024	9.100	9.488	0,46	MONGOLEI STAATSEMISSIONEN				Singapore Airlines Ltd. 1,625 % fällig am 03.12.2025	SGD 1.500	1.236	0,06	
Summe Indien		87.359	4,20	Summe Mongolei		18.757	0,90	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
INDONESIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Adaro Indonesia PT 4,250 % fällig am 31.10.2024	2.250	2.327	0,11	Dufry One BV 2,000 % fällig am 15.02.2027	€ 8.500	9.526	0,46	ABJA Investment Co. Pte. Ltd. 4,450 % fällig am 24.07.2023	\$ 300	309	0,02	
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3,750 % fällig am 30.03.2026 (g)	24.400	24.895	1,20	Prosus NV 3,832 % fällig am 08.02.2051	\$ 10.000	9.342	0,45	5,450 % fällig am 24.01.2028	17.600	18.967	0,91	
Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7,750 % fällig am 10.02.2026	7.200	7.380	0,35	Summe Niederlande		18.868	0,91	Alam Synergy Pte. Ltd. 6,625 % fällig am 24.04.2022	2.300	2.221	0,11	
Gajah Tunggal Tbk PT 8,950 % fällig am 23.06.2026	5.200	5.138	0,25	OMAN STAATSEMISSIONEN				Eterna Capital Pte. Ltd. (8,000 % bar oder 8,000 % PIK) 8,000 % fällig am 11.12.2022 (b)	1.402	638	0,03	
LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % fällig am 04.02.2039	730	849	0,04	Oman Government International Bond 7,000 % fällig am 25.01.2051	14.400	14.694	0,71	Global Prime Capital Pte. Ltd. 5,950 % fällig am 23.01.2025	4.300	4.489	0,22	
Medco Oak Tree Pte. Ltd. 7,375 % fällig am 14.05.2026	1.700	1.863	0,09	NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Indika Energy Capital Pte. Ltd. 5,875 % fällig am 09.11.2024	10.100	10.248	0,49	
Pakuwon Jati Tbk PT 4,875 % fällig am 29.04.2028	17.400	18.212	0,88	Dufry One BV 2,000 % fällig am 15.02.2027	€ 8.500	9.526	0,46	8,250 % fällig am 22.10.2025	4.350	4.633	0,22	
Summe Indonesien		60.664	2,92	Prosus NV 3,832 % fällig am 08.02.2051	\$ 10.000	9.342	0,45	LMIRT Capital Pte. Ltd. 7,250 % fällig am 19.06.2024	4.200	4.379	0,21	
STAATSEMISSIONEN				Summe Niederlande		18.868	0,91	7,500 % fällig am 09.02.2026	10.600	10.985	0,53	
Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.09.2026	IDR 359.534.000	27.886	1,34	OMAN STAATSEMISSIONEN				Medco Bell Pte. Ltd. 6,375 % fällig am 30.01.2027	1.300	1.343	0,06	
Summe Indonesien		88.550	4,26	Oman Government International Bond 7,000 % fällig am 25.01.2051	14.400	14.694	0,71	TML Holdings Pte. Ltd. 4,350 % fällig am 09.06.2026	9.600	9.668	0,47	
ISRAEL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Oman		19.935	0,96	Summe Niederlande		67.880	3,27	
Energear Israel Finance Ltd. 4,875 % fällig am 30.03.2026	\$ 4.200	4.312	0,21	PAKISTAN STAATSEMISSIONEN				Summe Singapur		69.116	3,33	
				Pakistan Government International Bond				SÜDAFRIKA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				6,000 % fällig am 08.04.2026				Absa Group Ltd. 6,375 % fällig am 27.05.2026 (e)(g)	4.800	4.915	0,24	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SÜDKOREA				USA				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				COMMERCIAL PAPER			
KDB Life Insurance Co. Ltd.				Standard Chartered PLC				Scenery Journey Ltd.			
7,500 % fällig am 21.05.2023 (e)	\$ 1.000	\$ 1.023	0,05	6,000 % fällig am 26.07.2025 (e)(g)	\$ 7.900	\$ 8.680	0,42	11,500 % fällig am 24.10.2022	\$ 23.700	\$ 19.256	0,93
Tongyang Life Insurance Co. Ltd.				Vedanta Resources Finance PLC				12,000 % fällig am 24.10.2023	2.300	1.780	0,09
5,250 % fällig am 22.09.2025 (e)	4.200	4.449	0,21	8,950 % fällig am 11.03.2025	25.450	19.104	0,92	13,000 % fällig am 06.11.2022	7.800	6.416	0,31
Summe Südkorea		5.472	0,26	Summe Großbritannien		83.547	4,02	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.			
								6,750 % fällig am 24.04.2033	7.182	8.182	0,39
SRI LANKA				US-SCHATZobligationen				STUDIO CITY FINANCE LTD.			
STAATSEMISSIONEN				US-SCHATZobligationen				COMMERCIAL PAPER			
Sri Lanka Government International Bond				U.S. Treasury Notes				5,000 % fällig am 15.01.2029	8.600	8.695	0,42
5,750 % fällig am 18.04.2023	6.150	4.605	0,22	2,500 % fällig am 15.02.2022	1.000	1.015	0,05	6,000 % fällig am 15.07.2025	1.300	1.369	0,07
5,875 % fällig am 25.07.2022	6.600	5.610	0,27	Summe USA		10.135	0,49	6,500 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.369	0,26
6,200 % fällig am 11.05.2027	31.800	19.710	0,95					Summe Jungferninseln (Britisch)		189.205	9,10
6,750 % fällig am 18.04.2028	7.000	4.405	0,21					Summe Jungferninseln (Britisch)		197.043	9,48
6,850 % fällig am 14.03.2024	5.000	3.487	0,17					KURZFRISTIGE SCHULDITITEL			
6,850 % fällig am 03.11.2025	10.800	7.263	0,35					COMMERCIAL PAPER			
7,550 % fällig am 28.03.2030	11.150	7.058	0,34					Sunac China Holdings Ltd.			
7,850 % fällig am 14.03.2029	3.600	2.304	0,11					5,950 % fällig am 30.12.2021 (h)	9.600	9.607	0,46
Summe Sri Lanka		54.442	2,62					Summe Jungferninseln (Britisch)			
								5,980 % fällig am 13.04.2022	3.000	3.011	0,15
SCHWEIZ				VIETNAM				YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				COMMERCIAL PAPER			
UBS Group AG				Vietnam Debt & Asset Trading Corp.				5,300 % fällig am 11.01.2022	900	887	0,04
5,125 % fällig am 29.07.2026 (e)(g)	4.900	5.344	0,26	1,000 % fällig am 10.10.2025	6.290	5.713	0,28	Zhenro Properties Group Ltd.			
								5,980 % fällig am 13.04.2022	3.000	3.011	0,15
THAILAND				JUNGFERNINSELN (BRITISCH)				U.S. TREASURY BILLS			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				WANDELANLEIHEN & WECHSEL				COMMERCIAL PAPER			
Kasikornbank PCL				Link CB Ltd.				0,022 % fällig am			
5,275 % fällig am 14.10.2025 (e)(g)	4.000	4.246	0,20	1,600 % fällig am 03.04.2024	HKD 60.000	7.838	0,38	03.08.2021 (a)(c)(d)(j)	4.400	4.400	0,21
Krung Thai Bank PCL								0,035 % fällig am			
4,400 % fällig am 25.03.2026 (e)(g)	17.800	18.085	0,87					13.07.2021 (c)(d)(j)	13.300	13.300	0,64
Summe Thailand		22.331	1,07					Summe kurzfristige Instrumente		17.700	0,85
								Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 1.878.760	90,36
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				AKTIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				INVESTMENTFONDS			
DAE Sukuk Dfvc Ltd.				1MDB Global Investments Ltd.				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
3,750 % fällig am 15.02.2026	4.000	4.244	0,20	4,400 % fällig am 09.03.2023	\$ 23.200	23.399	1,12	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)			
				Celestial Miles Ltd.					19.792.770	197.156	9,48
GROSSBRITANNIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				BÖRSENGEHADELTE FONDS			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Barclays PLC				Champion Path Holdings Ltd.				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)			
6,125 % fällig am 15.12.2025 (e)(g)	4.900	5.436	0,26	4,500 % fällig am 27.01.2026	9.658	10.062	0,48		48.700	4.945	0,24
HSBC Holdings PLC				4,850 % fällig am 27.01.2028	2.700	2.829	0,14	Summe Investmentfonds		\$ 202.101	9,72
4,000 % fällig am 09.03.2026 (e)(g)	4.100	4.177	0,20	Easy Tactic Ltd.							
6,000 % fällig am 22.05.2027 (e)(g)	4.100	4.561	0,22	5,875 % fällig am 13.02.2023	9.400	8.507	0,41				
Jaguar Land Rover Automotive PLC				8,125 % fällig am 27.02.2023	9.800	9.188	0,44				
2,200 % fällig am 15.01.2024	€ 3.000	3.557	0,17	9,125 % fällig am 28.07.2022	2.000	1.975	0,09				
4,500 % fällig am 01.10.2027	\$ 2.800	2.764	0,13	11,625 % fällig am 03.09.2024	6.300	5.993	0,29				
Lloyds Banking Group PLC				11,750 % fällig am 02.08.2023	4.000	3.935	0,19				
7,875 % fällig am 27.06.2029 (e)(g) £	1.900	3.355	0,16	12,375 % fällig am 18.11.2022 (i)	6.200	6.309	0,30				
Natwest Group PLC				NWD Finance BVI Ltd.							
8,000 % fällig am 10.08.2025 (e)(g) \$	5.800	6.878	0,33	4,125 % fällig am 10.03.2028 (e)	29.000	29.326	1,41				
				4,800 % fällig am 09.09.2023 (e)	17.000	17.064	0,82				
				6,250 % fällig am 07.03.2024 (e)	4.400	4.648	0,22				
				Peak RE BVI Holding Ltd.							
				5,350 % fällig am 28.10.2025 (e)	5.600	5.936	0,29				
				RKPF Overseas Ltd.							
				6,700 % fällig am 30.09.2024	1.800	1.915	0,09				

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2021	20	\$ (2)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	23	(97)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2021	187	68	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	192	(158)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	166	(810)	(0,04)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	260	(1.787)	(0,08)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (2.786)	(0,13)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Boeing Co.	1,000 %	20.06.2023	\$ 300	\$ 1	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,600 %	16.06.2022	CNY 461.800	\$ 47	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,610	17.03.2022	360.800	74	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		0,750	16.06.2031	\$ 53.500	(682)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,250	12.03.2050	3.700	414	0,02
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,250	15.09.2026	€ 1.700	3	0,00
						\$ (144)	(0,01)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (143)	(0,01)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC USD versus INR	INR 69,000	03.09.2021	2.250	\$ 180	\$ 4	0,00
		69,000	03.12.2021	6.000	330	60	0,00
					\$ 510	\$ 64	0,00

VERKAUFSDERIVATE

DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus INR	INR 81,000	27.04.2022	1.769	\$ (29)	\$ (17)	0,00
JPM	Call - OTC USD versus INR	80,000	27.01.2022	1.769	(24)	(12)	0,00
MYI	Call - OTC USD versus INR	81,500	22.04.2022	4.423	(78)	(38)	0,00
UAG	Call - OTC USD versus INR	81,000	02.05.2022	3.539	(53)	(36)	0,00
					\$ (184)	\$ (103)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	libaba Group Holding Ltd.	(1,000) %	20.06.2026	\$ 27.000	\$ (608)	\$ (5)	\$ (613)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	China Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 27.200	\$ 902	\$ (46)	\$ 856	0,04
	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000	20.06.2026	9.500	(154)	(27)	(181)	(0,01)
	Reliance Industries Ltd.	1,000	20.06.2026	11.600	0	121	121	0,01
BRC	Baidu, Inc.	1,000	20.06.2026	10.400	130	(7)	123	0,01
	BOC Aviation Ltd.	1,000	20.06.2026	24.300	(70)	0	(70)	0,00
	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	1,000	20.06.2026	7.200	(89)	0	(89)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000 %	20.06.2022	\$ 8.000	\$ (30)	\$ 89	\$ 59	0,00
	State Bank of India	1,000	20.06.2026	7.000	19	9	28	0,00
	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.	1,000	20.06.2026	10.400	13	(36)	(23)	0,00
	Vietnam Government International Bond	1,000	20.06.2026	20.100	(29)	(24)	(53)	0,00
	Country Garden Holdings Co. Ltd.	1,000	20.12.2021	4.500	(50)	34	(16)	0,00
	Country Garden Holdings Co. Ltd.	1,000	20.06.2022	8.400	(96)	13	(83)	(0,01)
					\$ 546	\$ 126	\$ 672	0,03

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
SCX	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,650 %	05.03.2025	CNY 18.200	\$ 0	\$ (57)	\$ (57)	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,000	13.02.2025	8.000	0	(9)	(9)	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,250	23.09.2024	7.000	0	3	3	0,00
						\$ 0	\$ (63)	\$ (63)	0,00

TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
DBL	Zahlung	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 7.495	08.09.2021	\$ 0	\$ (42)	\$ (42)	0,00

DEVISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	08.2021	€	\$	26.393	32.087	\$ 759	0,04	
	08.2021	RUB		354	5	0	0,00	
	09.2021	CNY		60.159	9.353	90	0,00	
	09.2021	RUB		984	13	0	0,00	
	09.2021	\$	IDR	570	8.220.256	0	(10)	0,00
	09.2021		INR	6.353	467.759	0	(117)	(0,01)
	12.2021	PHP	\$	510.857	10.569	228	228	0,01
	08.2021	€		1.818	2.166	8	8	0,00
	09.2021	\$	KRW	19.576	21.814.812	0	(276)	(0,01)
	09.2021		MYR	15.096	62.629	0	(64)	0,00
BRC	04.2022		INR	972	76.547	20	20	0,00
	08.2021	€	\$	2.179	2.607	21	21	0,00
CBK	09.2021	HKD		27.850	3.589	2	2	0,00
	07.2021	RUB		329	4	0	0	0,00
	08.2021			437	6	0	0	0,00
GLM	04.2022	\$	INR	277	21.792	5	5	0,00
	07.2021	RUB	\$	661	9	0	(1)	0,00
	08.2021			611	8	0	0	0,00
	09.2021	CNH		48.000	7.457	62	62	0,00
	09.2021	HKD		246.177	31.733	29	29	0,00
HUS	09.2021	RUB		758	10	0	0	0,00
	09.2021	\$	THB	8.867	275.861	0	(262)	(0,01)
	04.2022		INR	78	6.141	1	1	0,00
	07.2021	HKD	\$	300	39	0	0	0,00
	08.2021	£		2.314	3.257	60	60	0,00
	08.2021	¥		52.007	479	10	10	0,00
	08.2021	RUB		857	11	0	0	0,00
	08.2021	\$	€	3.243	2.662	0	(83)	0,00
	09.2021	CNH	\$	14.220	2.213	23	23	0,00
	09.2021	RUB		518	7	0	0	0,00
JPM	08.2021	€		1.100	1.343	37	37	0,00
	12.2021	PHP		429.637	8.900	202	202	0,01
MYI	07.2021	€		1.090	1.298	5	5	0,00
	07.2021	RUB		266	3	0	0	0,00
	07.2021	SGD		95	70	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
SCX	04.2022	INR 87.153	\$ 1.106	\$ 0	\$ (23)	\$ (23)	0,00
	09.2021	THB 276.953	8.803	164	0	164	0,01
	09.2021	\$ 5.038	MYR 20.804	0	(44)	(44)	0,00
UAG	12.2021	SGD 1.622	\$ 1.225	19	0	19	0,00
	07.2021	RUB 1.003	13	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1.745	\$ (881)	\$ 864	0,04

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen fur die ausschuttende Investor AUD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2021	AUD 1.754	\$ 1.321	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	07.2021	\$ 1.439	AUD 1.862	0	(41)	(41)	0,00
	08.2021	1.321	1.754	0	(4)	(4)	0,00
BPS	07.2021	1.015	1.306	0	(35)	(35)	0,00
	07.2021	285	370	0	(7)	(7)	0,00
MYI	07.2021	AUD 745	\$ 563	4	0	4	0,00
	08.2021	\$ 563	AUD 745	0	(4)	(4)	0,00
UAG	07.2021	AUD 1.197	\$ 908	10	0	10	0,00
	07.2021	\$ 1.369	AUD 1.766	0	(43)	(43)	(0,01)
	08.2021	894	1.179	0	(9)	(9)	0,00
				\$ 18	\$ (143)	\$ (125)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen fur die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschuttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2021	\$ 16.285	CHF 14.608	\$ 0	\$ (481)	\$ (481)	(0,02)
	07.2021	33	31	0	0	0	0,00
BPS	07.2021	14.769	\$ 16.043	64	0	64	0,00
	07.2021	\$ 16.156	CHF 14.486	0	(485)	(485)	(0,03)
CBK	07.2021	16.056	14.769	0	(65)	(65)	0,00
	08.2021	57	53	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2021	15.613	14.066	0	(395)	(395)	(0,02)
	07.2021	561	506	0	(14)	(14)	0,00
MYI	07.2021	31	\$ 34	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 460	CHF 413	0	(13)	(13)	0,00
SSB	07.2021	517	469	0	(9)	(9)	0,00
	07.2021	517	469	0	(9)	(9)	0,00
				\$ 65	\$ (1.463)	\$ (1.398)	(0,07)

Zum 30. Juni 2021 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) ausschuttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2021	\$ 2.111	€ 1.752	\$ 0	\$ (34)	\$ (34)	0,00
	07.2021	€ 1.469	\$ 1.751	9	0	9	0,00
BPS	07.2021	\$ 101.549	€ 83.051	0	(3.058)	(3.058)	(0,15)
	07.2021	€ 240	\$ 292	8	0	8	0,00
BRC	07.2021	\$ 109.343	€ 89.379	0	(3.348)	(3.348)	(0,16)
	07.2021	409	338	0	(9)	(9)	0,00
GLM	07.2021	€ 125	\$ 150	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 11.730	€ 9.637	0	(301)	(301)	(0,02)
MYI	07.2021	9.609	8.071	0	(38)	(38)	0,00
	07.2021	115.633	94.523	0	(3.536)	(3.536)	(0,17)
SCX	07.2021	389	319	0	(10)	(10)	0,00
	07.2021	389	319	0	(10)	(10)	0,00
				\$ 19	\$ (10.334)	\$ (10.315)	(0,50)

Zum 30. Juni 2021 standen fur die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
GLM	07.2021	\$ 99	£ 70	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07.2021	1	0	0	0	0	0,00
MYI	07.2021	£ 73	\$ 101	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 98	£ 69	0	(2)	(2)	0,00
SSB	08.2021	101	73	0	0	0	0,00
	07.2021	100	70	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die ausschüttende Investor RMB (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	\$ 1.504	CNH 9.600	\$ 0	\$ (18)	\$ (18)	0,00
	08.2021	1.499	9.717	2	0	2	0,00
GLM	08.2021	1.467	9.508	2	0	2	0,00
HUS	07.2021	1.398	8.916	0	(18)	(18)	0,00
MYI	07.2021	CNH 99	\$ 16	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 1.579	CNH 10.067	0	(21)	(21)	0,00
SCX	07.2021	39	248	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07.2021	CNH 9.507	\$ 1.471	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	\$ 1.467	CNH 9.507	1	0	1	0,00
				\$ 5	\$ (59)	\$ (54)	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Investor SGD (Hedged) ausschüttend, E Class SGD (Hedged) ausschüttend und M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 15.051	\$ 11.210	\$ 13	\$ 0	\$ 13	0,01
	08.2021	\$ 11.209	SGD 15.051	0	(13)	(13)	0,00
BPS	07.2021	10.471	13.853	0	(166)	(166)	(0,01)
GLM	07.2021	364	486	0	(3)	(3)	0,00
	08.2021	31	42	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	10.458	13.836	0	(164)	(164)	(0,01)
MYI	07.2021	SGD 15.046	\$ 11.193	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 11.193	SGD 15.046	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	9.574	12.690	0	(134)	(134)	(0,01)
SSB	07.2021	SGD 125	\$ 94	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 3.566	SGD 4.756	1	(29)	(28)	0,00
				\$ 15	\$ (509)	\$ (494)	(0,02)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (11.614) (0,56)

Summe Anlagen

\$ 2.066.318 99,38

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 12.907 0,62

Nettovermögen

\$ 2.079.225 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
CIFI Holdings Group Co. Ltd.	5,500 %	23.01.2022	20.09.2019 - 09.12.2019	\$ 1.103	\$ 1.116	0,05
Sunac China Holdings Ltd.	5,950	30.12.2021	01.11.2021	9.599	9.607	0,46
				\$ 10.702	\$ 10.723	0,51

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 8.643 als Sicherheiten verpfändet.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 5.154 und Barmittel in Höhe von USD 4.835 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 270 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 7.391 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.872.874	\$ 5.886	\$ 1.878.760
Investmentfonds	197.156	4.945	0	202.101
Finanzderivate ⁽³⁾	(99)	(14.503)	59	(14.543)
Summen	\$ 197.057	\$ 1.863.316	\$ 5.945	\$ 2.066.318

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 799.818	\$ 0	\$ 799.818
Investmentfonds	66.688	4.952	0	71.640
Pensionsgeschäfte	0	1.302	0	1.302
Finanzderivate ⁽³⁾	88	1.262	0	1.350
Summen	\$ 66.776	\$ 807.334	\$ 0	\$ 874.110

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	(0,600) %	21.01.2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (6.201)	\$ (6.185)	(0,30)
MEI	(1,750)	28.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.533)	(1.533)	(0,07)
	(1,000)	08.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.034)	(1.035)	(0,05)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (8.753)	(0,42)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 441	\$ (260)	\$ 181
BPS	(3.395)	2.755	(640)
BRC	(3.342)	2.978	(364)
CBK	(488)	320	(168)
DBL	(42)	(0)	(42)
DUB	(0)	(150)	(192)
GLM	(184)	40	(144)
GST	(99)	0	(99)
HUS	(471)	420	(51)
JPM	227	0	227
MYI	(510)	327	(183)
SCX	(3.609)	3.140	(469)
SSB	(41)	0	(41)
UAG	(101)	0	(101)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	60,71	59,57
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	29,65	30,20
Investmentfonds	9,72	8,04
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,13)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,01)	(0,04)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,56)	0,18
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,42)	(0,17)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Australien	0,78	1,57
Bermuda	k. A.	0,54
Brasilien	0,94	0,26
Cayman-Inseln	29,77	29,62
China	5,47	9,35
Ägypten	0,31	k. A.
Hongkong	6,43	5,05
Ungarn	k. A.	0,56
Indien	4,63	6,54
Indonesien	4,26	2,50
Israel	0,21	0,25
Italien	0,21	0,22
Japan	0,56	0,24
Jersey, Kanalinseln	0,42	k. A.
Malaysia	1,47	0,78
Mauritius	2,63	1,82
Mongolei	0,90	1,26
Niederlande	0,91	0,93
Oman	0,96	k. A.
Pakistan	2,67	1,59
Philippinen	2,92	2,76
Rumänien	k. A.	0,66
Saudi-Arabien	k. A.	0,57
Singapur	3,33	3,16
Südafrika	0,24	k. A.
Südkorea	0,26	1,11
Sri Lanka	2,62	2,61
Schweiz	0,26	k. A.
Thailand	1,07	1,04
Vereinigte Arabische Emirate	0,20	0,46
Großbritannien	4,02	3,52
USA	0,49	0,36
Vietnam	0,28	0,37
Jungfernseln (Britisch)	9,48	9,35
Kurzfristige Instrumente	1,66	0,72
Investmentfonds	9,72	8,04
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,13)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	(0,01)	(0,04)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	0,05
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,03)	(0,07)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	0,11
Zinsswaps	0,00	(0,01)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	0,00	0,01
Devisenterminkontrakte	0,04	(0,03)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,60)	0,12
Sonstige Aktiva und Passiva	0,62	1,89
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
5,000 % fällig am 19.11.2025	\$ 1.300	\$ 939	0,30	Pelabuhan Indonesia PT				MONGOLEI			
5,500 % fällig am 16.01.2025	600	445	0,14	5,375 % fällig am 05.05.2045	700	842	0,27	STAATSEMISSIONEN			
ICBCIL Finance Co. Ltd.				Pertamina Persero PT				Mongolia Government International Bond			
1,750 % fällig am 25.08.2025	600	603	0,20	1,400 % fällig am 09.02.2026	\$ 1.000	\$ 983	0,32	3,500 % fällig am 07.07.2027 (a)	\$ 800	\$ 788	0,26
Industrial & Commercial Bank of China Asia Ltd.				4,300 % fällig am 20.05.2023	3.200	3.408	1,10	4,450 % fällig am 07.07.2031 (a)	200	197	0,06
4,250 % fällig am 21.07.2021 (c)(e)	500	500	0,16	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				5,125 % fällig am 05.12.2022	1.000	1.045	0,34
Lenovo Group Ltd.				5,250 % fällig am 15.05.2047	1.000	1.128	0,37	5,625 % fällig am 01.05.2023	800	847	0,27
5,875 % fällig am 24.04.2025	4.100	4.644	1,50			20.733	6,70	Summe Mongolei		2.877	0,93
Yanlord Land HK Co. Ltd.				STAATSEMISSIONEN				NIEDERLANDE			
5,125 % fällig am 20.05.2026	1.100	1.124	0,36	Indonesia Government International Bond				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
6,800 % fällig am 27.02.2024	700	737	0,24	4,350 % fällig am 11.01.2048	600	683	0,22	Dufry One BV			
		21.951	7,09	5,250 % fällig am 17.01.2042	300	375	0,12	2,000 % fällig am 15.02.2027	€ 1.300	1.457	0,47
STAATSEMISSIONEN				8,375 % fällig am 15.09.2026 IDR	65.635.000	5.090	1,64	Prosus NV			
Hong Kong Government International Bond						6.148	1,98	3,832 % fällig am 08.02.2051	\$ 1.600	1.495	0,48
2,375 % fällig am 02.02.2051	200	195	0,06	Summe Indonesien		26.881	8,68	Summe Niederlande		2.952	0,95
Summe Hongkong		22.345	7,22	ISRAEL				OMAN			
INDIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN			
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				Energear Israel Finance Ltd.				Oman Government International Bond			
Bharti Airtel Ltd.				4,875 % fällig am 30.03.2026	\$ 500	513	0,17	7,000 % fällig am 25.01.2051	1.400	1.429	0,46
1,500 % fällig am 17.02.2025	1.500	1.745	0,56	JAPAN				Oman Sovereign Sukuk Co.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,875 % fällig am 15.06.2030	700	719	0,23
Adani Electricity Mumbai Ltd.				Asahi Mutual Life Insurance Co.				Summe Oman		2.148	0,69
3,949 % fällig am 12.02.2030	1.200	1.201	0,39	4,100 % fällig am 27.01.2031 (c)	2.100	2.146	0,69	PAKISTAN			
Adani Transmission Ltd.				Nissan Motor Co. Ltd.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,000 % fällig am 03.08.2026	1.600	1.681	0,54	4,345 % fällig am 17.09.2027	1.000	1.100	0,36	Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd.			
JSW Steel Ltd.				Summe Japan		3.246	1,05	5,625 % fällig am 05.12.2022	500	515	0,17
5,250 % fällig am 13.04.2022	300	308	0,10	Jersey, Kanalinseln				STAATSEMISSIONEN			
Muthoot Finance Ltd.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Pakistan Government International Bond			
6,125 % fällig am 31.10.2022	1.100	1.144	0,37	West China Cement Ltd.				6,000 % fällig am 08.04.2026	2.500	2.537	0,82
Network i2i Ltd.				4,950 % fällig am 08.07.2026 (a)	1.300	1.318	0,43	8,875 % fällig am 08.04.2051	500	532	0,17
5,650 % fällig am 15.01.2025 (c)	200	215	0,07	LUXEMBURG						3.069	0,99
NTPC Ltd.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Pakistan		3.584	1,16
4,250 % fällig am 26.02.2026	600	647	0,21	Aroundtown S.A.				PHILIPPINEN			
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd.				5,375 % fällig am 21.03.2029	400	479	0,16	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
3,750 % fällig am 27.07.2026	1.000	1.068	0,35	MALAYSIA				Development Bank of the Philippines			
Periama Holdings LLC				WANDELANLEIHEN & WECHSEL				2,375 % fällig am 11.03.2031	2.400	2.362	0,76
5,950 % fällig am 19.04.2026	500	543	0,18	Cerah Capital Ltd.				Globe Telecom, Inc.			
ReNew Power Pvt Ltd.				0,000 % fällig am 08.08.2024 (b)	2.400	2.395	0,77	3,000 % fällig am 23.07.2035	600	555	0,18
6,450 % fällig am 27.09.2022	1.300	1.345	0,43	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				JGSH Philippines Ltd.			
ReNew Power Synthetic				Dua Capital Ltd.				4,125 % fällig am 09.07.2030	200	215	0,07
6,670 % fällig am 12.03.2024	1.500	1.578	0,51	2,780 % fällig am 11.05.2031	1.600	1.596	0,52	Jollibee Worldwide Pte. Ltd.			
Shriram Transport Finance Co. Ltd.				Malaysia Wakala Sukuk Bhd.				4,750 % fällig am 24.06.2030	700	744	0,24
5,700 % fällig am 27.02.2022	3.700	3.747	1,21	2,070 % fällig am 28.04.2031	400	405	0,13	Megaworld Corp.			
TML Holdings Pte. Ltd.				Petronas Capital Ltd.				4,125 % fällig am 30.07.2027	600	644	0,21
5,500 % fällig am 03.06.2024	1.400	1.460	0,47	2,480 % fällig am 28.01.2032	600	605	0,20	Royal Capital BV			
		14.937	4,83	3,404 % fällig am 28.04.2061	2.100	2.158	0,70	5,875 % fällig am 05.05.2022 (c)	700	725	0,23
Summe Indien		16.682	5,39	Petronas Energy Canada Ltd.				SM Investments Corp.			
INDONESIEN				2,112 % fällig am 23.03.2028	900	910	0,29	4,875 % fällig am 10.06.2024	200	217	0,07
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				TNB Global Ventures Capital Bhd.				SMC Global Power Holdings Corp.			
Adaro Indonesia PT				3,244 % fällig am 19.10.2026	1.100	1.179	0,38	5,450 % fällig am 09.12.2026 (c)	300	300	0,10
4,250 % fällig am 31.10.2024	250	259	0,08	Summe Malaysia		9.248	2,99	7,000 % fällig am 21.10.2025 (c)	200	212	0,07
Bank Mandiri Persero Tbk PT				MAURITIUS						5.974	1,93
2,000 % fällig am 19.04.2026	2.800	2.806	0,91	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Philippines Government International Bond			
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT				Azure Power Energy Ltd.				1,750 % fällig am 28.04.2041	€ 1.400	1.648	0,53
3,750 % fällig am 30.03.2026 (e)	4.850	4.948	1,60	5,500 % fällig am 03.11.2022	400	406	0,13	3,200 % fällig am 06.07.2046 (a)	\$ 1.800	1.809	0,59
Gajah Tunggal Tbk PT				Azure Power Solar Energy Pvt Ltd.				5,000 % fällig am 13.01.2037	200	252	0,08
8,950 % fällig am 23.06.2026	800	791	0,26	5,650 % fällig am 24.12.2024	1.700	1.808	0,58	Summe Philippinen		9.683	3,13
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT				Greenko Dutch BV				RUMÄNIEN			
5,450 % fällig am 15.05.2030	1.100	1.280	0,41	3,850 % fällig am 29.03.2026	900	923	0,30	STAATSEMISSIONEN			
LLPL Capital Pte. Ltd.				Greenko Solar Mauritius Ltd.				Romania Government International Bond			
6,875 % fällig am 04.02.2039	1.550	1.805	0,58	5,950 % fällig am 29.07.2026	200	216	0,07	2,625 % fällig am 02.12.2040	€ 400	472	0,15
Medco Oak Tree Pte. Ltd.				India Green Energy Holdings							
7,375 % fällig am 14.05.2026	700	767	0,25	5,375 % fällig am 29.04.2024	1.700	1.781	0,58				
Pakuwon Jati Tbk PT				Summe Mauritius		5.134	1,66				
4,875 % fällig am 29.04.2028	900	942	0,30								
Pelabuhan Indonesia Persero PT											
4,875 % fällig am 01.10.2024	700	774	0,25								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
SINGAPUR				THAILAND				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ABJA Investment Co. Pte. Ltd.				Bangkok Bank PCL				1MDB Global Investments Ltd.			
4,450 % fällig am 24.07.2023	\$ 500	\$ 515	0,16	4,450 % fällig am 19.09.2028	\$ 200	\$ 231	0,07	4,400 % fällig am 09.03.2023	\$ 2.000	\$ 2.017	0,65
5,450 % fällig am 24.01.2028	1.100	1.185	0,38	GC Treasury Center Co. Ltd.				Celestial Miles Ltd.			
Alam Synergy Pte. Ltd.				2,980 % fällig am 18.03.2031	1.000	1.024	0,33	5,750 % fällig am 31.01.2024 (c)	1.400	1.491	0,48
6,625 % fällig am 24.04.2022	700	676	0,22	Kasikornbank PCL				Champion Path Holdings Ltd.			
BOC Aviation Ltd.				5,275 % fällig am 14.10.2025 (c)(e)	600	637	0,21	4,500 % fällig am 27.01.2026	700	729	0,24
1,750 % fällig am 21.01.2026	2.000	1.983	0,64	Krung Thai Bank PCL				China Reinsurance Finance Corp. Ltd.			
Indika Energy Capital Pte. Ltd.				4,400 % fällig am 25.03.2026 (c)(e)	1.700	1.727	0,56	3,375 % fällig am 09.03.2022	200	202	0,07
8,250 % fällig am 22.10.2025	950	1.012	0,33	PTT Treasury Center Co. Ltd.				Easy Tactic Ltd.			
LMIRT Capital Pte. Ltd.				7,250 % fällig am 19.06.2024	200	209	0,07	5,875 % fällig am 13.02.2023	1.100	996	0,32
7,500 % fällig am 09.02.2026	500	518	0,17	7,500 % fällig am 16.07.2070	700	711	0,23	8,125 % fällig am 27.02.2023	1.200	1.125	0,36
TML Holdings Pte. Ltd.				Summe Thailand		4.330	1,40	11,625 % fällig am 03.09.2024	300	285	0,09
4,350 % fällig am 09.06.2026	1.400	1.410	0,45	GROSSBRITANNIEN				11,750 % fällig am 02.08.2023	500	492	0,16
Summe Singapur		7.508	2,42	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				12,375 % fällig am 18.11.2022	200	204	0,07
				Barclays PLC				JMH Co. Ltd.			
				7,875 % fällig am 15.03.2022 (c)(e)	200	209	0,07	2,875 % fällig am 09.04.2036	1.000	1.011	0,33
				HSBC Holdings PLC				Levc Finance Ltd.			
				4,000 % fällig am 09.03.2026 (c)(e)	600	611	0,20	1,375 % fällig am 25.03.2024	1.300	1.303	0,42
				6,000 % fällig am 22.05.2027 (c)(e)	900	1.001	0,32	NWD Finance BVI Ltd.			
				Jaguar Land Rover Automotive PLC				4,125 % fällig am 10.03.2028 (c)	1.000	1.011	0,33
				2,200 % fällig am 15.01.2024	400	474	0,15	4,800 % fällig am 09.09.2023 (c)	1.600	1.606	0,52
				Standard Chartered PLC				Peak RE BVI Holding Ltd.			
				6,000 % fällig am 26.07.2025 (c)(e) \$	700	769	0,25	5,350 % fällig am 28.10.2025 (c)	1.300	1.378	0,44
				Vedanta Resources Finance PLC				Studio City Finance Ltd.			
				8,000 % fällig am 23.04.2023	1.700	1.612	0,52	5,000 % fällig am 15.01.2029	1.300	1.314	0,42
				8,950 % fällig am 11.03.2025	1.700	1.672	0,54	Summe Jungferninseln (Britisch)		17.385	5,61
				Summe Großbritannien		6.348	2,05	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
								COMMERCIAL PAPER			
								Sunac China Holdings Ltd.			
								5,950 % fällig am 30.12.2021 (f)	1.700	1.701	0,55
								Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 280.657	90,64	
								AKTIEN			
								INVESTMENTFONDS			
								ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
								PIMCO Select Funds plc -			
								PIMCO US Dollar			
								Short-Term Floating			
								NAV Fund (d)	1.812.232	18.052	5,83
								PIMCO Specialty Funds			
								Ireland p.l.c. - PIMCO			
								China Bond Fund (d)	1.880	25	0,01
								Summe Investmentfonds	\$ 19.103	6,17	
								BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
								PIMCO ETFs plc - PIMCO			
								US Dollar Short			
								Maturity UCITS ETF (d)	10.100	1.026	0,33
								Summe Investmentfonds			

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2021	32	\$ 7	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	7	(3)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2021	6	(1)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	4	(5)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	5	(21)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2021	7	(2)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	25	\$ (9)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	10	26	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	23	(1)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	5	25	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	25	(47)	(0,02)
				\$ (31)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (31)	(0,01)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Atlantia SpA	1,000 %	20.06.2025	€ 100	\$ 8	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month	CNY-CNREPOFIX	2,500 %	16.06.2022	CNY 52.800	\$ 5	0,00
Erhalt	6-Month	AUD-BBR-BBSW	0,500	16.12.2025	AUD 800	16	0,01
						\$ 21	0,01
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 29	0,01

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC USD versus INR	INR 69,000	03.09.2021	250	\$ 20	\$ 0	0,00
	Put - OTC USD versus INR	69,000	03.12.2021	700	39	7	0,00
					\$ 59	\$ 7	0,00

VERKAUFIOPTIONEN

DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus INR	INR 81,000	27.04.2022	231	\$ (4)	\$ (2)	0,00
JPM	Call - OTC USD versus INR	80,000	27.01.2022	231	(3)	(2)	0,00
MYI	Call - OTC USD versus INR	81,500	22.04.2022	577	(10)	(4)	0,00
UAG	Call - OTC USD versus INR	81,000	02.05.2022	461	(7)	(5)	0,00
					\$ (24)	\$ (13)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Alibaba Group Holding Ltd.	(1,000) %	20.06.2026	\$ 3.600	(81)	\$ (1)	(82)	(0,03)
BRC	Alibaba Group Holding Ltd.	(1,000)	20.06.2026	1.400	(31)	(1)	(32)	(0,01)
					\$ (112)	\$ (2)	\$ (114)	(0,04)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Baidu, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 600	\$ 4	\$ 3	\$ 7	0,00
	China Government International Bond	1,000	20.06.2026	3.400	113	(6)	107	0,03
	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	1,000	20.06.2026	500	(6)	0	(6)	0,00
	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000	20.06.2026	600	(10)	(1)	(11)	0,00
	Reliance Industries Ltd.	1,000	20.06.2026	2.200	0	23	23	0,01
BRC	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.	1,000	20.06.2026	600	(4)	3	(1)	0,00
	Baidu, Inc.	1,000	20.06.2026	1.400	18	(1)	17	0,01
	BOC Aviation Ltd.	1,000	20.06.2026	2.000	(7)	1	(6)	0,00
	China Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.400	44	0	44	0,01
	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	1,000	20.06.2026	1.200	(14)	(1)	(15)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2026	7.900	71	29	100	0,03
	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000	20.06.2022	2.000	(8)	23	15	0,00
	State Bank of India	1,000	20.06.2026	1.300	(2)	7	5	0,00
	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.	1,000	20.06.2026	1.400	2	(5)	(3)	0,00
	Vietnam Government International Bond	1,000	20.06.2026	3.000	(4)	(4)	(8)	0,00
GST	Country Garden Holdings Co. Ltd.	1,000	20.12.2021	500	(6)	4	(2)	0,00
	Country Garden Holdings Co. Ltd.	1,000	20.06.2022	1.600	(18)	2	(16)	(0,01)
					\$ 173	\$ 77	\$ 250	0,08

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
SCX	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,650 %	05.03.2025	CNY 1.100	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,000	13.02.2025	700	0	(1)	(1)	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,065	21.08.2024	4.400	0	(2)	(2)	0,00
						\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00

TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
DBL	Zahlung	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 2.655	08.09.2021	\$ 0	\$ (15)	\$ (15)	0,00

DEVISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	09.2021	CNY	1.700	\$ 264	\$ 3	\$ 3	0,00	
	09.2021	IDR	13.139.265	912	16	16	0,01	
BPS	07.2021	€	929	1.109	7	7	0,00	
	08.2021	AUD	3.730	2.912	111	111	0,03	
	09.2021	CNH	7.001	1.087	9	9	0,00	
BRC	09.2021	\$	2.261	MYR 9.378	0	(10)	0,00	
	09.2021	HKD	4.285	\$ 552	0	0	0,00	
CBK	04.2022	\$	1	INR 79	0	0	0,00	
	07.2021	RUB	433	\$ 6	0	0	0,00	
GLM	08.2021	RUB	433	6	0	0	0,00	
	09.2021	CNH	17.000	2.641	22	22	0,01	
	09.2021	HKD	40.222	5.185	5	5	0,00	
	09.2021	RUB	433	6	0	0	0,00	
	09.2021	\$	1.419	THB 44.147	0	(42)	(42)	(0,02)
	04.2022	\$	172	INR 13.543	3	0	3	0,00
	07.2021	€	165	€ 135	0	(5)	(5)	0,00
	09.2021	CNH	17.673	\$ 2.750	28	0	28	0,01
	09.2021	\$	2.897	KRW 3.227.918	0	(41)	(41)	(0,01)
	12.2021	PHP	139.527	\$ 2.890	66	0	66	0,02
JPM	07.2021	€	5.396	6.424	25	0	25	0,01
	04.2022	INR	11.347	144	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2021	€	3.088	3.777	116	0	116	0,04
	09.2021	THB	44.691	1.421	27	0	27	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2021	\$	756	MYR	3.120	\$	0,00
	12.2021		1.640	INR	123.146		(0,01)
TOR	07.2021	€	90	\$	107		0,00
				\$	438	\$	(124)
						\$	314
							0,10

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$	606	€	503	\$	(10)
CBK	07.2021		279		233		(3)
GLM	07.2021		33.491		27.513		(863)
MYI	07.2021		37.433		30.752		(964)
SCX	07.2021	€	88	\$	107		3
	07.2021	\$	39.890	€	32.644		(1.176)
SSB	07.2021		615		507		(13)
UAG	07.2021	€	205	\$	249		6
				\$	9	\$	(3.029)
						\$	(3.020)
							(0,98)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD	2.028	\$	1.510	\$	2
	08.2021	\$	1.510	SGD	2.028		(2)
GLM	07.2021		1.528		2.025		(21)
MYI	07.2021	SGD	2.026	\$	1.507		0
	08.2021	\$	1.507	SGD	2.026		0
SCX	07.2021		1.528		2.025		(21)
SSB	07.2021	SGD	15	\$	12		0
	07.2021	\$	34	SGD	45		(1)
UAG	07.2021		1.496		1.983		(20)
				\$	2	\$	(65)
						\$	(63)
							(0,02)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$	(2.660)
							(0,86)
Summe Anlagen						\$	297.098
							95,95
Sonstige Aktiva und Passiva						\$	12.544
							4,05
Nettovermögen						\$	309.642
							100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (d) Mit dem Fonds verbunden.
- (e) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (f) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens	
CIFI Holdings Group Co. Ltd.	5,500 %	23.01.2022	28.08.2020 - 23.04.2021	\$	1.821	\$	1.826
Sunac China Holdings Ltd.	5,950	30.12.2021	11.01.2021		1.700		1.701
				\$	3.521	\$	3.527
							1,14

Barmittel in Höhe von USD 420 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 2.271 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 277.714	\$ 2.943	\$ 280.657
Investmentfonds	18.077	1.026	0	19.103
Finanzderivate ⁽³⁾	(23)	(2.654)	15	(2.662)
Summen	\$ 18.054	\$ 276.086	\$ 2.958	\$ 297.098

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 148.688	\$ 0	\$ 148.688
Investmentfonds	15.070	1.027	0	16.097
Pensionsgeschäfte	0	1.299	0	1.299
Finanzderivate ⁽³⁾	0	132	0	132
Summen	\$ 15.070	\$ 151.146	\$ 0	\$ 166.216

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 14	\$ (30)	\$ (16)
BPS	154	0	154
BRC	117	0	117
CBK	(3)	0	(3)
DBL	(15)	0	(15)
GLM	(896)	710	(186)
GST	(18)	0	(18)
HUS	(18)	0	(18)
JPM	64	0	64
MYI	(946)	700	(246)
SCX	(1.080)	861	(219)
SSB	(14)	0	(14)
UAG	(19)	0	(19)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	85,62	60,35
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	5,02	28,30
Investmentfonds	6,17	9,60
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,78
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,86)	0,07

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Australien	2,41	2,47
Bahamas	0,26	0,35
Bermuda	k. A.	0,27
Brasilien	0,49	k. A.
Cayman-Inseln	20,87	22,62
China	11,07	13,62
Deutschland	0,35	k. A.
Hongkong	7,22	8,63
Indien	5,39	6,36
Indonesien	8,68	8,59
Israel	0,17	k. A.
Japan	1,05	0,46

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Jersey, Kanalinseln	0,43	k. A.
Luxemburg	0,16	0,28
Malaysia	2,99	2,59
Mauritius	1,66	1,43
Mongolei	0,93	0,82
Niederlande	0,95	0,88
Oman	0,69	k. A.
Pakistan	1,16	0,74
Philippinen	3,13	3,65
Rumänien	0,15	0,31
Saudi-Arabien	k. A.	0,79
Singapur	2,42	2,40
Südafrika	0,26	k. A.
Südkorea	5,19	3,02
Sri Lanka	1,09	1,11
Thailand	1,40	0,70
Großbritannien	2,05	0,90
USA	1,86	0,46
Jungferinseln (Britisch)	5,61	3,89
Kurzfristige Instrumente	0,55	1,31
Investmentfonds	6,17	9,60
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,78
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes - Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,01	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	0,03
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,04)	(0,04)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,08	0,09
Zinsswaps	0,00	(0,01)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	0,00	0,02
Devisenterminkontrakte	0,10	(0,04)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,00)	0,02
Sonstige Aktiva und Passiva	4,05	0,89
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE												
ÖSTERREICH												
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL												
Erste Group Bank AG				5,375 % fällig am 18.11.2030 (c)(e)	20.600	21.862	0,24	3,875 % fällig am 03.06.2027 (c)(e)	6.800	7.737	0,08	
3,375 % fällig am 15.04.2027 (c)(e)(f)	€	7.000	0,09	6,750 % fällig am 06.04.2028 (c)(e)	49.900	56.606	0,62	5,459 % fällig am 30.06.2035	\$	20.800	0,25	
4,250 % fällig am 15.10.2027 (c)(e)		55.400	0,77	7,375 % fällig am 04.10.2023 (c)(e)	800	875	0,01	6,625 % fällig am 03.06.2023 (c)(e)		67.145	0,94	
6,500 % fällig am 15.04.2024 (c)(e)		9.800	0,14	7,875 % fällig am 18.12.2023 (c)(e)	800	896	0,01	6,750 % fällig am 10.09.2021 (c)(e)		19.000	0,25	
8,875 % fällig am 15.10.2021 (c)(e)(f)		31.400	0,42	8,000 % fällig am 29.09.2025 (c)(e)	42.650	50.247	0,55	7,500 % fällig am 03.06.2026 (c)(e)		82.685	1,27	
Summe Österreich		129.887	1,42	Summe Frankreich		638.301	6,96	7,830 % fällig am 04.12.2023	\$	25.200	0,32	
BELGIEN												
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL												
KBC Group NV				DEUTSCHLAND				9,250 % fällig am 03.06.2022 (c)(e)	€	30.665	0,43	
4,250 % fällig am 24.10.2025 (c)(e)	74.800	94.360	1,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Unipol Gruppo SpA		12.170	0,13	
				Bayer AG	€	21.100	26,092	3,250 % fällig am 23.09.2030	9.100	759.927	8,29	
				4,000 % fällig am 12.11.2079				Summe Italien				
				Commerzbank AG				JERSEY, KANALINSELN				
				4,250 % fällig am 09.10.2027 (c)(e)(f)	12.100	15.929	0,17	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				6,500 % fällig am 09.10.2029 (c)(e)	10.000	12.404	0,13	HSBC Bank Capital Funding Sterling LP				
				Summe Deutschland	9.200	12.864	0,14	5,844 % fällig am 05.11.2031 (c)				
				Deutsche Bank AG	\$	16.100	17,156	0,19	£			
				3,547 % fällig am 18.09.2031 (f)				66.532				
				3,961 % fällig am 26.11.2025 (f)	36.500	39.484	0,43	130.021				
				4,625 % fällig am 30.10.2027 (c)(e)	24.800	30.631	0,33	1,42				
				5,625 % fällig am 19.05.2031	152.200	213.931	2,33	HSBC Capital Funding Dollar LP				
				Summe Deutschland		368.127	4,01	10,176 % fällig am 30.06.2030 (c)				
				HONGKONG				\$				
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3.817				
				AIA Group Ltd.	\$	9.000	9,140	6.328				
				3,125 % fällig am 07.04.2026 (c)			0,10	136.349				
				Hongkong & Shanghai Banking Corp. Ltd.		1.665	1,566	LUXEMBURG				
				0,375 % fällig am 27.07.2021 (c)			0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				Summe Hongkong		10.706	0,12	Aroundtown S.A.				
				IRLAND				3,375 % fällig am 23.09.2024 (c)				
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				€				
				AIB Group PLC	€	17.100	21,711	31.800				
				2,875 % fällig am 30.05.2031			0,24	39.267				
				5,250 % fällig am 09.10.2024 (c)(e)	25.207	32.286	0,35	0,43				
				6,250 % fällig am 23.06.2025 (c)(e)	20.850	28.188	0,31	BK LC Lux Finco SARL				
				Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC	\$	16.800	17,684	5,250 % fällig am 30.04.2029				
				5,950 % fällig am 15.04.2030 (e)			0,19	1,300				
				Bank of Ireland Group PLC	€	19.300	25,501	1,581				
				6,000 % fällig am 01.09.2025 (c)(e)			0,28	0,02				
				7,500 % fällig am 19.05.2025 (c)(e)	61.100	85.774	0,93	CPI Property Group S.A.				
				Permanent TSB Group Holdings PLC				4,875 % fällig am 16.07.2025 (c)				
				2,125 % fällig am 26.09.2024	34.000	41.129	0,45	9,600				
				Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.	\$	22.000	21,821	12,078				
				3,000 % fällig am 19.04.2051			0,24	12,078				
				Summe Irland		274.094	2,99	4,875 % fällig am 18.08.2026 (c)				
				ITALIEN				17.200				
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				21,598				
				Atlantia SpA	€	15.800	19,309	0,23				
				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				21,598				
				5,375 % fällig am 18.01.2028	5.208	5.099	0,06	Holcim Finance Luxembourg S.A.				
				8,000 % fällig am 22.01.2030	3.300	3.597	0,04	3,000 % fällig am 05.07.2024 (c)				
				8,500 % fällig am 10.09.2030	28.000	30.731	0,33	8,700				
				Enel SpA	\$	13.000	15,131	10,821				
				8,750 % fällig am 24.09.2073 (f)			0,16	4,328				
				Intesa Sanpaolo SpA				0,05				
				4,000 % fällig am 23.09.2029 (f)	51.068	56.085	0,61	3,600				
				4,125 % fällig am 27.02.2030 (c)(e)	€	5.000	5,792	3,625				
				4,198 % fällig am 01.06.2032	\$	15.500	15,916	3,248				
				4,950 % fällig am 01.06.2042	\$	20.000	20,777	3,248				
				5,148 % fällig am 10.06.2030	€	12.900	20,345	4,375				
				5,875 % fällig am 01.09.2031 (c)(e)	€	43.450	58,605	4,750				
				7,700 % fällig am 17.09.2025 (c)(e)	\$	1.500	1,722	4,750				
				7,750 % fällig am 11.01.2027 (c)(e)	€	107.700	156,693	4,750				
				UniCredit SpA	\$	7.850	7,963	4,625				
				2,569 % fällig am 22.09.2026	\$	7.850	7,963	4,625				
				2,731 % fällig am 15.01.2032	€	5.000	6,072	5,750				
								5,750				
								6,875				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
7,000 % fällig am 04.04.2079	\$ 51.600	\$ 62.564	0,68	Deutsche Postbank Funding Trust 0,065 % fällig am 07.06.2022 (c)	€ 12.980	\$ 15.039	0,16	0,022 % fällig am 03.08.2021 (a)(b)(g)	4.300	4.300	0,05
		1.877.684	20,48	0,165 % fällig am 02.12.2021 (c)	1.704	1.976	0,02	0,025 % fällig am 09.09.2021 (a)(b)	\$ 9.400	\$ 9.399	0,10
				Liberty Mutual Group, Inc. 3,625 % fällig am 23.05.2059	15.500	19.197	0,21	0,027 % fällig am 12.11.2021 (a)(b)(g)	12.400	12.398	0,14
AKTIEN				NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 5,650 % fällig am 01.05.2079 (f)	\$ 11.024	12.838	0,14	0,030 % fällig am 16.09.2021 (a)(b)	133.300	133.288	1,45
VORZUGSWERTPAPIERE				Summe USA		87.751	0,96	0,032 % fällig am 30.09.2021 (a)(b)	35.000	34.996	0,38
Nationwide Building Society 10,250 %	647.846	168.254	1,83			241.878	2,64	0,056 % fällig am 16.09.2021 (a)(b)	73.700	73.694	0,80
Summe Großbritannien		2.096.146	22,86					0,058 % fällig am 19.08.2021 (a)(b)	58.000	57.997	0,63
USA				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				0,061 % fällig am 09.09.2021 (a)(b)	131.700	131.689	1,44
STAMMAKTIEN				KURZFRISTIGE SCHULDITITEL				0,062 % fällig am 02.09.2021 (a)(b)	34.600	34.597	0,38
FINANZWERTPAPIERE				U.S. TREASURY BILLS					931.442	10,16	
Bank of America Corp. 1.582.448		65.244	0,71	0,015 % fällig am 29.07.2021 (a)(b)	\$ 349.200	349.188	3,81	Summe kurzfristige Instrumente	954.231	10,41	
Goldman Sachs Group, Inc. 146.782		55.708	0,61	0,015 % fällig am 05.08.2021 (a)(b)	57.200	57.198	0,62	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 9.012.582	98,30	
Wells Fargo & Co. 732.496		33.175	0,36	0,015 % fällig am 26.08.2021 (a)(b)(g)	21.300	21.299	0,23	AKTIEN			
		154.127	1,68	0,018 % fällig am 31.08.2021 (a)(b)(g)	3.600	3.600	0,04	INVESTMENTFONDS			
				0,021 % fällig am 24.08.2021 (a)(b)(g)	7.800	7.799	0,09	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
USA								PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)	8.255.800	838.364	9,14
STAMMAKTIEN								Summe Investmentfonds	\$ 838.364	9,14	
FINANZWERTPAPIERE											

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	0,030 %	30.06.2021	01.07.2021	\$ 98.000	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2049	\$ (100.356)	\$ 98.000	\$ 98.000	1,07
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (100.356)	\$ 98.000	\$ 98.000	1,07

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro STOXX Bank September Futures	Long	09.2021	9.253	\$ (2.756)	(0,03)
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2021	862	(185)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	388	715	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	450	(1.911)	(0,02)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	1.512	(1.145)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	6.724	(1.792)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	1.791	1.740	0,02
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2021	796	6.996	0,07
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	433	(748)	(0,01)
				\$ 914	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 914	0,01

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000 %	20.06.2026	\$ 202.500	\$ 248	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung ⁽¹⁾		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,250 %	15.09.2023	£ 277.100	\$ (32)	0,00
Erhalt ⁽²⁾		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	20.500	35	0,00
Erhalt ⁽³⁾		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	141.400	(1.014)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	104.500	(2.681)	(0,03)
Erhalt ⁽³⁾		6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	€ 379.600	650	0,01
Erhalt ⁽³⁾		6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	89.600	(86)	0,00
						\$ (3.128)	(0,03)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (2.880)	(0,03)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
GST	Intrum AB	5,000 %	20.06.2025	€ 12.600	\$ (715)	\$ 2.144	\$ 1.429	0,02

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BPS	Zahlung	BNP FP Dividend Swap	1.614.000	k. A.	€ 5.018	17.12.2021	\$ 0	\$ (2.117)	\$ (2.117)	(0,02)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2021	€	1.165.076	\$ 1.425.248	\$ 43.584	\$ 43.584	0,48
	07.2021	\$	36.940	€ 30.573	0	(683)	(0,01)
BPS	07.2021	€	19.203	\$ 23.122	349	0	349
	07.2021	£	7.826	€ 10.923	112	0	112
BRC	07.2021	\$	43.018	€ 35.988	0	(340)	(340)
	07.2021	£	13.441	€ 9.622	0	(149)	(149)
CBK	07.2021	€	1.532.234	\$ 1.874.377	57.301	0	57.301
	07.2021	SEK	5.706	€ 688	21	0	21
GLM	07.2021	\$	30.792	€ 21.852	0	(605)	(605)
	07.2021	AUD	1.726	£ 1.335	39	0	39
HUS	07.2021	CHF	17.030	€ 18.993	570	0	570
	07.2021	\$	20.893	CAD 25.694	0	(143)	(143)
JPM	07.2021	CHF	17.030	€ 17.030	0	(75)	(75)
	08.2021	CAD	25.694	\$ 20.892	143	0	143
MYI	07.2021	CHF	3.781	€ 3.126	75	0	75
	07.2021	\$	16.167	€ 13.338	0	(349)	(349)
MYI	09.2021	€	543	HKD 4.214	0	0	0
	12.2021	SGD	9	\$ 7	0	0	0
MYI	07.2021	CAD	8.498	€ 6.990	127	0	127
	07.2021	€	39.357	£ 47.561	887	0	887
MYI	07.2021	£	1.409	€ 1.990	43	0	43
	07.2021	\$	15.947	€ 13.114	0	(395)	(395)
MYI	07.2021	€	1.294	£ 914	0	(31)	(31)
	09.2021	€	188	CNH 1.208	0	(2)	(2)
MYI	07.2021	CAD	5.314	\$ 4.362	71	0	71
	07.2021	€	19.984	\$ 23.839	140	0	140

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2021	£ 3.588	\$ 4.976	\$ 20	\$ 0	\$ 20	0,00
	07.2021	SGD 1.020	799	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 6.144	€ 5.043	0	(164)	(164)	0,00
	07.2021	£ 1.098	794	0	(2)	(2)	0,00
RBC	07.2021	€ 539.084	\$ 659.490	20.190	0	20.190	0,22
RYL	07.2021	£ 2.080	2.932	58	0	58	0,00
SCX	07.2021	€ 55.513	67.907	2.074	0	2.074	0,02
	07.2021	£ 7.391	10.507	296	0	296	0,00
	07.2021	\$ 32.553	€ 26.760	0	(818)	(818)	(0,01)
	12.2021	SGD 1.238	\$ 935	15	0	15	0,00
SSB	07.2021	AUD 840	652	21	0	21	0,00
	07.2021	€ 10	12	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 2.370	£ 1.671	0	(62)	(62)	0,00
	08.2021	£ 863.828	\$ 1.193.841	400	0	400	0,00
TOR	07.2021	CAD 8.101	6.705	163	0	163	0,00
UAG	07.2021	€ 3.539	4.227	30	0	30	0,00
	07.2021	£ 880.924	1.248.153	31.200	0	31.200	0,34
				\$ 158.002	\$ (3.818)	\$ 154.184	1,68

ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Investor AUD (Hedged) ausschüttend und die Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	AUD 57.823	\$ 43.579	\$ 168	\$ 0	\$ 168	0,00
	07.2021	\$ 44.136	AUD 57.122	0	(1.251)	(1.251)	(0,01)
	08.2021	41.336	54.888	0	(122)	(122)	0,00
BPS	07.2021	AUD 1.117	\$ 859	20	0	20	0,00
	07.2021	\$ 32.881	AUD 42.310	0	(1.116)	(1.116)	(0,01)
BRC	07.2021	102	134	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2021	674	871	0	(20)	(20)	0,00
GLM	07.2021	AUD 821	\$ 634	18	0	18	0,00
HUS	07.2021	\$ 147	AUD 190	0	(5)	(5)	0,00
MYI	07.2021	AUD 23.519	\$ 17.791	134	0	134	0,00
	07.2021	\$ 903	AUD 1.199	0	(3)	(3)	0,00
	08.2021	17.626	23.299	0	(131)	(131)	0,00
RBC	07.2021	AUD 2.982	\$ 2.310	71	0	71	0,00
SCX	07.2021	759	577	7	0	7	0,00
	07.2021	\$ 45	AUD 58	0	(1)	(1)	0,00
SSB	07.2021	AUD 56	\$ 43	1	0	1	0,00
TOR	07.2021	\$ 11.147	AUD 14.400	0	(336)	(336)	0,00
UAG	07.2021	AUD 37.929	\$ 28.769	293	0	293	0,00
	07.2021	\$ 44.303	AUD 57.155	0	(1.394)	(1.394)	(0,02)
	08.2021	27.984	36.886	0	(287)	(287)	0,00
				\$ 712	\$ (4.667)	\$ (3.955)	(0,04)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	BRL 58.619	\$ 11.830	\$ 148	\$ 0	\$ 148	0,00
	07.2021	\$ 4.680	BRL 24.845	271	0	271	0,00
	08.2021	11.794	58.619	0	(150)	(150)	0,00
BPS	07.2021	20.187	102.035	148	0	148	0,00
CBK	07.2021	20	109	1	0	1	0,00
	08.2021	242	1.202	0	(3)	(3)	0,00
GLM	08.2021	102	504	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07.2021	BRL 60.144	\$ 11.995	9	0	9	0,00
	07.2021	\$ 4.744	BRL 25.387	316	0	316	0,01
	08.2021	11.956	60.144	0	(10)	(10)	0,00
SSB	07.2021	BRL 58.619	\$ 11.780	98	0	98	0,00
	07.2021	\$ 4.712	BRL 25.005	271	0	271	0,00
	08.2021	11.744	58.619	0	(100)	(100)	0,00
				\$ 1.262	\$ (265)	\$ 997	0,01

Zum 30. Juni 2021 standen für die ausschüttende Investor CAD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	CAD 183	\$ 147	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2021	\$ 98	CAD 119	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	147	183	0	0	0	0,00
BPS	07.2021	157	190	0	(4)	(4)	0,00
CBK	07.2021	CAD 189	\$ 154	1	0	1	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2021	\$ 154	CAD 189	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
HUS	07.2021			0	(4)	(4)	0,00
MYI	07.2021	CAD 1	\$ 1	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	\$ 54	CAD 66	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1	\$ (12)	\$ (11)	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 44.275	CHF 39.719	\$ 0	\$ (1.306)	\$ (1.306)	(0,01)
BRC	07.2021	1.064	956	0	(30)	(30)	0,00
CBK	07.2021	CHF 41.022	\$ 44.559	180	0	180	0,00
	07.2021	\$ 44.212	CHF 39.642	0	(1.326)	(1.326)	(0,02)
	08.2021	44.597	41.022	0	(180)	(180)	0,00
GLM	07.2021	46	42	0	(1)	(1)	0,00
MYI	07.2021	43.416	39.117	0	(1.098)	(1.098)	(0,01)
SCX	07.2021	CHF 54	\$ 59	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 231	CHF 212	0	(2)	(2)	0,00
SSB	07.2021	CHF 1.261	\$ 1.408	44	0	44	0,00
	07.2021	\$ 3.511	CHF 3.214	0	(34)	(34)	0,00
UAG	07.2021	1.003	922	0	(6)	(6)	0,00
				\$ 225	\$ (3.983)	\$ (3.758)	(0,04)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 10.155	€ 8.355	\$ 0	\$ (247)	\$ (247)	0,00
BPS	07.2021	€ 5.247	\$ 6.289	66	0	66	0,00
	07.2021	\$ 1.269.704	€ 1.038.207	0	(38.493)	(38.493)	(0,42)
BRC	07.2021	2.468	2.026	0	(65)	(65)	0,00
GLM	07.2021	626	516	0	(14)	(14)	0,00
HUS	07.2021	€ 308.269	\$ 370.202	4.625	0	4.625	0,05
	07.2021	\$ 10.845	€ 8.911	0	(278)	(278)	(0,01)
MYI	07.2021	30.990	26.030	0	(121)	(121)	0,00
SCX	07.2021	1.471.564	1.202.890	0	(45.056)	(45.056)	(0,49)
TOR	07.2021	1.469.460	1.201.160	0	(45.003)	(45.003)	(0,49)
UAG	07.2021	€ 2.364	\$ 2.876	72	0	72	0,00
				\$ 4.763	\$ (129.277)	\$ (124.514)	(1,36)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 2.713	\$ 3.820	\$ 71	\$ 0	\$ 71	0,00
	07.2021	\$ 4.338	£ 3.116	0	(33)	(33)	0,00
BRC	07.2021	£ 78	\$ 108	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 817	£ 580	0	(16)	(16)	0,00
GLM	07.2021	86.945	61.501	0	(1.985)	(1.985)	(0,02)
HUS	07.2021	£ 63.866	\$ 88.401	174	0	174	0,00
	07.2021	\$ 28	£ 20	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	88.138	63.675	0	(166)	(166)	0,00
MYI	07.2021	£ 74	\$ 103	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 127	£ 92	0	(1)	(1)	0,00
RYL	07.2021	£ 303	\$ 427	9	0	9	0,00
SCX	07.2021	\$ 87.788	£ 61.754	0	(2.477)	(2.477)	(0,03)
SSB	07.2021	£ 67.961	\$ 93.960	75	0	75	0,00
	08.2021	\$ 88.002	£ 63.675	0	(30)	(30)	0,00
UAG	07.2021	87.138	61.501	0	(2.178)	(2.178)	(0,02)
				\$ 331	\$ (6.887)	\$ (6.556)	(0,07)

Zum 30. Juni 2021 standen für die ausschüttende Investor RMB (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	\$ 2.428	CNH 15.494	\$ 0	\$ (30)	\$ (30)	0,00
	08.2021	2.395	15.524	3	0	3	0,00
GLM	08.2021	2.425	15.716	3	0	3	0,00
HUS	07.2021	2.291	14.605	0	(30)	(30)	0,00
MYI	07.2021	2.605	16.612	0	(34)	(34)	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
SCX	07.2021	\$ 37	CNH 236	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
UAG	07.2021	CNH 15.707	\$ 2.430	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	\$ 2.424	CNH 15.707	2	0	2	0,00
				\$ 8	\$ (96)	\$ (88)	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Investor SGD (Hedged) ausschüttend und M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 39.668	\$ 29.544	\$ 34	\$ 0	\$ 34	0,00
	08.2021	\$ 29.542	SGD 39.668	0	(34)	(34)	0,00
BPS	07.2021	27.453	36.317	0	(435)	(435)	(0,01)
GLM	07.2021	1.150	1.533	0	(9)	(9)	0,00
	08.2021	238	319	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	27.588	36.501	0	(434)	(434)	(0,01)
MYI	07.2021	SGD 39.734	\$ 29.560	1	0	1	0,00
	08.2021	\$ 29.558	SGD 39.734	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2021	26.859	35.599	0	(376)	(376)	0,00
SSB	07.2021	6.172	8.211	1	(65)	(64)	0,00
UAG	07.2021	32	42	0	0	0	0,00
				\$ 36	\$ (1.354)	\$ (1.318)	(0,02)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 14.293	0,16
Summe Anlagen						\$ 9.961.273	108,65
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (792.868)	(8,65)
Nettovermögen						\$ 9.168.405	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 999.734 als Sicherheiten verpfändet.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 43.634 und Barmittel in Höhe von USD 76.550 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 685 und Barmittel in Höhe von USD 5.341 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 79.994 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 154.127	\$ 8.835.666	\$ 22.789	\$ 9.012.582
Investmentfonds	0	838.364	0	838.364
Pensionsgeschäfte	0	98.000	0	98.000
Finanzderivate ⁽³⁾	(6.030)	18.357	0	12.327
Summen	\$ 148.097	\$ 9.790.387	\$ 22.789	\$ 9.961.273

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.102	\$ 9.024.814	\$ 0	\$ 9.025.916
Investmentfonds	163.747	613.822	0	777.569
Pensionsgeschäfte	0	139.444	0	139.444
Finanzderivate ⁽³⁾	(2.464)	(9.914)	0	(12.378)
Summen	\$ 162.385	\$ 9.768.166	\$ 0	\$ 9.930.551

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

(1) 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten	
					Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	0,310 %	24.06.2021	24.09.2021	\$ (112.914)	\$ (112.921)	(1,23)
	0,350	24.06.2021	24.09.2021	(78.204)	(78.209)	(0,85)
BPS	(1,750)	14.06.2021	TBD (1)	€ (2.967)	(3.516)	(0,04)
	(1,750)	30.06.2021	TBD (1)	(2.513)	(2.980)	(0,03)
	(0,850)	30.06.2021	TBD (1)	(5.062)	(6.003)	(0,07)
	(0,800)	22.04.2021	TBD (1)	(2.284)	(2.704)	(0,03)
	(0,340)	24.06.2021	24.09.2021	(100.063)	(118.657)	(1,29)
	(0,300)	12.04.2021	12.07.2021	(60.896)	(72.168)	(0,79)
	(0,300)	18.06.2021	TBD (1)	\$ (3.085)	(3.085)	(0,03)
	(0,300)	21.06.2021	TBD (1)	(1.030)	(1.030)	(0,01)
	0,350	24.05.2021	27.08.2021	(20.073)	(20.081)	(0,22)
	0,350	22.06.2021	23.09.2021	(147.318)	(147.331)	(1,61)
BRC	0,350	25.06.2021	23.09.2021	(73.531)	(73.535)	(0,80)
	0,380	23.04.2021	23.07.2021	(81.160)	(81.219)	(0,89)
IND	0,380	03.05.2021	23.07.2021	(4.787)	(4.790)	(0,05)
	0,230	25.05.2021	24.08.2021	(47.622)	(47.633)	(0,52)
	0,290	26.04.2021	26.07.2021	(41.590)	(41.612)	(0,45)
	0,290	27.04.2021	27.07.2021	(29.287)	(29.302)	(0,32)
	0,290	30.04.2021	26.07.2021	(5.120)	(5.123)	(0,06)
	0,290	30.04.2021	28.07.2021	(4.802)	(4.804)	(0,05)
	0,290	14.06.2021	26.07.2021	(3.096)	(3.096)	(0,03)
	0,390	26.04.2021	26.07.2021	(9.563)	(9.570)	(0,11)
JML	0,390	27.04.2021	27.07.2021	(15.362)	(15.373)	(0,17)
	0,390	29.04.2021	28.07.2021	(29.438)	(29.458)	(0,32)
	(1,000)	02.03.2021	TBD (1)	(4.932)	(4.915)	(0,05)
	(1,000)	09.03.2021	TBD (1)	(2.464)	(2.456)	(0,03)
	(1,000)	29.06.2021	TBD (1)	(2.593)	(2.593)	(0,03)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (924.164)	(10,08)

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 40.410	\$ (35.750)	\$ 4.660
BPS	(41.948)	36.820	(5.128)
BRC	56.606	(49.580)	7.026
CBK	(739)	491	(248)
GLM	(2.266)	1.822	(444)
GST	1.429	(1.630)	(201)
HUS	4.510	(3.170)	1.340
JPM	71	0	71
MYC	0	(570)	(570)
MYI	(944)	500	(444)
RBC	20.261	(17.880)	2.381
RYL	67	0	67
SCX	(46.339)	40.821	(5.518)
SSB	620	(270)	350
TOR	(45.176)	39.730	(5.446)
UAG	27.731	(24.750)	2.981

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	90,24	95,52
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	8,06	17,78
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,12
Investmentfonds	9,14	9,77
Pensionsgeschäfte	1,07	1,75
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,16	(0,11)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(10,08)	(26,77)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Österreich	1,42	1,50
Belgien	1,03	1,97
Kanada	0,59	0,43
Dänemark	0,48	0,47
Finnland	1,08	1,13
Frankreich	6,96	7,32
Deutschland	4,01	4,34
Hongkong	0,12	k. A.
Irland	2,99	3,04
Italien	8,29	8,99
Jersey, Kanalinseln	1,49	1,81
Luxemburg	1,26	0,42
Mexiko	0,27	0,31
Niederlande	13,83	15,00
Norwegen	0,08	k. A.
Portugal	0,12	0,14
Slowenien	0,48	0,54
Spanien	9,70	11,74
Schweden	0,27	0,41
Schweiz	7,92	8,81
Großbritannien	22,86	26,12
USA	2,64	3,40
Kurzfristige Instrumente	10,41	15,53
Investmentfonds	9,14	9,77
Pensionsgeschäfte	1,07	1,75
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	(0,03)	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,01
Total Return Swaps auf Wertpapiere	(0,02)	(0,03)
Devisenterminkontrakte	1,68	(1,16)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,52)	1,08
Sonstige Aktiva und Passiva	(8,65)	(24,78)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Climate Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE												
AUSTRALIEN												
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL												
Lendlease Finance Ltd.				Banque Federative du Credit Mutuel S.A.	100	118	0,05	Yanlord Land HK Co. Ltd.	500	511	0,20	
3,400 % fällig am 27.10.2027	AUD	930	0,29	0,250 % fällig am 29.06.2028				5,125 % fällig am 20.05.2026				
3,700 % fällig am 31.03.2031		200	0,06	BNP Paribas S.A.	4.400	5.301	2,04	Summe Hongkong		1.384	0,53	
Summe Australien		900	0,35	0,500 % fällig am 04.06.2026				INDIEN				
				4,625 % fällig am 25.02.2031 (d)(e)				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				\$	1.200	1.252	0,48	ReNew Power Pvt Ltd.				
				CNP Assurances	200	247	0,09	4,500 % fällig am 14.07.2028	1.700	1.733	0,67	
				2,000 % fällig am 27.07.2050				5,875 % fällig am 05.03.2027	1.400	1.497	0,57	
				4,875 % fällig am 07.10.2030 (d)(e)	800	841	0,32	Wipro IT Services LLC	200	200	0,08	
				\$				1,500 % fällig am 23.06.2026				
				Credit Agricole S.A.	500	583	0,22	Summe Indien		3.430	1,32	
				0,125 % fällig am 09.12.2027				IRLAND				
				0,375 % fällig am 21.10.2025	100	120	0,05	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				Danone S.A.	900	965	0,37	AIB Group PLC				
				2,947 % fällig am 02.11.2026				2,875 % fällig am 30.05.2031	€	600	0,29	
				Electricite de France S.A.	600	716	0,28	Bank of Ireland Group PLC				
				2,625 % fällig am 01.12.2027 (d)				0,375 % fällig am 10.05.2027	400	472	0,18	
				3,625 % fällig am 13.10.2025	400	440	0,17	Cyrusone Europe Finance DAC				
				Faurecia SE	1.200	1.452	0,56	1,125 % fällig am 26.05.2028	900	1.062	0,41	
				2,375 % fällig am 15.06.2029				Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.				
				Ile-de-France Mobilites	800	958	0,37	3,000 % fällig am 19.04.2051	\$	650	0,25	
				0,400 % fällig am 28.05.2031				Summe Irland		2.940	1,13	
				SEB S.A.	600	735	0,28	ITALIEN				
				1,375 % fällig am 16.06.2025				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				Valeo S.A.	600	738	0,28	Assicurazioni Generali SpA				
				1,625 % fällig am 18.03.2026				4,125 % fällig am 04.05.2026	€	1.400	0,75	
				Verallia S.A.	1.100	1.320	0,51	Intesa Sanpaolo SpA				
				1,625 % fällig am 14.05.2028		17.345	6,67	0,750 % fällig am 04.12.2024	600	730	0,28	
				STAATSEMISSIONEN				0,750 % fällig am 16.03.2028	1.400	1.671	0,64	
				Agence Francaise de Developpement	1.000	1.254	0,48	Unipol Gruppo SpA	1.500	2.006	0,77	
				1,375 % fällig am 17.09.2024				3,250 % fällig am 23.09.2030		6.356	2,44	
				France Government International Bond	850	963	0,37	STAATSEMISSIONEN				
				0,500 % fällig am 25.06.2044				Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
				Societe Du Grand Paris EPIC	100	109	0,04	1,500 % fällig am 30.04.2045	1.050	1.210	0,47	
				1,000 % fällig am 18.02.2070				Summe Italien		7.566	2,91	
				Societe Nationale SNCF S.A.	800	981	0,38	JAPAN				
				0,625 % fällig am 17.04.2030		3.307	1,27	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				Summe Frankreich		20.652	7,94	Central Japan Railway Co.				
				DEUTSCHLAND				2,200 % fällig am 02.10.2024	\$	1.480	1,540	0,59
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
				Continental AG	325	428	0,16	0,848 % fällig am 19.07.2029	€	800	981	0,38
				2,500 % fällig am 27.08.2026			Nidec Corp.					
				Deutsche Bahn Finance GmbH	50	53	0,02	0,046 % fällig am 30.03.2026	1.400	1.661	0,64	
				0,625 % fällig am 08.12.2050			Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.					
				Infineon Technologies AG	200	264	0,10	0,508 % fällig am 12.01.2024	\$	1.000	996	0,38
				2,000 % fällig am 24.06.2032			0,934 % fällig am 11.10.2024	€	500	613	0,24	
				Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	100	120	0,05	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
				0,000 % fällig am 15.09.2028 (b)			1,550 % fällig am 25.03.2026	\$	900	913	0,35	
				0,750 % fällig am 30.09.2030	\$	2.100	1,973	0,76	Summe Japan		6.704	2,58
				ProGroup AG	1.000	1.201	0,46	STAATSEMISSIONEN				
				3,000 % fällig am 31.03.2026				Development Bank of Japan, Inc.				
				Schaeffler AG	1.700	2.227	0,86	0,010 % fällig am 15.10.2024	€	300	359	0,14
				3,375 % fällig am 12.10.2028		6.266	2,41	Japan Finance Organization for Municipalities				
				STAATSEMISSIONEN				0,010 % fällig am 02.02.2028	400	475	0,18	
				Bundesrepublik Deutschland	55	67	0,02	Summe Japan		7.538	2,90	
				0,000 % fällig am 15.08.2030 (b)				JERSEY, KANALINSELN				
				Land Nordrhein-Westfalen	20	23	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				0,000 % fällig am 12.10.2035 (b)		90	0,03	Aptiv PLC				
				Summe Deutschland		6.356	2,44	4,350 % fällig am 15.03.2029	\$	1.000	1.153	0,44
				HONGKONG				LUXEMBURG				
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				MTR Corp. Ltd.	900	873	0,33	Acef Holding S.C.A.				
				1,625 % fällig am 19.08.2030			0,750 % fällig am 14.06.2028	€	1.500	1.775	0,68	
				FRANKREICH								
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								
				AXA S.A.	600	712	0,27					
				1,375 % fällig am 07.10.2041								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan				SÜDKOREA				Chanel Ceres PLC			
European Core Fund				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,000 % fällig am 31.07.2031	€ 1.600	1.908	0,73
0,500 % fällig am 27.01.2028	€ 600	\$ 705	0,27	KB Kookmin Card Co. Ltd.				Grainger PLC			
CPI Property Group S.A.				1,500 % fällig am 13.05.2026	1.400	1.395	0,54	3,000 % fällig am 03.07.2030	£ 100	146	0,06
2,750 % fällig am 12.05.2026	1.100	1.422	0,55	Kia Corp.				3,375 % fällig am 24.04.2028	700	1.048	0,40
2,750 % fällig am 22.01.2028	£ 900	1.274	0,49	1,000 % fällig am 16.04.2024	900	905	0,35	HSBC Holdings PLC			
Prologis International Funding S.A.				Mirae Asset Securities Co. Ltd.				3,033 % fällig am 22.11.2023	\$ 400	414	0,16
0,750 % fällig am 23.03.2033	€ 475	553	0,21	1,375 % fällig am 07.07.2024 (a)	1.100	1.100	0,42	Marks & Spencer PLC			
0,875 % fällig am 09.07.2029	125	153	0,06	SK Hynix, Inc.				3,750 % fällig am 19.05.2026	£ 800	1.151	0,44
1,625 % fällig am 17.06.2032	1.425	1.830	0,70	2,375 % fällig am 19.01.2031	300	293	0,11	4,500 % fällig am 10.07.2027	300	444	0,17
SELP Finance SARL				Summe Südkorea		3.693	1,42	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC			
0,875 % fällig am 27.05.2029	1.000	1.189	0,46				1,750 % fällig am 19.05.2032	500	703	0,27	
Summe Luxemburg		8.901	3,42	SPANIEN				Santander UK Group Holdings PLC			
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,896 % fällig am 15.03.2032	\$ 3.400	3.507	1,35
MAURITIUS				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				Standard Chartered PLC			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,375 % fällig am 14.05.2025	€ 600	748	0,29	1,214 % fällig am 23.03.2025	1.600	1.608	0,62
Greenko Solar Mauritius Ltd.				Banco de Sabadell S.A.				Tesco Corporate Treasury Services PLC			
5,950 % fällig am 29.07.2026	\$ 1.400	1.511	0,58	0,875 % fällig am 16.06.2028	1.500	1.754	0,67	0,375 % fällig am 27.07.2029	€ 1.300	1.507	0,58
India Green Power Holdings				Banco Santander S.A.				Travis Perkins PLC			
4,000 % fällig am 22.02.2027	400	403	0,15	0,625 % fällig am 24.06.2029	900	1.067	0,41	3,750 % fällig am 17.02.2026	£ 600	882	0,34
Summe Mauritius		1.914	0,73	Bankinter S.A.				Vmed O2 UK Financing PLC			
				0,625 % fällig am 06.10.2027	400	479	0,18	4,750 % fällig am 15.07.2031 (a)	\$ 2.400	2.442	0,94
MULTINATIONAL				CaixaBank S.A.				Vodafone Group PLC			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,375 % fällig am 18.11.2026	400	475	0,18	5,125 % fällig am 04.06.2081	700	708	0,27
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC				0,500 % fällig am 09.02.2029	100	117	0,05	Workspace Group PLC			
2,000 % fällig am 01.09.2028	€ 500	595	0,23	0,750 % fällig am 26.05.2028	900	1.074	0,41	2,250 % fällig am 11.03.2028	£ 400	550	0,21
3,000 % fällig am 01.09.2029	150	178	0,07	1,500 % fällig am 03.12.2026	£ 600	831	0,32	Summe Großbritannien		22.506	8,65
NXP BV				Iberdrola Finanzas S.A.							
2,500 % fällig am 11.05.2031	\$ 1.200	1.214	0,46	1,000 % fällig am 07.03.2024	€ 1.100	1.345	0,52	USA			
Summe multinational		1.987	0,76			7.890	3,03	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
				STAATSEMISSIONEN				GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust			
NIEDERLANDE				Xunta de Galicia				2,100 % fällig am 20.05.2048	\$ 1.300	1.292	0,50
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,084 % fällig am 30.07.2027	50	59	0,02	Loanpal Solar Loan Ltd.			
Atrium Finance Issuer BV				Summe Spanien		7.949	3,05	2,220 % fällig am 20.03.2048	751	760	0,29
2,625 % fällig am 05.09.2027	€ 1.100	1.412	0,54								
BMW Finance NV				ÜBERNATIONAL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
0,000 % fällig am 11.01.2026 (b)	200	238	0,09	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				AES Corp.			
Citycon Treasury BV				EUROFIMA				1,375 % fällig am 15.01.2026	300	297	0,11
1,625 % fällig am 12.03.2028	1.500	1.786	0,69	0,000 % fällig am 28.07.2026 (b)	100	120	0,05	2,450 % fällig am 15.01.2031	1.859	1.842	0,71
Cooperative Rabobank UA				0,010 % fällig am 23.06.2028	2.000	2.382	0,92	Alexandria Real Estate Equities, Inc.			
1,004 % fällig am 24.09.2026	\$ 900	889	0,34	0,150 % fällig am 10.10.2034	500	572	0,22	2,000 % fällig am 18.05.2032	400	390	0,15
CTP NV				Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				3,000 % fällig am 18.05.2051	900	883	0,34
1,250 % fällig am 21.06.2029	€ 2.300	2.699	1,04	1,500 % fällig am 13.02.2025	\$ 1.240	1.276	0,49	Allstate Corp.			
Digital Intrepid Holding BV				0,750 % fällig am 15.07.2027	AUD 500	364	0,14	1,450 % fällig am 15.12.2030	250	239	0,09
0,625 % fällig am 15.07.2031	900	1.033	0,40	Europäische Investitionsbank				Avangrid, Inc.			
DSV Panalpina Finance BV				0,750 % fällig am 15.07.2027				3,150 % fällig am 01.12.2024	1.200	1.284	0,49
0,500 % fällig am 03.03.2031	500	590	0,23	Europäische Union				3,800 % fällig am 01.06.2029	1.965	2.220	0,85
Enel Finance International NV				0,300 % fällig am 04.11.2050	€ 100	108	0,04	Bank of America Corp.			
0,000 % fällig am 17.06.2027 (b)	600	703	0,27	Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				0,981 % fällig am 25.09.2025	2.700	2.700	1,04
2,650 % fällig am 10.09.2024	\$ 1.200	1.262	0,48	2,125 % fällig am 03.03.2025	\$ 1.000	1.053	0,40	2,456 % fällig am 22.10.2025	100	105	0,04
Givaudan Finance Europe BV				Summe übernational		5.875	2,26	Boise Cascade Co.			
1,000 % fällig am 22.04.2027	€ 300	375	0,14				4,875 % fällig am 01.07.2030	300	319	0,12	
Global Switch Finance BV				SCHWEDEN				Boston Properties LP			
1,375 % fällig am 07.10.2030	400	485	0,19	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,550 % fällig am 01.04.2032	900	907	0,35
ING Groep NV				Castellum AB				3,400 % fällig am 21.06.2029	1.400	1.522	0,59
1,125 % fällig am 07.12.2028	£ 200	271	0,10	0,750 % fällig am 04.09.2026	€ 1.100	1.314	0,51	Bush Foundation			
4,625 % fällig am 06.01.2026	\$ 1.700	1.941	0,75	EQT AB				2,754 % fällig am 01.10.2050	125	126	0,05
4,875 % fällig am 16.05.2029 (d)(e)	2.300	2.408	0,92	0,875 % fällig am 14.05.2031	1.200	1.414	0,54	CBRE Services, Inc.			
LeasePlan Corp. NV				Summe Schweden		2.728	1,05	2,500 % fällig am 01.04.2031	870	882	0,34
0,250 % fällig am 23.02.2026	€ 2.000	2.365	0,91	SCHWEIZ				Chubb INA Holdings, Inc.			
1,375 % fällig am 07.03.2024	100	123	0,05	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,875 % fällig am 15.06.2027	€ 600	738	0,28
3,500 % fällig am 09.04.2025	700	935	0,36	UBS AG				Citigroup, Inc.			
Lseg Netherlands BV				5,125 % fällig am 15.05.2024 (e)	\$ 2.600	2.872	1,10	3,875 % fällig am 18.02.2026 (d)	\$ 400	410	0,16
0,000 % fällig am 06.04.2025 (b)	100	119	0,05	GROSSBRITANNIEN				Clearway Energy Operating LLC			
0,250 % fällig am 06.04.2028	400	474	0,18	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,750 % fällig am 15.02.2031	1.100	1.096	0,42
Wabtec Transportation Netherlands BV				Assura Financing PLC				4,750 % fällig am 15.03.2028	100	105	0,04
1,250 % fällig am 03.12.2027	1.900	2.274	0,87	1,625 % fällig am 30.06.2033	£ 1.100	1.509	0,58				
Summe Niederlande		22.382	8,60	Atlantica Sustainable Infrastructure PLC							
				4,125 % fällig am 15.06.2028	\$ 900	\$918	0,35				
SINGAPUR				Barclays PLC							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,625 % fällig am 14.11.2023	€ 800	960	0,37				
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.				British Land Co. PLC							
4,250 % fällig am 25.03.2027	\$ 700	714	0,27	2,375 % fällig am 14.09.2029	£ 900	1.274	0,49				
Continuum Energy Levanter Pte. Ltd.				Burberry Group PLC							
4,500 % fällig am 09.02.2027	\$ 200	\$205	0,08	1,125 % fällig am 21.09.2025	600	827	0,32				
Summe Singapur		919	0,35								

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
5,000 % fällig am 15.09.2026	\$ 900			Mississippi Power Co. 3,100 % fällig am 30.07.2051	\$ 900	\$ 909	0,35	0,840 % fällig am 20.03.2026	\$ 800	815	0,31
Community Preservation Corp. 2,867 % fällig am 01.02.2030	360	376	0,14	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	2.100	2.126	0,82	1,500 % fällig am 18.09.2030	4.110	3.932	1,51
Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 3,350 % fällig am 01.04.2030	1.025	1.128	0,43	2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD 3.150	2.384	0,92	Wells Fargo & Co. 0,805 % fällig am 19.05.2025	900	898	0,35
3,950 % fällig am 01.04.2050	725	825	0,32	4,800 % fällig am 01.12.2077	\$ 300	337	0,13	Weyerhaeuser Co. 7,375 % fällig am 15.03.2032	440	636	0,24
Continental Wind LLC 6,000 % fällig am 28.02.2033	387	445	0,17	Northern States Power Co. 2,250 % fällig am 01.04.2031	600	618	0,24	Xylem, Inc. 2,250 % fällig am 30.01.2031	500	504	0,19
Crown Cork & Seal Co., Inc. 7,375 % fällig am 15.12.2026	725	891	0,34	2,600 % fällig am 01.06.2051	200	191	0,07			82.918	31,86
Dell International LLC 4,900 % fällig am 01.10.2026	250	289	0,11	NSTAR Electric Co. 3,100 % fällig am 01.06.2051	1.070	1.110	0,43	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL			
6,200 % fällig am 15.07.2030	1.000	1.287	0,49	Owens Corning 3,950 % fällig am 15.08.2029	110	124	0,05	New York Water & Sewer System, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
Digital Euro Finco LLC 2,500 % fällig am 16.01.2026	€ 100	130	0,05	PayPal Holdings, Inc. 2,400 % fällig am 01.10.2024	900	948	0,36	5,724 % fällig am 15.06.2042	170	255	0,10
DTE Electric Co. 1,900 % fällig am 01.04.2028	\$ 2.200	2.236	0,86	Pfizer, Inc. 2,625 % fällig am 01.04.2030	75	80	0,03	New York Water & Sewer System, New York Revenue Bonds, Series 2010			
Equinix, Inc. 1,000 % fällig am 15.03.2033	€ 500	588	0,23	Public Service Co. of Colorado 2,700 % fällig am 15.01.2051	75	73	0,03	5,882 % fällig am 15.06.2044	110	171	0,06
1,550 % fällig am 15.03.2028	\$ 620	610	0,23	3,200 % fällig am 01.03.2050	25	27	0,01	San Francisco, California Public Utilities Commission Water Revenue Bonds, Series 2020			
2,500 % fällig am 15.05.2031	700	713	0,27	3,700 % fällig am 15.06.2028	1.000	1.130	0,43	1,988 % fällig am 01.11.2031	255	259	0,10
Farmers Exchange Capital 5,454 % fällig am 15.10.2054	30	38	0,01	Radian Group, Inc. 6,625 % fällig am 15.03.2025	1.300	1.469	0,56	2,825 % fällig am 01.11.2041	150	152	0,06
Gap, Inc. 8,625 % fällig am 15.05.2025	700	769	0,30	Rayonier LP 2,750 % fällig am 17.05.2031	300	303	0,12	State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020			
8,875 % fällig am 15.05.2027	1.000	1.160	0,45	Regency Centers LP 2,950 % fällig am 15.09.2029	1.900	2.003	0,77	2,154 % fällig am 01.07.2030	170	173	0,07
Georgia Power Co. 3,250 % fällig am 15.03.2051	800	809	0,31	3,700 % fällig am 15.06.2030	200	222	0,09			1.010	0,39
Hanwha Energy USA Holdings Corp. 2,375 % fällig am 30.07.2022	400	407	0,16	salesforce.com, Inc. 1,500 % fällig am 15.07.2028 (a)	750	749	0,29	US-SCHATZOBIGLATIONEN			
HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	1.500	1.513	0,58	Solar Star Funding LLC 5,375 % fällig am 30.06.2035	171	193	0,07	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	7.490	7.356	2,83
3,750 % fällig am 15.09.2030	2.700	2.645	1,02	Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	1.800	1.806	0,69	Summe USA		93.336	35,87
6,000 % fällig am 15.04.2025	500	529	0,20	Southern Power Co. 0,900 % fällig am 15.01.2026	200	196	0,08	JUNGFERNINSELN (BRITISCH) UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 4,000 % fällig am 01.05.2031	1.000	1.010	0,39	Southwestern Public Service Co. 3,150 % fällig am 01.05.2050	250	262	0,10	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	887	1.010	0,39
4,875 % fällig am 15.01.2030	1.200	1.283	0,49	Sprint Corp. 7,250 % fällig am 15.09.2021	500	508	0,20	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE KURZFRISTIGE SCHULDITITEL			
Host Hotels & Resorts LP 3,500 % fällig am 15.09.2030	2.075	2.180	0,84	Starwood Property Trust, Inc. 3,625 % fällig am 15.07.2026 (a)	1.000	1.009	0,39	Federal Home Loan Bank 0,008 % fällig am 27.08.2021 (b)(c)	1.900	1.900	0,73
Host Hotels & Resorts LP 3,500 % fällig am 15.09.2030	2.075	2.180	0,84	T-Mobile USA, Inc. 2,625 % fällig am 15.04.2026	1.900	1.947	0,75	U.S. TREASURY BILLS 0,020 % fällig am 28.09.2021 (b)(c)			
JPMorgan Chase & Co. 0,653 % fällig am 16.09.2024	900	901	0,35	TerraForm Power Operating LLC 5,000 % fällig am 31.01.2028	1.650	1.752	0,67	0,030 % fällig am 05.10.2021 (b)(c)	5.500	5.500	2,12
Kaiser Foundation Hospitals 2,810 % fällig am 01.06.2041	1.500	1.533	0,59	Topaz Solar Farms LLC 5,750 % fällig am 30.09.2039	887	1.030	0,40	0,041 % fällig am 23.09.2021 (b)(c)(f)	1.800	1.800	0,69
Kellogg Co. 0,500 % fällig am 20.05.2029	€ 900	1.068	0,41	UDR, Inc. 1,900 % fällig am 15.03.2033	900	843	0,32	0,056 % fällig am 16.09.2021 (b)(c)(f)	4.400	4.399	1,69
Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032	\$ 3.300	3.263	1,25	3,100 % fällig am 01.11.2034	150	158	0,06			17.299	6,65
Kimco Realty Corp. 2,700 % fällig am 01.10.2030	1.125	1.158	0,45	Union Electric Co. 2,150 % fällig am 15.03.2032	300	301	0,12	Summe kurzfristige Instrumente		19.199	7,38
Leeward Renewable Energy Operations LLC 4,250 % fällig am 01.07.2029 (a)	700	711	0,27	Verizon Communications, Inc. 0,375 % fällig am 22.03.2029	€ 800	\$ 941	0,36	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 264.442	101,63
Liberty Utilities Finance GP 2,050 % fällig am 15.09.2030	2.475	2.391	0,92								
MidAmerican Energy Co. 4,250 % fällig am 15.07.2049	400	505	0,19								

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	171	\$ (172)	(0,07)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	8	(34)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	465	(108)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	203	206	0,08
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	22	(203)	(0,08)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	66	(49)	(0,02)
				\$ (360)	(0,14)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (360)	(0,14)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250 %	15.09.2026	€ 3.500	\$ 16	0,01
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2021	2.400	(12)	(0,01)
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2021	£ 1.100	(27)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 6.400	(10)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,943	15.06.2021	\$ 400	(13)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,945	23.06.2021	100	(3)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,968	23.06.2021	200	(7)	0,00
					\$ (56)	(0,02)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (56)	(0,02)

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 100,156	05.08.2021	600	\$ 6	\$ 2	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	600	6	2	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	1.100	6	4	0,00
					\$ 18	\$ 8	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018 %	06.07.2021	500	\$ (4)	\$ (10)	(0,01)
DUB	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	23.07.2021	500	(3)	(4)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	23.07.2021	500	(3)	(2)	0,00
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	06.07.2021	500	(4)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	21.07.2021	200	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	21.07.2021	200	(2)	(1)	0,00
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,019	02.07.2021	200	(1)	(5)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,022	02.07.2021	200	(1)	0	0,00
						\$ (20)	\$ (23)	(0,01)	

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
JPM	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	\$ 102,234	12.08.2021	3.700	\$ (12)	\$ (6)	(0,01)
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	2.500	(8)	(4)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	1.200	(8)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	1.200	(7)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	900	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	2.200	(7)	(3)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	900	(2)	(1)	0,00
					\$ (47)	\$ (19)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	08.2021	CAD 49	\$ 41	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	08.2021	€ 63.007	76.544	1.755	0	1.755	0,69
	08.2021	£ 551	779	18	0	18	0,01
	08.2021	\$ 509	€ 426	0	(3)	(3)	0,00
BPS	08.2021	AUD 3.356	\$ 2.620	100	0	100	0,04
	08.2021	£ 1.193	1.652	4	0	4	0,00
	08.2021	\$ 583	SEK 4.870	0	(13)	(13)	(0,01)
BRC	08.2021	€ 3.009	\$ 3.601	29	0	29	0,01
CBK	08.2021	841	1.005	7	0	7	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
GLM	08.2021	€ 2.298	\$ 2.789	\$ 61	\$ 0	\$ 61	0,02
JPM	08.2021	5.576	6.781	163	0	163	0,06
MYI	07.2021	175	209	1	0	1	0,00
	07.2021	£ 186	258	1	0	1	0,00
	07.2021	SGD 41	30	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 152	€ 128	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	2	£ 1	0	0	0	0,00
	08.2021	AUD 918	\$ 709	19	0	19	0,01
SSB	08.2021	£ 7.203	0.124	173	0	173	0,07
UAG	08.2021	AUD 591	447	3	0	3	0,00
	08.2021	€ 1.385	1.689	45	0	45	0,02
				\$ 2.380	\$ (17)	\$ 2.363	0,92

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 374	CHF 336	\$ 0	\$ (11)	\$ (11)	(0,01)
BPS	07.2021	3	2	0	0	0	0,00
BRC	07.2021	114	103	0	(3)	(3)	0,00
CBK	07.2021	CHF 338	\$ 367	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 254	CHF 228	0	(8)	(8)	0,00
	08.2021	368	338	0	(1)	(1)	0,00
MYI	07.2021	372	336	0	(9)	(9)	0,00
SSB	07.2021	4	3	0	0	0	0,00
				\$ 1	\$ (32)	\$ (31)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€ 360	\$ 430	\$ 3	0	\$ 3	0,00
	07.2021	\$ 454	€ 373	0	(11)	(11)	(0,01)
BPS	07.2021	€ 211	€ 256	6	0	6	0,00
	07.2021	\$ 67.143	€ 54.889	0	(2.049)	(2.049)	(0,79)
BRC	07.2021	3.732	3.055	0	(110)	(110)	(0,04)
GLM	07.2021	6.506	5.460	0	(31)	(31)	(0,01)
JPM	07.2021	226	188	0	(3)	(3)	0,00
MYI	07.2021	€ 126	\$ 150	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 89	€ 73	0	(2)	(2)	0,00
RBC	07.2021	74.214	60.664	0	(2.273)	(2.273)	(0,87)
SCX	07.2021	79.809	65.247	0	(2.434)	(2.434)	(0,94)
SSB	07.2021	282	232	0	(7)	(7)	0,00
				\$ 10	\$ (6.920)	\$ (6.910)	(2,66)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	\$ 318	£ 227	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
BRC	07.2021	£ 77	\$ 107	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 77	£ 55	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2021	6.524	4.615	0	(149)	(149)	(0,06)
JPM	07.2021	434	309	0	(7)	(7)	0,00
MYI	07.2021	£ 1	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 130	£ 93	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2021	£ 5.294	\$ 7.323	10	0	10	0,00
	07.2021	\$ 6.654	£ 4.681	0	(187)	(187)	(0,07)
	08.2021	7.324	5.294	0	(10)	(10)	0,00
SSB	07.2021	£ 5.294	\$ 7.316	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 676	£ 479	0	(15)	(15)	(0,01)
	08.2021	7.316	5.294	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07.2021	6.538	4.615	0	(163)	(163)	(0,06)
				\$ 12	\$ (541)	\$ (529)	(0,20)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 667	\$ 497	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	08.2021	\$ 497	SGD 667	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2021	430	571	0	(5)	(5)	(0,01)
	08.2021	4	6	0	0	0	0,00
MYI	07.2021	SGD 669	\$ 497	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 497	SGD 669	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	369	489	0	(5)	(5)	0,00
SSB	07.2021	341	453	0	(4)	(4)	0,00
UAG	07.2021	361	478	0	(5)	(5)	0,00
				\$ 1	\$ (20)	\$ (19)	(0,01)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (5.160)	(1,98)
Summe Anlagen						\$ 258.866	99,49
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 1.339	0,51
Nettovermögen						\$ 260.205	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Wertpapier per Emissionstermin.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- Bedingt wandelbares Wertpapier.
- Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.229 und Barmittel in Höhe von USD 3.580 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 2.184 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 263.149	\$ 1.293	\$ 264.442
Finanzderivate ⁽³⁾	(255)	(5.321)	0	(5.576)
Summen	\$ (255)	\$ 257.828	\$ 1.293	\$ 258.866

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 88.461	\$ 0	\$ 88.461
Pensionsgeschäfte	0	12.100	0	12.100
Finanzderivate ⁽³⁾	13	430	0	443
Summen	\$ 13	\$ 100.991	\$ 0	\$ 101.004

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 1.752	\$ (1.400)	\$ 352
BPS	(1.957)	1.590	(367)
BRC	(85)	0	(85)
CBK	(11)	0	(11)
DUB	(6)	0	(6)
GLM	(126)	0	(126)
JPM	142	0	142
MYC	(5)	0	(5)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
MYI	\$ 8	\$ 0	\$ 8
RBC	(2.273)	1.990	(283)
SCX	(2.626)	2.229	(397)
SSB	147	0	147
UAG	(120)	0	(120)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	80,54	70,37
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	21,03	15,10
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,06	1,37
Pensionsgeschäfte	k. A.	11,88
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,14)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,02)	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,98)	0,42

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Australien	0,35	0,74
Österreich	0,32	k. A.
Belgien	0,14	0,37
Brasilien	0,87	k. A.
Kanada	1,24	0,94
Chile	1,13	0,63
Dänemark	0,18	0,45
Finnland	2,76	1,97
Frankreich	7,94	5,19
Deutschland	2,44	3,31
Hongkong	0,53	0,88
Indien	1,32	0,94
Irland	1,13	1,18
Italien	2,91	3,93
Japan	2,90	1,79
Jersey, Kanalinseln	0,44	k. A.
Luxemburg	3,42	2,25
Mauritius	0,73	0,96
Multinational	0,76	k. A.
Niederlande	8,60	5,75
Singapur	0,35	k. A.
Südkorea	1,42	k. A.
Spanien	3,05	3,17
Supranational	2,26	3,17
Schweden	1,05	1,09
Schweiz	1,10	0,98
Großbritannien	8,65	7,17
USA	35,87	38,97
Jungferninseln (Britisch)	0,39	1,01
Kurzfristige Instrumente	7,38	k. A.
Pensionsgeschäfte	k. A.	11,88
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,14)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,02)	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,01)	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,92	(0,62)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,88)	1,04
Sonstige Aktiva und Passiva	0,51	0,85
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
AUSTRALIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Australia Government International Bond			
0,750 % fällig am 21.11.2027 (d) AUD	3.733	\$ 3.105	0,27
1,250 % fällig am 21.02.2022 (d)	5.907	4.517	0,40
3,000 % fällig am 20.09.2025 (d)	1.539	1.364	0,12
Summe Australien		8.986	0,79
KANADA			
STAATSEMISSIONEN			
Canadian Government Real Return Bond			
0,500 % fällig am 01.12.2050 (d) CAD	216	194	0,02
4,250 % fällig am 01.12.2026 (d)	2.556	2.661	0,23
Summe Kanada		2.855	0,25
CAYMAN INSELN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
1,530 % fällig am 16.01.2030	\$ 1.250	1.251	0,11
Atrium Corp.			
1,014 % fällig am 22.04.2027	453	453	0,04
Catamaran CLO Ltd.			
1,031 % fällig am 27.01.2028	530	530	0,05
1,444 % fällig am 22.04.2030	2.786	2.787	0,24
Dryden Senior Loan Fund			
1,084 % fällig am 15.10.2027	662	661	0,06
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.			
1,108 % fällig am 20.04.2027	50	50	0,00
Marathon CLO Ltd.			
1,019 % fällig am 21.11.2027	979	979	0,08
OCP CLO Ltd.			
0,984 % fällig am 15.07.2027	78	78	0,01
0,996 % fällig am 26.10.2027	533	533	0,05
TICP CLO Ltd.			
1,028 % fällig am 20.04.2028	1.113	1.113	0,10
Venture CLO Ltd.			
1,004 % fällig am 15.04.2027	443	443	0,04
1,064 % fällig am 15.07.2027	231	232	0,02
Z Capital Credit Partners CLO Ltd.			
1,134 % fällig am 16.07.2027	239	239	0,02
Summe Cayman Inseln		9.349	0,82
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Park Aerospace Holdings Ltd.			
5,250 % fällig am 15.08.2022	300	314	0,03
Summe Cayman Inseln		9.663	0,85
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Jyske Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050 DKK	32.185	4.945	0,43
1,000 % fällig am 01.10.2053	6.386	961	0,08
2,500 % fällig am 01.10.2047	1	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
0,500 % fällig am 01.10.2043	7.437	1.130	0,10
1,000 % fällig am 01.10.2050	13.789	2.121	0,19
2,500 % fällig am 01.10.2047	4	1	0,00
Nykredit Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	38.453	5.908	0,52
1,000 % fällig am 01.10.2053	26.817	4.020	0,35
1,500 % fällig am 01.10.2053	106.000	16.604	1,45
2,500 % fällig am 01.10.2047	18	3	0,00
Realkredit Danmark A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2053	5.286	795	0,07
2,500 % fällig am 01.04.2047	17	3	0,00
Summe Dänemark		36.491	3,19
STAATSEMISSIONEN			
Denmark Government International Bond			
0,100 % fällig am 15.11.2023 (d)	11.992	1.991	0,17
Summe Dänemark		38.482	3,36

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
FRANKREICH			
STAATSEMISSIONEN			
France Government International Bond			
0,100 % fällig am 25.07.2021 (d)	€ 6.754	\$ 8.032	0,70
0,250 % fällig am 25.07.2024 (d)	1.082	1.371	0,12
1,100 % fällig am 25.07.2022 (d)	9.131	11.223	0,98
2,100 % fällig am 25.07.2023 (d)	11.649	14.928	1,31
Summe Frankreich		35.554	3,11
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Deutsche Bank AG			
4,250 % fällig am 14.10.2021	\$ 1.700	1.719	0,15
GUERNSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.			
3,800 % fällig am 15.09.2022	400	416	0,04
Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust			
5,125 % fällig am 30.11.2024	43	43	0,00
Summe Guernsey, Kanalinseln		459	0,04
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Ares European CLO DAC			
0,660 % fällig am 15.10.2030	€ 1.400	1.659	0,15
Armada Euro CLO DAC			
0,720 % fällig am 15.07.2031	500	592	0,05
Black Diamond CLO DAC			
0,650 % fällig am 03.10.2029	223	265	0,02
1,244 % fällig am 03.10.2029	\$ 147	147	0,01
Black Diamond CLO Ltd.			
0,860 % fällig am 20.01.2032	€ 2.350	2.789	0,25
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC			
0,720 % fällig am 15.01.2031	1.600	1.895	0,17
1,050 % fällig am 15.01.2031	1.000	1.185	0,10
Carlyle Euro CLO DAC			
0,630 % fällig am 15.08.2030	800	948	0,08
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC			
0,700 % fällig am 15.01.2031	2.200	2.609	0,23
0,730 % fällig am 21.09.2029	119	141	0,01
0,750 % fällig am 15.11.2031	2.150	2.539	0,22
Dryden Euro CLO BV			
0,860 % fällig am 15.05.2034 (a)	2.400	2.846	0,25
Harvest CLO DAC			
0,630 % fällig am 18.11.2029	886	1.052	0,09
0,650 % fällig am 26.06.2030	1.600	1.895	0,17
0,760 % fällig am 15.07.2031	1.400	1.665	0,15
1,040 % fällig am 15.07.2031	700	832	0,07
Laurelin DAC			
0,720 % fällig am 20.10.2031	1.200	1.422	0,13
Man GLG Euro CLO DAC			
0,870 % fällig am 15.01.2030	250	296	0,03
OAK Hill European Credit Partners DAC			
0,740 % fällig am 20.10.2031	1.100	1.303	0,11
Segovia European CLO DAC			
0,880 % fällig am 20.07.2032 (a)	2.300	2.728	0,24
Tymon Park CLO DAC			
0,590 % fällig am 21.01.2029	133	158	0,01
Summe Irland		28.966	2,54
NON-AGENCY-MBS			
European Loan Conduit			
1,000 % fällig am 17.02.2030	599	714	0,06
Summe Irland		29.680	2,60
ITALIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			
0,400 % fällig am 15.05.2030 (d)	40.288	51.622	4,51
0,450 % fällig am 22.05.2023 (d)	3.516	4.279	0,37
1,400 % fällig am 26.05.2025 (d)	8.737	11.198	0,98
2,100 % fällig am 15.09.2021 (d)	7.842	9.375	0,82
2,350 % fällig am 15.09.2024 (d)	11.502	15.284	1,34

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
2,550 % fällig am 15.09.2041 (d)	€ 1.272	\$ 2.242	0,20
2,600 % fällig am 15.09.2023 (d)	10.332	13.379	1,17
Summe Italien		107.379	9,39
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Mitsubishi HC Capital, Inc.			
2,250 % fällig am 07.09.2021	\$ 200	201	0,02
3,406 % fällig am 28.02.2022	500	508	0,04
Summe Japan		709	0,06
STAATSEMISSIONEN			
Japan Government International Bond			
0,005 % fällig am 10.03.2031 (d)	¥ 613.020	5.650	0,50
0,100 % fällig am 10.03.2028 (d)	1.222.835	11.304	0,99
0,100 % fällig am 10.03.2029 (d)	3.064.024	28.393	2,48
0,200 % fällig am 10.03.2030 (d)	89.472	844	0,07
Summe Japan		46.191	4,04
NIEDERLANDE			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Ares European CLO DAC			
0,780 % fällig am 15.10.2031	€ 4.000	4.744	0,41
BNPP AM Euro CLO BV			
0,600 % fällig am 15.04.2031	1.600	1.897	0,16
Cairn CLO BV			
0,650 % fällig am 20.10.2028	163	194	0,02
0,780 % fällig am 15.10.2031	2.300	2.728	0,24
Jubilee CLO BV			
0,252 % fällig am 15.12.2029	2.614	3.090	0,27
Segovia European CLO			
0,870 % fällig am 15.04.2030	2.400	2.850	0,25
Summe Niederlande		15.503	1,35
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Syngenta Finance NV			
4,441 % fällig am 24.04.2023	\$ 400	422	0,04
Summe Niederlande		15.925	1,39
NEUSEELAND			
STAATSEMISSIONEN			
New Zealand Government International Bond			
2,000 % fällig am 20.09.2025 (d) NZD	2.761	2.141	0,19
PERU			
STAATSEMISSIONEN			
Peru Government International Bond			
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 2.200	629	0,05
6,150 % fällig am 12.08.2032	3.700	987	0,09
Summe Peru		1.616	0,14
KATAR			
STAATSEMISSIONEN			
Qatar Government International Bond			
3,875 % fällig am 23.04.2023	\$ 600	638	0,06
SAUDI-ARABIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Saudi Government International Bond			
4,000 % fällig am 17.04.2025	310	343	0,03
SPANIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)(g)	€ 400	513	0,04

Aufstellung der Wertpapieranlagen Commodity Real Return Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	
STAATSEMISSIONEN				
Autonomous Community of Catalonia 4,900 % fällig am 15.09.2021	€	200	\$ 240	0,02
Spain Government International Bond 0,150 % fällig am 30.11.2023 (d)		2.509	3.117	0,27
0,500 % fällig am 30.04.2030		2.500	3.021	0,27
0,700 % fällig am 30.11.2033 (d)		1.150	1.621	0,14
			7.999	0,70
Summe Spanien			8.512	0,74
SCHWEDEN				
STAATSEMISSIONEN				
Sweden Government International Bond 0,125 % fällig am 01.06.2026 (d)	SEK	2.603	332	0,03
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Natwest Group PLC 1,697 % fällig am 25.06.2024	\$	600	614	0,05
4,519 % fällig am 25.06.2024		400	430	0,04
			1.044	0,09
NON-AGENCY-MBS				
Canada Square Funding PLC 1,149 % fällig am 17.10.2051	£	1.490	2.070	0,18
Finsbury Square PLC 1,079 % fällig am 16.09.2069		1.181	1.642	0,14
Great Hall Mortgages PLC 0,210 % fällig am 18.03.2039		18	25	0,00
0,230 % fällig am 18.06.2038		21	29	0,00
Hawksmoor Mortgages PLC 1,099 % fällig am 25.05.2053		2.437	3.384	0,30
Towd Point Mortgage Funding PLC 1,111 % fällig am 20.10.2051		1.551	2.154	0,19
Twin Bridges PLC 1,199 % fällig am 12.06.2053		1.592	2.215	0,20
			11.519	1,01
AKTIEN				
VORZUGSWERTPAPIERE				
Nationwide Building Society 10,250 %		7.021	1.823	0,16
STAATSEMISSIONEN				
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026 (d)	£	10.840	17.313	1,51
0,125 % fällig am 10.08.2028 (d)		3.611	6.153	0,54
1,875 % fällig am 22.11.2022 (d)		2.927	4.365	0,38
			27.831	2,43
Summe Großbritannien			42.217	3,69
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 1,142 % fällig am 25.12.2033	\$	1.119		0,10
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,132 % fällig am 25.05.2034		97	90	0,01
Asset-Backed Funding Certificates Trust 0,692 % fällig am 25.10.2034		456	454	0,04
CIT Mortgage Loan Trust 1,442 % fällig am 25.10.2037		393	398	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust 0,382 % fällig am 25.09.2036		773	749	0,07
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,037 % fällig am 25.10.2034		501	500	0,04
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 0,782 % fällig am 25.10.2035 ^		800	776	0,07
CoreVest American Finance Trust 2,968 % fällig am 15.10.2049		30	30	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 0,887 % fällig am 25.02.2036		551	551	0,05

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS	
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 1,142 % fällig am 25.06.2035	\$	1.995	\$ 1.997	0,17
Ellington Loan Acquisition Trust 1,192 % fällig am 25.05.2037		816	819	0,07
First Franklin Mortgage Loan Trust 0,402 % fällig am 25.07.2036		234	230	0,02
1,367 % fällig am 25.07.2034		2.709	2.720	0,24
Home Equity Asset Trust 0,947 % fällig am 25.08.2034		139	139	0,01
1,112 % fällig am 25.03.2035		1.465	1.462	0,13
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 0,232 % fällig am 25.11.2036		903	851	0,07
Mid-State Capital Corp. Trust 5,787 % fällig am 15.10.2040		114	122	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,752 % fällig am 25.01.2035		401	401	0,04
1,067 % fällig am 25.07.2034		177	175	0,02
New Century Home Equity Loan Trust 0,857 % fällig am 25.02.2035		619	612	0,05
Option One Mortgage Loan Trust 0,632 % fällig am 25.01.2036		1.700	1.659	0,15
Renaissance Home Equity Loan Trust 1,292 % fällig am 25.11.2034		201	194	0,02
Residential Asset Securities Corp. Trust 0,977 % fällig am 25.08.2035		236	236	0,02
Saxon Asset Securities Trust 0,382 % fällig am 25.09.2036		3.000	2.888	0,25
0,402 % fällig am 25.09.2037		394	388	0,03
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 0,812 % fällig am 25.10.2035		1.495	1.397	0,12
Towd Point Mortgage Trust 2,750 % fällig am 25.10.2056		1.882	1.912	0,17
			22.866	2,00
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Broadcom, Inc. 3,459 % fällig am 15.09.2026		1.459	1.590	0,14
Charter Communications Operating LLC 4,464 % fällig am 23.07.2022		1.000	1.035	0,09
Conagra Brands, Inc. 3,250 % fällig am 15.09.2022		300	310	0,03
CVS Health Corp. 3,700 % fällig am 09.03.2023		41	43	0,00
Delta Air Lines, Inc. 3,625 % fällig am 15.03.2022		1.300	1.319	0,12
Lehman Brothers Holdings, Inc. 7,875 % fällig am 08.05.2018 ^	£	100	2	0,00
McDonald's Corp. 0,614 % fällig am 28.10.2021	\$	1.200	1.202	0,11
Nissan Motor Acceptance Corp. 1,900 % fällig am 14.09.2021		600	602	0,05
Penske Truck Leasing Co. LP 4,875 % fällig am 11.07.2022		700	730	0,06
Time Warner Cable LLC 4,000 % fällig am 01.09.2021		1.200	1.200	0,10
Volkswagen Group of America Finance LLC 0,994 % fällig am 24.09.2021		1.800	1.803	0,16
			9.836	0,86
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010 7,734 % fällig am 15.02.2033		200	300	0,03
Bay Area Toll Authority, California Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 6,918 % fällig am 01.04.2040		600	903	0,08
California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009 7,300 % fällig am 01.10.2039		500	801	0,07
7,500 % fällig am 01.04.2034		100	158	0,01
7,550 % fällig am 01.04.2039		200	341	0,03
Los Angeles Department of Water & Power, California Revenue Bonds, Series 2010 5,516 % fällig am 01.07.2027		500	619	0,06

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS	
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 5,508 % fällig am 01.08.2037	\$	200	\$ 268	0,02
New York State Urban Development Corp., Revenue Bonds, (BABs), Series 2009 5,770 % fällig am 15.03.2039		100	125	0,01
			3.515	0,31
NON-AGENCY-MBS				
American Home Mortgage Investment Trust 1,671 % fällig am 25.09.2045	12	12		0,00
Banc of America Funding Trust 2,809 % fällig am 20.09.2034	15	16		0,00
BCAP LLC Trust 5,250 % fällig am 26.04.2037	258	193		0,02
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 2,756 % fällig am 25.01.2035	36	37		0,00
2,893 % fällig am 25.02.2034	9	9		0,00
3,048 % fällig am 25.11.2034	7	7		0,00
3,156 % fällig am 25.05.2047 ^	9	9		0,00
3,450 % fällig am 25.09.2034	81	83		0,01
Bear Stearns ALT-A Trust 2,169 % fällig am 25.10.2033	11	12		0,00
3,389 % fällig am 25.08.2036 ^	14	9		0,00
Chase Mortgage Finance Trust 3,067 % fällig am 25.03.2037 ^	6	6		0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 1,860 % fällig am 25.09.2035	3	3		0,00
5,500 % fällig am 25.08.2034	541	554		0,05
Countrywide Alternative Loan Trust 0,472 % fällig am 25.09.2046 ^	12	12		0,00
0,513 % fällig am 20.07.2046 ^	12	9		0,00
3,051 % fällig am 25.02.2037 ^	9	9		0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0,732 % fällig am 25.03.2035	86	86		0,01
0,852 % fällig am 25.09.2034	2	2		0,00
3,041 % fällig am 25.09.2047 ^	8	8		0,00
GreenPoint Mortgage Funding Trust 0,532 % fällig am 25.06.2045	100	94		0,01
GSR Mortgage Loan Trust 2,336 % fällig am 25.06.2034	8	8		0,00
2,924 % fällig am 25.09.2035	3	3		0,00
3,084 % fällig am 25.07.2035	59	61		0,01
HarborView Mortgage Loan Trust 0,993 % fällig am 20.06.2035	269	266		0,02
HomeBanc Mortgage Trust 0,752 % fällig am 25.10.2035	16	16		0,00
Impac CMB Trust 0,992 % fällig am 25.10.2033	2	2		0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust 0,572 % fällig am 25.07.2035	1.836	1.785		0,16
0,732 % fällig am 25.07.2045	4	3		0,00
JPMorgan Mortgage Trust 2,927 % fällig am 25.04.2035	34	35		0,00
2,979 % fällig am 25.08.2035	9	10		0,00
Lehman XS Trust 1,242 % fällig am 25.12.2037	1.279	1.326		0,12
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 0,513 % fällig am 15.12.2030	1	1		0,00
New Residential Mortgage Loan Trust 4,500 % fällig am 25.05.2058	681	740		0,07
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,892 % fällig am 25.04.2035	500	504		0,04
Regal Trust 1,908 % fällig am 29.09.2031	8	8		0,00
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 6,500 % fällig am 25.03.2032	7	7		0,00
Sequoia Mortgage Trust 0,493 % fällig am 20.07.2036	817	805		0,07
0,793 % fällig am 19.10.2026	6	6		0,00
2,647 % fällig am 20.04.2035	35	37		0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,673 % fällig am 19.07.2034	2	2		0,00
0,753 % fällig am 19.10.2034	15	14		0,00
0,793 % fällig am 19.03.2034	10	10		0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates			
2,119 % fällig am 25.07.2032	\$ 1	\$ 1	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
0,712 % fällig am 25.01.2045	19	19	0,00
0,832 % fällig am 25.02.2044	102	101	0,01
0,872 % fällig am 25.10.2044	209	207	0,02
1,516 % fällig am 25.06.2042	1	1	0,00
		7.148	0,62

US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

Fannie Mae			
0,662 % fällig am 25.09.2036	2	2	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2044	5	6	0,00
6,500 % fällig am 25.06.2028	9	10	0,00
Freddie Mac			
0,372 % fällig am 25.09.2031	13	13	0,00
0,523 % fällig am 15.12.2031	1	1	0,00
0,573 % fällig am 15.04.2028	6	6	0,00
0,701 % fällig am 15.03.2024	3	3	0,00
0,723 % fällig am 15.03.2032	81	82	0,01
2,350 % fällig am 01.01.2034	2	2	0,00
5,000 % fällig am 15.01.2035	312	355	0,03
6,000 % fällig am 15.04.2036	4	5	0,00
Ginnie Mae			
0,343 % fällig am 20.02.2035	36	36	0,00
0,386 % fällig am 20.10.2043	640	638	0,06
0,583 % fällig am 20.02.2038	19	19	0,00
0,599 % fällig am 20.08.2068	749	743	0,07
0,640 % fällig am 20.03.2060	32	32	0,00
0,908 % fällig am 20.07.2062	839	838	0,07
0,923 % fällig am 20.08.2062	1.231	1.232	0,11
Uniform Mortgage-Backed Security			
5,151 % fällig am 01.11.2034	335	335	0,03

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,500 % fällig am 01.08.2051	\$ 7.480	\$ 7.879	0,69
4,000 % fällig am 01.08.2051	13.114	13.977	1,22
		26.214	2,29

US-SCHATZOBBLIGATIONEN

U.S. Treasury Bonds			
1,625 % fällig am 15.11.2050	6.710	6.029	0,53
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)			
0,125 % fällig am 15.01.2022	16.609	16.983	1,49
0,125 % fällig am 15.04.2022	38.114	39.098	3,42
0,125 % fällig am 15.01.2023	36.355	37.989	3,32
0,125 % fällig am 15.07.2024	33.507	36.040	3,15
0,125 % fällig am 15.10.2024	76.276	82.226	7,19
0,125 % fällig am 15.04.2025	41.138	44.415	3,88
0,125 % fällig am 15.10.2025	29.325	31.924	2,79
0,125 % fällig am 15.04.2026	48.896	53.213	4,65
0,125 % fällig am 15.07.2026	6.137	6.723	0,59
0,125 % fällig am 15.01.2030	8.717	9.576	0,84
0,125 % fällig am 15.07.2030	1.978	2.184	0,19
0,125 % fällig am 15.01.2031	31.383	34.567	3,02
0,250 % fällig am 15.01.2025	11.272	12.204	1,07
0,250 % fällig am 15.07.2029	1.680	1.871	0,16
0,375 % fällig am 15.07.2023	30.172	32.103	2,81
0,375 % fällig am 15.07.2025	207	227	0,02
0,375 % fällig am 15.01.2027	3.548	3.929	0,34
0,375 % fällig am 15.07.2027	8.491	9.475	0,83
0,500 % fällig am 15.04.2024	57.618	62.120	5,43
0,500 % fällig am 15.01.2028	6.386	7.164	0,63
0,625 % fällig am 15.07.2021	9.950	9.990	0,87
0,625 % fällig am 15.04.2023	26.366	27.895	2,44
0,625 % fällig am 15.01.2024	40.505	43.633	3,82
0,625 % fällig am 15.01.2026	3.506	3.895	0,34
0,750 % fällig am 15.07.2028	4.180	4.799	0,42

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
0,875 % fällig am 15.01.2029	\$ 6.069	\$ 7.027	0,61
1,000 % fällig am 15.02.2046	1.352	1.770	0,15
1,750 % fällig am 15.01.2028	5.159	6.238	0,55
2,125 % fällig am 15.02.2040	469	701	0,06
2,125 % fällig am 15.02.2041	2.194	3.311	0,29
2,375 % fällig am 15.01.2025	15.155	17.616	1,54
2,500 % fällig am 15.01.2029	1.503	1.938	0,17
3,875 % fällig am 15.04.2029	1.057	1.488	0,13
		660.361	57,74
Summe USA		729.940	63,82

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
U.S. TREASURY BILLS			
0,006 % fällig am 12.08.2021 (a)(b)(c)(h)	523	523	0,05
0,021 % fällig am 03.08.2021 (a)(b)(c)(h)	291	291	0,02
Summe kurzfristige Instrumente		814	0,07
Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 1.084.155	94,80

AKTIEN

INVESTMENTFONDS	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	1.798	18	0,00
Summe Investmentfonds		\$ 18	0,00

PENSIONSGESCHÄFTEN

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
IND	0,030 %	30.06.2021	01.07.2021	\$ 60.400	U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 15.05.2040	\$ (61.708)	\$ 60.400	\$ 60.400	5,28
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (61.708)	\$ 60.400	\$ 60.400	5,28

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2021	69	\$ 14	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	11	(5)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 171,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	08.2021	53	(23)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2021	737	138	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2021	276	(294)	(0,03)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	32	32	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	146	(555)	(0,05)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	43	31	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	424	8	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	21	(19)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 171,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	08.2021	53	51	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2021	359	(128)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	659	(188)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	632	468	0,04
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	365	(616)	(0,05)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	173	(805)	(0,07)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	124	(1.040)	(0,09)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2021	86	109	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (2.822)	(0,25)

(1) Future-Style-Option.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Commodity Real Return Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 200	\$ 16	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2051	£ 1.200	\$ (7)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2047	\$ 1.750	(201)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,428	20.12.2047	400	(85)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,478	20.12.2047	1.115	(253)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,499	20.12.2047	570	(131)	(0,01)
Erhalt	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	NZD 900	(76)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 9.900	(14)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 74.880	(11)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,066	15.02.2024	€ 3.800	(29)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,168	15.03.2024	3.300	(26)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	4.000	(108)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	1,475	15.05.2023	1.900	22	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,535	15.06.2023	2.900	49	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	60	9	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,230	04.11.2021	\$ 5.100	(188)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	1,280	02.11.2021	3.000	(110)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,290	05.11.2021	9.300	(338)	(0,03)
Erhalt	CPURNSA	1,445	09.09.2021	3.900	128	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,550	26.07.2021	1.100	7	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,580	20.09.2021	3.500	104	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,592	20.09.2021	3.100	92	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	1.000	77	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	3.000	209	0,02
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	700	(41)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	3.600	(193)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,155	17.10.2027	1.900	(72)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,210	05.02.2023	5.270	78	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,263	27.04.2023	1.450	14	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,263	09.05.2023	1.790	18	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,311	24.02.2031	5.100	153	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,335	05.02.2028	2.680	(38)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	1.790	(14)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,360	09.05.2028	2.690	(18)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	2.750	(18)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,419	05.03.2026	2.300	49	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,690	01.06.2026	2.100	4	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	1.270	2	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	3.100	(2)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	1.400	(5)	0,00
Erhalt	FRCPXTOB	1,030	15.03.2024	€ 3.300	(10)	0,00
Zahlung	FRCPXTOB	1,910	15.01.2038	390	46	0,00
Zahlung	UKRPI	3,100	15.06.2031	£ 2.300	57	0,01
Zahlung	UKRPI	3,400	15.06.2030	1.610	42	0,00
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	2.900	(19)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,530	15.10.2031	540	4	0,00
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	1.200	(26)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,580	15.03.2036	2.000	(27)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,750	15.04.2031	2.390	(7)	0,00
					\$ (903)	(0,08)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (887)	(0,08)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Rückertlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,195 %	02.11.2022	950	\$ 1	\$ 140	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	1.040	79	152	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	600	67	125	0,01
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	560	42	82	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	600	66	125	0,01
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,007	24.08.2021	18.400	66	8	0,00
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	900	66	133	0,01
							\$ 387	\$ 765	0,07

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	300	\$ 2	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,156	05.08.2021	200	2	1	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	200	2	1	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	500	3	1	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,641	07.07.2021	300	1	0	0,00
					\$ 10	\$ 3	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.08.2021	1.200	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	900	(1)	0	0,00
BPS	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	900	(1)	0	0,00
BRC	Call - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	1.200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.200	(2)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	600	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	5.300	(8)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	900	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	900	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	1.200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Call - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	1.400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.400	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	4.800	(5)	(1)	0,00
FBF	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	900	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	3.900	(5)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	15.09.2021	400	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	600	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.700	(2)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	1.700	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	2.800	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.100	(1)	0	0,00
GST	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	700	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	900	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	200	0	0	0,00
						\$ (51)	\$ (13)	0,00

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.200	\$ (55)	\$ (1)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000 %	02.11.2022	2.900	\$ 0	\$ (130)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	3.190	(79)	(144)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	1.800	(66)	(122)	(0,01)
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	1.710	(42)	(77)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Commodity Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
DUB	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023 %	29.09.2021	5.550	\$ (38)	\$ (4)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	19.900	(31)	(10)	0,00
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	1.800	(65)	(122)	(0,01)
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,006	24.08.2021	36.800	(58)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	400	(3)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	6.750	(48)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	2.700	(65)	(121)	(0,01)
							\$ (496)	\$ (737)	(0,06)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	500	\$ (2)	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	05.08.2021	500	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,797	05.08.2021	500	(2)	(1)	0,00
GSC	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,227	07.07.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,367	05.08.2021	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,023	07.09.2021	600	(4)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,023	07.09.2021	600	(3)	(3)	0,00
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	12.08.2021	1.000	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	900	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	400	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	400	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,313	07.09.2021	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,047	07.07.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	104,047	07.07.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	1.000	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,695	07.09.2021	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	400	(1)	(1)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,375	07.07.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,547	07.07.2021	400	(2)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,609	07.07.2021	1.000	(4)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,672	07.07.2021	400	(2)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	100,219	07.07.2021	300	(2)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,203	07.07.2021	1.000	(4)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,219	07.07.2021	300	(2)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,227	07.07.2021	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,375	07.07.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,422	07.07.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,547	07.07.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,641	07.07.2021	600	(2)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,645	07.07.2021	600	(2)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,766	07.07.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,172	05.08.2021	900	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,188	05.08.2021	500	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,406	05.08.2021	1.900	(8)	(4)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,688	05.08.2021	900	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,938	05.08.2021	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,188	05.08.2021	500	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,406	05.08.2021	1.900	(4)	(5)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,281	07.09.2021	800	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,281	07.09.2021	1.400	(4)	(6)	(0,01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,297	07.09.2021	500	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,328	07.09.2021	1.400	(4)	(6)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,164	07.07.2021	350	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,211	07.07.2021	350	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,375	07.07.2021	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,703	05.08.2021	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,801	05.08.2021	400	(2)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,078	05.08.2021	500	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,344	05.08.2021	500	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,586	05.08.2021	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,609	05.08.2021	800	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	101,844	07.09.2021	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	103,844	07.09.2021	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,258	05.08.2021	400	(1)	(1)	0,00
					\$ (114)	\$ (62)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
DUB	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 1.500	\$ (104)	\$ 119	\$ 15	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	1.800	(94)	112	18	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	700	(1)	8	7	0,00
					\$ (199)	\$ 239	\$ 40	0,00

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998 %	20.06.2028	ILS 890	\$ 0	\$ 21	\$ 21	0,00
BRC	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	810	0	19	19	0,00
CKL	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	750	(2)	22	20	0,00
GLM	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	1.430	0	36	36	0,01
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	610	0	15	15	0,00
HUS	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	480	0	11	11	0,00
						\$ (2)	\$ 124	\$ 122	0,01

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BPS	Zahlung	BCOMTR Index	1.354.580	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 270.550	15.02.2022	\$ 0	\$ 2.876	\$ 2.876	0,25
CBK	Zahlung	BCOMTR Index	182.528	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	36.456	15.02.2022	0	387	387	0,03
	Zahlung	CIXBSTR3 Index	324.655	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	71.383	15.02.2022	0	703	703	0,06
CIB	Zahlung	BCOMTR Index	154.350	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	30.828	15.02.2022	0	328	328	0,03
FBF	Zahlung	BCOMTR Index	83.595	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	16.696	15.02.2022	0	178	178	0,02
GST	Zahlung	BCOMF1TC Index	92.454	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	29.330	15.02.2022	0	342	342	0,03
	Zahlung	BCOMTR Index	1.111.120	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	221.924	15.02.2022	(32)	2.390	2.358	0,21
	Zahlung	BCOMTR2 Index	56.072	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	11.341	15.02.2022	0	116	116	0,01
JPM	Zahlung	BCOMF1TC Index	421.556	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	69.947	15.02.2022	0	815	815	0,07
	Zahlung	BCOMTR Index	1.550.463	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	309.674	15.02.2022	(76)	3.367	3.291	0,29
	Zahlung	JMABDEWU Index	494.170	0,053	78.328	15.02.2022	0	(87)	(87)	(0,01)
MAC	Zahlung	BCOMTR Index	105.225	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	21.017	15.02.2022	0	223	223	0,02
MEI	Zahlung	BCOMTR Index	276.190	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	55.163	15.02.2022	0	586	586	0,05
SOG	Zahlung	BCOMTR Index	3.773	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	754	15.02.2022	0	8	8	0,00
						\$ (108)	\$ 12.232	\$ 12.124	1,06	

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2021	DKK	53.724	\$ 8.549	\$ 0	\$ (18)	0,00
	07.2021	¥	1.182.300	10.686	33	0	0,00
	07.2021	\$	601	SEK 4.985	0	(18)	0,00
	08.2021		697	NOK 5.835	0	(19)	0,00
BPS	07.2021	AUD	7.174	\$ 5.575	189	0	0,02
	07.2021	CAD	532	442	12	0	0,00
	07.2021	€	3.289	3.961	61	0	0,01
	07.2021	NZD	3.121	2.265	84	0	0,01
BRC	07.2021	\$	1.041	£ 749	0	(6)	0,00
	11.2021	ILS	628	\$ 192	0	(1)	0,00
	07.2021	¥	3.776.200	34.527	504	0	0,04
	07.2021	\$	1.533	SEK 12.705	0	(47)	0,00
CBK	07.2021	AUD	1.571	\$ 1.215	36	0	0,00
	07.2021	DKK	41.656	6.606	0	(37)	0,00
	07.2021	¥	135.100	1.232	15	0	0,00
	07.2021	PEN	2.580	683	9	0	0,00
GLM	07.2021	\$	593	DKK 3.730	2	0	0,00
	10.2021	PEN	493	\$ 136	7	0	0,00
	07.2021	DKK	103.145	16.810	361	0	0,03
	07.2021	£	31.506	44.541	1.017	0	1.017
HUS	07.2021	€	11.933	14.213	61	0	0,01
	07.2021	\$	2.959	€ 2.419	0	(90)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Commodity Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
	07.2021	\$ 42.579	£ 30.757	\$ 0	\$ (90)	\$ (90)	(0,01)
	08.2021	£ 29.517	\$ 40.857	77	0	77	0,01
	09.2021	PEN 3.631	983	32	0	32	0,00
	09.2021	\$ 2.442	CNH 15.693	0	(25)	(25)	0,00
JPM	07.2021	DKK 46.441	\$ 7.366	0	(40)	(40)	0,00
	07.2021	\$ 10.735	DKK 66.878	0	(69)	(69)	(0,01)
	09.2021	2.720	IDR 39.198.815	0	(48)	(48)	(0,01)
	10.2021	DKK 66.878	\$ 10.754	70	0	70	0,01
MYI	07.2021	€ 3.578	4.309	67	0	67	0,01
	07.2021	PEN 1.112	305	14	0	14	0,00
	07.2021	\$ 12.733	DKK 79.283	0	(89)	(89)	(0,01)
	07.2021	4	ILS 12	0	0	0	0,00
	10.2021	DKK 79.283	\$ 12.755	89	0	89	0,01
SCX	07.2021	€ 148.248	181.360	5.552	0	5.552	0,48
	07.2021	\$ 279	PEN 1.112	11	0	11	0,00
	09.2021	PEN 1.112	\$ 280	0	(12)	(12)	0,00
SOG	07.2021	\$ 15.154	DKK 94.360	0	(105)	(105)	(0,01)
	10.2021	DKK 94.360	\$ 15.180	105	0	105	0,01
UAG	07.2021	\$ 4.467	AUD 5.889	0	(46)	(46)	0,00
	08.2021	AUD 5.889	\$ 4.468	46	0	46	0,00
	08.2021	\$ 1.832	NOK 15.140	0	(72)	(72)	(0,01)
				\$ 8.454	\$ (832)	\$ 7.622	0,67

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2021	\$ 3.270	€ 2.700	\$ 0	\$ (68)	\$ (68)	(0,01)
BPS	07.2021	€ 7.667	\$ 9.144	52	0	52	0,01
	07.2021	\$ 100.257	€ 82.019	0	(2.991)	(2.991)	(0,26)
BRC	07.2021	2.877	2.362	0	(76)	(76)	(0,01)
GLM	07.2021	3.069	2.532	0	(66)	(66)	(0,01)
HUS	07.2021	€ 1.948	\$ 2.361	51	0	51	0,01
	07.2021	\$ 10.156	€ 8.389	0	(208)	(208)	(0,02)
MYI	07.2021	2.200	1.848	0	(9)	(9)	0,00
SCX	07.2021	116.648	95.360	0	(3.560)	(3.560)	(0,31)
TOR	07.2021	114.388	93.503	0	(3.503)	(3.503)	(0,31)
UAG	07.2021	1.690	1.390	0	(43)	(43)	0,00
				\$ 103	\$ (10.524)	\$ (10.421)	(0,91)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BPS	07.2021	\$ 8	£ 5	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	07.2021	8.337	5.897	0	(190)	(190)	(0,02)
HUS	07.2021	£ 6.287	\$ 8.702	16	0	16	0,00
	07.2021	\$ 144	£ 102	0	(4)	(4)	0,00
	08.2021	8.703	6.287	0	(16)	(16)	0,00
SCX	07.2021	8.500	5.979	0	(240)	(240)	(0,02)
SSB	07.2021	£ 6.287	\$ 8.688	3	0	3	0,00
	08.2021	\$ 8.689	£ 6.287	0	(3)	(3)	0,00
UAG	07.2021	8.355	5.897	0	(209)	(209)	(0,02)
				\$ 19	\$ (662)	\$ (643)	(0,06)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 8.799 0,77

Summe Anlagen

\$ 1.149.663 100,52

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (5.993) (0,52)

Nettvermögen

\$ 1.143.670 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 623 und Barmittel in Höhe von USD 10.249 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 5.276 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.084.155	\$ 0	\$ 1.084.155
Investmentfonds	18	0	0	18
Pensionsgeschäfte	0	60.400	0	60.400
Finanzderivate ⁽³⁾	(512)	5.602	0	5.090
Summen	\$ (494)	\$ 1.150.157	\$ 0	\$ 1.149.663

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 509.577	\$ 0	\$ 509.577
Investmentfonds	18	0	0	18
Pensionsgeschäfte	0	10.072	0	10.072
Finanzderivate ⁽³⁾	321	7.093	0	7.414
Summen	\$ 339	\$ 526.742	\$ 0	\$ 527.081

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (69)	\$ 282	\$ 213
BPS	297	3.380	3.677
BRC	400	(330)	70
CBK	1.122	590	1.712
CIB	328	160	488
CKL	20	0	20
DUB	6	(20)	(14)
FAR	(2)	0	(2)
FBF	175	90	265
GLM	1.162	(860)	302
GSC	(6)	0	(6)
GST	2.834	899	3.733
HUS	(185)	0	(185)
JPM	3.927	1.640	5.567
MAC	223	110	333
MEI	586	290	876
MYC	13	(16)	(3)
MYI	72	(10)	62
SAL	(36)	0	(36)
SCX	1.751	(1.370)	381
SOG	8	0	8
TOR	(3.503)	3.090	(413)
UAG	(324)	341	17

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	76,98	116,55
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	16,04	37,46
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,78	2,73
Investmentfonds	0,00	0,01
Pensionsgeschäfte	5,28	3,10
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,25)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,08)	(0,04)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,77	2,21
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(47,23)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Australien	0,79	2,86
Kanada	0,25	0,86
Cayman-Inseln	0,85	3,95
Dänemark	3,36	5,22
Frankreich	3,11	12,47
Deutschland	0,15	0,54
Guernsey, Kanalinseln	0,04	0,15
Irland	2,60	1,15
Italien	9,39	16,40
Japan	4,10	3,67
Niederlande	1,39	1,65
Neuseeland	0,19	0,68
Peru	0,14	0,62
Katar	0,06	0,20
Saudi-Arabien	0,03	0,11
Spanien	0,74	2,86
Schweden	0,03	0,10
Schweiz	k. A.	1,24
Großbritannien	3,69	13,95
USA	63,82	86,92
Kurzfristige Instrumente	0,07	1,14
Investmentfonds	0,00	0,01
Pensionsgeschäfte	5,28	3,10
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,25)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,15)
Zinsswaps	(0,08)	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	0,07	0,13
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Inflation-Capped Options	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,06)	(0,12)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,01
Zinsswaps	0,01	0,06
Total Return Swaps auf Indizes	1,06	3,06
Devisenterminkontrakte	0,67	(1,36)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,97)	0,43
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,52)	(62,12)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								ITALIEN				
ARGENTINIEN								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
STAAATSEMISSIONEN								Atlantia SpA				
Argentina Government International Bond								1,875 % fällig am 13.07.2027				
0,125 % fällig am 09.07.2041	\$	800	286	0,20				€	300	\$	369	0,25
1,000 % fällig am 09.07.2029		13	5	0,00				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
Provincia de Buenos Aires								2,625 % fällig am 28.04.2025				
37,854 % fällig am 12.04.2025	ARS	20	0	0,00				500	603		0,41	
Summe Argentinien			291	0,20				Esercizi Aeroportuali SEA SpA				
								200	254		0,18	
								Summe Italien				
								1.226				
								0,84				
AUSTRALIEN								JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Virgin Australia Holdings Ltd.								CPUK Finance Ltd.				
8,125 % fällig am 15.11.2024 ^	\$	400	38	0,03				4,875 % fällig am 28.02.2047				
								£	400	561	0,38	
								Heathrow Funding Ltd.				
								1,875 % fällig am 12.07.2032				
								€	250	315	0,22	
								Summe Jersey, Kanalinseln				
								876				
								0,60				
ÖSTERREICH								LIBERIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Sappi Papier Holding GmbH								Royal Caribbean Cruises Ltd.				
3,125 % fällig am 15.04.2026	€	400	477	0,33				10,875 % fällig am 01.06.2023				
								\$	100	114	0,08	
								11,500 % fällig am 01.06.2025				
								800	923		0,63	
								Summe Liberia				
								1.037				
								0,71				
BERMUDAS								LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aircastle Ltd.								Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK)				
2,850 % fällig am 26.01.2028	\$	100	101	0,07				10,000 % fällig am 09.11.2024 ^(b)				
NCL Corp. Ltd.								1.309	273		0,19	
10,250 % fällig am 01.02.2026		450	524	0,36				Intelsat Jackson Holdings S.A.				
Viking Cruises Ltd.								5,500 % fällig am 01.08.2023 ^				
13,000 % fällig am 15.05.2025		500	589	0,40				800	459		0,32	
Viking Ocean Cruises Ship Ltd.								Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,625 % fällig am 15.02.2029		100	101	0,07				6,125 % fällig am 07.02.2022				
Summe Bermudas			1.315	0,90				400	413		0,28	
								1.145				
								0,79				
BRASILIEN								KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								ORTHOCLINICAL DIAGNOSTICS S.A.				
Banco BTG Pactual S.A.								3,089 % fällig am 30.06.2025				
4,500 % fällig am 10.01.2025		200	210	0,14				876	876		0,60	
CSN Resources S.A.								Summe Luxemburg				
4,625 % fällig am 10.06.2031		300	307	0,21				2.021				
Petrobras Global Finance BV								1,39				
5,093 % fällig am 15.01.2030		400	437	0,30								
5,600 % fällig am 03.01.2031		150	168	0,12								
Summe Brasilien			1.122	0,77								
KANADA								MEXIKO				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bausch Health Cos., Inc.								BBVA Bancomer S.A.				
4,875 % fällig am 01.06.2028		200	205	0,14				6,750 % fällig am 30.09.2022				
Bombardier, Inc.								200	213		0,15	
6,000 % fällig am 15.10.2022		200	201	0,14				MULTINATIONAL				
7,125 % fällig am 15.06.2026		200	210	0,15				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
7,500 % fällig am 01.12.2024		100	105	0,07				American Airlines, Inc.				
Fairfax Financial Holdings Ltd.								5,750 % fällig am 20.04.2029				
4,625 % fällig am 29.04.2030		1.000	1.147	0,79				Axalta Coating Systems LLC				
Northriver Midstream Finance LP								4,750 % fällig am 15.06.2027				
5,625 % fällig am 15.02.2026		200	208	0,14				200	210		0,14	
Precision Drilling Corp.								Delta Air Lines, Inc.				
6,875 % fällig am 15.01.2029		100	103	0,07				4,500 % fällig am 20.10.2025				
Summe Kanada			2.179	1,50				4,750 % fällig am 20.10.2028				
								100	108		0,07	
								400	445		0,31	
								Summe multinational				
								979				
								0,67				
CAYMAN INSELN								NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Kaisa Group Holdings Ltd.								Clear Channel International BV				
11,250 % fällig am 09.04.2022		200	205	0,14				6,625 % fällig am 01.08.2025				
11,500 % fällig am 30.01.2023		600	609	0,42				200	211		0,15	
MGM China Holdings Ltd.								ING Groep NV				
5,250 % fällig am 18.06.2025		700	729	0,50				5,750 % fällig am 16.11.2026 (f)(h)				
5,375 % fällig am 15.05.2024		200	206	0,14				200	222		0,15	
New Metro Global Ltd.								LeasePlan Corp. NV				
4,500 % fällig am 02.05.2026		900	885	0,61				7,375 % fällig am 29.05.2024 (f)(h)				
6,800 % fällig am 05.08.2023		200	208	0,14				€	700	931	0,64	
Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.								Prosus NV				
6,720 % fällig am 01.12.2022 ^		131	130	0,09				3,832 % fällig am 08.02.2051				
Sands China Ltd.								\$	300	280	0,19	
								Syngenta Finance NV				
								5,182 % fällig am 24.04.2028				
								600	686		0,47	
								Summe Niederlande				
								2.330				
								1,60				
HONGKONG								IRLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Yanlord Land HK Co. Ltd.								AWAS Aviation Capital Ltd.				
5,125 % fällig am 20.05.2026	\$	200	204	0,14				4,870 % fällig am 03.10.2021 (i)				
								671	677		0,46	
								INDIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ReNew Power Synthetic								6,670 % fällig am 12.03.2024				
6,670 % fällig am 12.03.2024		400	421	0,29								

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				USA				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Starfruit Finco BV				Virgin Media Secured Finance PLC	£ 300	\$ 412	0,28	BCPE Ulysses Intermediate, Inc. (7,750 % bar oder 8,500 % PIK)	\$ 700	\$ 718	0,49	
2,843 % - 5,000 % fällig am 01.10.2025	\$	92	0,06	Vmed O2 UK Financing PLC	400	547	0,37	Block Financial LLC	200	201	0,14	
2,843 % - 5,000 % fällig am 01.10.2025	€	94	0,08	4,250 % fällig am 31.01.2031	\$ 250	246	0,17	Boeing Co.	200	237	0,16	
		204	0,14	Summe Großbritannien		6.806	4,67	5,705 % fällig am 01.05.2040	700	903	0,62	
Summe Niederlande		2.534	1,74					5,805 % fällig am 01.05.2050	100	135	0,09	
NORWEGEN				USA				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				Boyd Gaming Corp.				
Adevinta ASA				0,917 % fällig am 25.12.2045 ^	382	338	0,23	4,750 % fällig am 15.06.2031	300	312	0,21	
2,625 % fällig am 15.11.2025	100	122	0,08	Argent Securities Trust	820	354	0,24	Boyne USA, Inc.	100	103	0,07	
				0,242 % fällig am 25.09.2036	282	124	0,08	4,750 % fällig am 15.05.2029	100	112	0,08	
				0,452 % fällig am 25.04.2036	688	310	0,21	Brandywine Operating Partnership LP	100	112	0,08	
				0,652 % fällig am 25.04.2036	239	240	0,16	4,550 % fällig am 01.10.2029	30	32	0,02	
				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust	1.988	1.342	0,92	British Airways Pass-Through Trust	30	32	0,02	
				0,642 % fällig am 25.06.2036	87	87	0,06	4,250 % fällig am 15.05.2034	100	112	0,08	
				Citigroup Mortgage Loan Trust	464	468	0,32	Broadcom, Inc.	700	743	0,51	
				0,252 % fällig am 25.12.2036	601	373	0,26	4,150 % fällig am 15.11.2030	800	891	0,61	
				0,252 % fällig am 25.12.2036	766	511	0,35	Caesars Entertainment, Inc.	50	52	0,04	
				First Franklin Mortgage Loan Trust	438	319	0,22	6,250 % fällig am 01.07.2025	800	820	0,56	
				0,827 % fällig am 25.07.2035	601	373	0,26	8,125 % fällig am 01.07.2027	100	106	0,07	
				1,517 % fällig am 25.10.2034	766	511	0,35	CCO Holdings LLC	100	106	0,07	
				GSAMP Trust	538	290	0,20	4,500 % fällig am 01.05.2032	100	124	0,09	
				0,182 % fällig am 25.01.2037	79	37	0,03	4,500 % fällig am 01.06.2033	100	106	0,07	
				0,212 % fällig am 25.12.2036	394	241	0,16	Centene Corp.	100	106	0,07	
				0,322 % fällig am 25.12.2046	310	185	0,13	4,250 % fällig am 15.12.2027	100	106	0,07	
				MASTR Asset-Backed Securities Trust	1.935	931	0,64	CF Industries, Inc.	100	106	0,07	
				0,572 % fällig am 25.08.2036	67	39	0,03	5,375 % fällig am 15.03.2044	100	106	0,07	
				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust	74	48	0,03	Charter Communications Operating LLC	100	99	0,07	
				0,212 % fällig am 25.11.2037	718	367	0,25	3,700 % fällig am 01.04.2051	100	106	0,07	
				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust	81	75	0,05	Chesapeake Energy Corp.	100	106	0,07	
				0,222 % fällig am 25.01.2037	648	543	0,37	5,500 % fällig am 01.02.2026	100	106	0,07	
				0,232 % fällig am 25.10.2036	982	578	0,40	Chobani LLC	200	214	0,15	
				0,242 % fällig am 25.09.2036	575	368	0,25	4,625 % fällig am 15.11.2028	300	311	0,21	
				0,322 % fällig am 25.09.2036	Residential Asset Mortgage Products Trust	1.337	1.210	0,83	Community Health Systems, Inc.	100	101	0,07
				Morgan Stanley Home Equity Loan Trust	499	489	0,34	4,750 % fällig am 15.02.2031	100	101	0,07	
				0,192 % fällig am 25.04.2037	189	169	0,12	5,625 % fällig am 15.03.2027	100	101	0,07	
				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust	326	314	0,22	6,625 % fällig am 15.02.2025	1.000	1.059	0,73	
				5,965 % fällig am 25.09.2046 ^	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust	431	333	0,23	Core & Main Holdings LP (8,625 % bar oder 9,375 % PIK)	700	717	0,49
				New Century Home Equity Loan Trust	10.683	7,33		8,625 % fällig am 15.09.2024 (b)	100	106	0,07	
				3,092 % fällig am 25.01.2033 ^	Residential Asset Securities Corp. Trust	499	489	0,34	Coty, Inc.	100	106	0,07
				NovaStar Mortgage Funding Trust	575	368	0,25	3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 1.200	1.432	0,98	
				0,392 % fällig am 25.06.2036	Residential Asset Mortgage Products Trust	1.337	1.210	0,83	CyrusOne LP	100	106	0,07
				0,392 % fällig am 25.09.2036	0,552 % fällig am 25.12.2035	1.337	1.210	0,83	3,450 % fällig am 15.11.2029	\$ 100	106	0,07
				Option One Mortgage Loan Trust	499	489	0,34	DAE Funding LLC	800	800	0,55	
				0,342 % fällig am 25.03.2037	Residential Asset Securities Corp. Trust	499	489	0,34	1,550 % fällig am 01.08.2024	800	800	0,55
				Residential Asset Mortgage Products Trust	1.337	1.210	0,83	DaVita, Inc.	800	824	0,57	
				0,552 % fällig am 25.12.2035	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust	189	169	0,12	4,625 % fällig am 01.06.2030	800	824	0,57
				Residential Asset Securities Corp. Trust	499	489	0,34	Diamond Sports Group LLC	800	519	0,36	
				0,972 % fällig am 25.08.2034	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust	189	169	0,12	5,375 % fällig am 15.08.2026	800	519	0,36
				Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust	189	169	0,12	DT Midstream, Inc.	200	203	0,14	
				1,052 % fällig am 25.01.2036 ^	Soundview Home Loan Trust	326	314	0,22	4,125 % fällig am 15.06.2029	200	205	0,14
				Soundview Home Loan Trust	326	314	0,22	4,375 % fällig am 15.06.2031	200	205	0,14	
				0,272 % fällig am 25.07.2037	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust	431	333	0,23	Enable Midstream Partners LP	300	327	0,22
				Specialty Underwriting & Residential Finance Trust	431	333	0,23	5,000 % fällig am 15.05.2044	300	327	0,22	
				0,242 % fällig am 25.09.2037	Stammaktien			Entergy Corp.	100	110	0,08	
					FINANZWERTE			3,750 % fällig am 15.06.2050	100	110	0,08	
								Expedia Group, Inc.	400	418	0,29	
								3,250 % fällig am 15.02.2030	400	418	0,29	
								3,800 % fällig am 15.02.2028	700	762	0,52	
								Ford Motor Credit Co. LLC	200	204	0,14	
								3,087 % fällig am 09.01.2023	500	514	0,35	
								3,550 % fällig am 07.10.2022	500	510	0,35	
								3,625 % fällig am 17.06.2031	500	510	0,35	
								5,125 % fällig am 16.06.2025	300	331	0,23	
								Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC	400	417	0,29	
								5,500 % fällig am 01.05.2028	100	104	0,07	
								6,500 % fällig am 01.10.2025	100	104	0,07	
								Freedom Mortgage Corp.	225	235	0,16	
								7,625 % fällig am 01.05.2026	100	104	0,07	
								8,125 % fällig am 15.11.2024	100	104	0,07	
								Global Atlantic Fin Co.	600	605	0,42	
								3,125 % fällig am 15.06.2031	100	111	0,08	
								4,400 % fällig am 15.10.2029	100	111	0,08	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Global Medical Response, Inc. 6,500 % fällig am 01.10.2025	\$ 600	\$ 618	0,42	3,625 % fällig am 15.07.2026 (a)	200	202	0,14	Sotera Health Holdings LLC 3,250 % fällig am 11.12.2026	\$ 1.200	\$ 1.198	0,82
GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2030	1.100	1.182	0,81	Summer BC Bidco LLC 5,500 % fällig am 31.10.2026 (a)	200	204	0,14	Spirit AeroSystems, Inc. 6,000 % fällig am 15.01.2025	199	201	0,14
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 4,000 % fällig am 01.05.2031	400	404	0,28	Time Warner Entertainment Co. LP 8,375 % fällig am 15.07.2033	100	152	0,10	TransDigm, Inc. 2,354 % fällig am 09.12.2025	397	392	0,27
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC 5,000 % fällig am 01.06.2029	200	205	0,14	TransDigm, Inc. 4,625 % fällig am 15.01.2029	100	100	0,07	USI, Inc. 3,397 % fällig am 02.12.2026	988	980	0,67
Host Hotels & Resorts LP 3,375 % fällig am 15.12.2029	100	105	0,07	8,000 % fällig am 15.12.2025	400	433	0,30	Zayo Group Holdings, Inc. 3,104 % fällig am 09.03.2027	265	263	0,18
3,500 % fällig am 15.09.2030	500	525	0,36	Travel + Leisure Co. 4,625 % fällig am 01.03.2030	100	103	0,07				
Hyatt Hotels Corp. 4,375 % fällig am 15.09.2028	100	110	0,08	6,625 % fällig am 31.07.2026	200	227	0,16				
Infor, Inc. 1,450 % fällig am 15.07.2023	100	101	0,07	Triumph Group, Inc. 8,875 % fällig am 01.06.2024	923	1.028	0,71				
IPALCO Enterprises, Inc. 4,250 % fällig am 01.05.2030	1.000	1.126	0,77	United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.04.2029	190	212	0,15	NON-AGENCY-MBS			
Jefferies Finance LLC 6,250 % fällig am 03.06.2026	500	525	0,36	Univision Communications, Inc. 5,125 % fällig am 15.02.2025	300	307	0,21	Banc of America Funding Trust 6,000 % fällig am 25.07.2037	242	227	0,16
JPMorgan Chase & Co. 5,000 % fällig am 01.08.2024 (f)	100	106	0,07	ViaSat, Inc. 6,500 % fällig am 15.07.2028	100	107	0,07	BCAP LLC Trust 0,532 % fällig am 25.05.2047 ^	246	256	0,18
Las Vegas Sands Corp. 3,900 % fällig am 08.08.2029	100	107	0,07	VICI Properties LP 4,250 % fällig am 01.12.2026	100	104	0,07	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 2,910 % fällig am 25.07.2036 ^	60	59	0,04
LBM Acquisition LLC 6,250 % fällig am 15.01.2029	300	303	0,21	Vine Energy Holdings LLC 6,750 % fällig am 15.04.2029	400	421	0,29	Countrywide Alternative Loan Trust 0,283 % fällig am 20.09.2046	14	12	0,01
Level 3 Financing, Inc. 3,750 % fällig am 15.07.2029	200	195	0,13	Weyerhaeuser Co. 7,375 % fällig am 15.03.2032	900	1.300	0,89	0,472 % fällig am 20.09.2046 ^	7	7	0,00
Live Nation Entertainment, Inc. 6,500 % fällig am 15.05.2027	1.000	1.113	0,76	White Cap Buyer LLC 6,875 % fällig am 15.10.2028	400	429	0,29	1,392 % fällig am 25.10.2035 ^	15	12	0,01
Manitowoc Co., Inc. 9,000 % fällig am 01.04.2026	500	544	0,37	White Cap Parent LLC (8,250 % bar oder 8,250 % PIK) 8,250 % fällig am 15.03.2026 (b)	1.100	1.142	0,78	1,516 % fällig am 25.08.2035	16	16	0,01
Marriott International, Inc. 4,625 % fällig am 15.06.2030	600	692	0,48	WP Carey, Inc. 3,850 % fällig am 15.07.2029	100	111	0,08	5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	342	256	0,18
Marriott Ownership Resorts, Inc. 4,500 % fällig am 15.06.2029	450	457	0,31	WW International, Inc. 4,500 % fällig am 15.04.2029	300	303	0,21	6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	152	146	0,10
MGM Growth Properties Operating Partnership LP 6,500 % fällig am 15.02.2029	600	611	0,42	Zayo Group Holdings, Inc. 4,000 % fällig am 01.03.2027	300	298	0,21	6,500 % fällig am 25.08.2037 ^	1.973	1.208	0,83
Midcap Financial Issuer Trust 6,500 % fällig am 01.05.2028	400	419	0,29					19,548 % fällig am 25.07.2035	196	231	0,16
MPT Operating Partnership LP 2,550 % fällig am 05.12.2023	£ 100	142	0,10	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG		45.623	31,32	28,034 % fällig am 25.09.2037	334	433	0,30
2,650 % fällig am 01.08.2029	\$ 400	429	0,30	Arches Buyer, Inc. 3,750 % fällig am 06.12.2027	100	99	0,07	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 2,951 % fällig am 25.09.2037 ^	158	156	0,11
MSCI, Inc. 4,000 % fällig am 15.11.2029	100	106	0,07	Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 3,250 % fällig am 01.12.2027	199	199	0,14	5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	9	7	0,00
Narragansett Electric Co. 3,395 % fällig am 09.04.2030	100	110	0,08	Calpine Corp. 2,610 % fällig am 16.12.2027	459	457	0,31	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 6,000 % fällig am 25.09.2035	255	139	0,09
Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,125 % fällig am 15.12.2030	600	598	0,41	CityCenter Holdings LLC TBD % - 3,250 % fällig am 18.04.2024	897	892	0,61	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 2,495 % fällig am 29.12.2037	887	688	0,47
Pacific Gas & Electric Co. 2,500 % fällig am 01.02.2031	200	188	0,13	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. 3,686 % fällig am 21.08.2026	399	390	0,27	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust 6,000 % fällig am 25.07.2036	170	131	0,09
3,150 % fällig am 01.01.2026	300	310	0,21	Core & Main LP 3,750 % fällig am 01.08.2024	796	796	0,55	6,500 % fällig am 25.10.2021 ^	162	56	0,04
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	100	105	0,07	Cornerstone Building Brands, Inc. 3,750 % fällig am 12.04.2028	1.551	1.553	1,07	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 0,232 % fällig am 25.07.2047	18	17	0,01
4,500 % fällig am 01.07.2030	200	214	0,15	Elanco Animal Health, Inc. 1,842 % fällig am 02.08.2027	583	575	0,39	0,242 % fällig am 25.02.2047	3.843	2.687	1,84
Park Intermediate Holdings LLC 4,875 % fällig am 15.05.2029	150	155	0,11	INEOS Styrolution U.S. Holding LLC 3,250 % fällig am 29.01.2026	200	200	0,14	0,472 % fällig am 25.10.2036 ^	193	87	0,06
Park River Holdings, Inc. 5,625 % fällig am 01.02.2029	800	779	0,54	IRB Holding Corp. 2,964 % - 3,750 % fällig am 05.02.2025	496	495	0,34	1,985 % fällig am 25.08.2035 ^	16	16	0,01
PennyMac Financial Services, Inc. 4,250 % fällig am 15.02.2029	500	482	0,33	MPH Acquisition Holdings LLC 3,750 % fällig am 07.06.2023	323	322	0,22	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust 2,749 % fällig am 25.08.2035 ^	9	8	0,01
PRA Group, Inc. 7,375 % fällig am 01.09.2025	1.000	1.080	0,74	Paralex International Corp. 2,845 % fällig am 27.09.2024	1.160	1.155	0,79	Impac Secured Assets Trust 0,242 % fällig am 25.11.2036	233	222	0,15
Prime Healthcare Services, Inc. 7,250 % fällig am 01.11.2025	300	325	0,22	Peraton Holding Corp. 4,500 % fällig am 01.02.2028	626	629	0,43	IndyMac Mortgage Loan Trust 0,342 % fällig am 25.02.2037	31	25	0,02
Radiate Holdco LLC 4,500 % fällig am 15.09.2026	1.100	1.141	0,78	RackSpace Hosting, Inc. 3,500 % fällig am 15.02.2028	200	199	0,14	2,585 % fällig am 25.12.2034	356	367	0,25
Rattler Midstream LP 5,625 % fällig am 15.07.2025	100	105	0,07	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 3,854 % fällig am 16.11.2025	936	935	0,64	3,118 % fällig am 25.05.2037 ^	79	74	0,05
Resolute Forest Products, Inc. 4,875 % fällig am 01.03.2026	900	933	0,64					JPMorgan Mortgage Trust 6,500 % fällig am 25.07.2036 ^	251	152	0,10
SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	200	193	0,13					Lehman XS Trust 0,272 % fällig am 25.07.2037 ^	408	392	0,27
Scripps Escrow, Inc. 3,875 % fällig am 15.01.2029	100	99	0,07					0,992 % fällig am 25.08.2047 ^	245	224	0,15
SLM Corp. 4,200 % fällig am 29.10.2025	300	323	0,22					Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2,888 % fällig am 25.11.2037	254	220	0,15
Spirit AeroSystems, Inc. 4,600 % fällig am 15.06.2028	\$ 400	\$ 393	0,27					Residential Accredited Loans, Inc. Trust 0,442 % fällig am 25.08.2035 ^	30	25	0,02
7,500 % fällig am 15.04.2025	1.100	1.177	0,81					0,842 % fällig am 25.11.2036 ^	702	519	0,36
Sprint Corp. 7,875 % fällig am 15.09.2023	600	682	0,47					3,021 % fällig am 25.07.2035	3	3	0,00
Starwood Property Trust, Inc.								3,983 % fällig am 25.12.2035 ^	20	19	0,01
								4,301 % fällig am 25.09.2035 ^	1	1	0,00
								Residential Asset Securitization Trust 5,750 % fällig am 25.03.2037 ^	238	127	0,09
								6,000 % fällig am 25.02.2036	344	218	0,15
								6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	503	288	0,20
								Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 0,572 % fällig am 25.05.2037 ^	108	110	0,08
								Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,542 % fällig am 25.05.2035 ^	1.695	1.432	0,98
										11.273	7,74

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				JUNGFERNINSELN (BRITISCH) UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
Freddie Mac 5,992 % fällig am 25.11.2055	\$ 656	\$ 399	0,28	Easy Tactic Ltd. 11,750 % fällig am 02.08.2023	\$ 200	\$ 197	0,13	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (g)	1.371.298	\$ 13.660	9,38	
Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	200	207	0,14	Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029	500	505	0,35	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)	9.239	124	0,08	
		606	0,42	6,000 % fällig am 15.07.2025	300	316	0,22					
				Summe Jungferneinseln (Britisch)		1.018	0,70					
US-SCHATZOBIGLIGATIONEN				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE KURZFRISTIGE SCHULDITITEL				BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	391	351	0,24	Federal Home Loan Bank 0,033 % fällig am 22.09.2021 (d)(e)	2.500	2.500	1,72	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	4.000	406	0,28	
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	1.647	1.613	1,11	ARGENTINA TREASURY BILLS (3,480) % fällig am 13.09.2021 (d)(e)	ARS 606	3	0,00	Summe Investmentfonds		\$ 14.190	9,74	
U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.02.2031	300	291	0,20	U.S. TREASURY BILLS 0,041 % fällig am 20.07.2021 (d)(e)(j)	\$ 3.700	3.700	2,54					
		2.255	1,55	Summe kurzfristige Instrumente		6.203	4,26					
OPTIONSSCHEINE				Summe Übertragbare Wertpapiere								
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31. Dezember 2060	753	91	0,06			\$ 127.226	87,34					
Vistra Energy Corp. - Exp. 2. Februar 2024	31.815	9	0,01									
		100	0,07									
Summe USA		82.696	56,77									

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	4	\$ (5)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2021	66	23	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	147	(80)	(0,06)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	5	24	0,02
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	8	(74)	(0,05)
				\$ (112)	(0,08)
Summe der an einem gereglten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (112)	(0,08)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Anheuser-Busch InBev S.A.	(1,000) %	20.12.2023	€ 1.300	\$ 1	0,00
AutoZone, Inc.	(1,000)	20.06.2024	\$ 1.400	4	0,00
ConocoPhillips	(1,000)	20.12.2024	100	(2)	0,00
Johnson Controls International PLC	(1,000)	20.12.2024	1.500	12	0,01
Kohl's Corp.	(1,000)	20.12.2023	300	(12)	(0,01)
L Brands, Inc.	(1,000)	20.12.2023	350	(30)	(0,02)
Lowe's Cos., Inc.	(1,000)	20.12.2023	700	2	0,00
Tyson Foods, Inc.	(1,000)	20.06.2024	1.400	10	0,01
				\$ (15)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2024	\$ 3.100	\$ 10	0,01
Bombardier, Inc.	5,000	20.12.2021	400	(3)	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20.12.2024	200	13	0,01
DISH DBS Corp.	5,000	20.12.2022	200	(1)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	100	1	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 100	15	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	200	6	0,00
Toll Brothers Finance Corp.	1,000	20.06.2026	\$ 1.000	(1)	0,00
				\$ 40	0,03

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-36 10-Year Index	(1,000) %	20.06.2031	\$ 8.000	\$ (22)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000 %	20.06.2026	\$ 4.800	\$ 36	0,02

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	15.09.2026	£ 4.000	\$ (7)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	900	(3)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	900	(23)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,789	02.01.2023	BRL 27.200	(7)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	CAD 1.100	2	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	400	6	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,963	22.04.2031	1.200	15	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,935	22.06.2051	\$ 100	(3)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,943	15.06.2051	200	(6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,945	23.06.2051	100	(3)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,968	23.06.2051	100	(4)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,848	17.12.2025	ZAR 6.700	(18)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,848	11.01.2026	6.000	(15)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,850	07.01.2026	1.200	(3)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,025	04.12.2025	17.700	(38)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,680	08.06.2026	2.300	(2)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,723	08.06.2026	1.900	(1)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 1.500	1	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 94.200	(14)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,140	24.03.2023	MXN 18.500	(12)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,160	15.05.2023	10.440	8	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,345	13.06.2023	15.300	(10)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,400	05.03.2026	27.200	(65)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,925	05.05.2026	8.880	(12)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,113	11.05.2026	4.570	(4)	0,00
					\$ (218)	(0,15)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (179)	(0,12)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF**ZINSSWAPOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	260	\$ 30	\$ 54	0,04
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	180	20	38	0,02
							\$ 50	\$ 92	0,06

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	21.07.2021	300	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	100	0	0	0,00
BRC	Call - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	400	0	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	400	(1)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	500	0	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	700	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	1.400	(2)	(1)	0,00
CBK	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	200	0	0	0,00
DUB	Call - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	300	0	0	0,00
FBF	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	400	(1)	0	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	200	0	0	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	200	0	0	0,00
MYC	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	100	0	0	0,00
						\$ (11)	\$ (4)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175 %	15.03.2023	790	\$ (29)	\$ (54)	(0,04)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	14.07.2021	200	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	14.07.2021	200	(1)	0	0,00
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	06.07.2021	300	(2)	(6)	(0,01)
DUB	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	23.07.2021	300	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	23.07.2021	300	(2)	(1)	0,00
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	06.07.2021	300	(2)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	21.07.2021	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	21.07.2021	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	11.08.2021	200	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	11.08.2021	200	(2)	(1)	0,00
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	550	(20)	(37)	(0,03)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	19.07.2021	300	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	19.07.2021	300	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,019	02.07.2021	100	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,022	02.07.2021	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	10.08.2021	200	(3)	(5)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	10.08.2021	200	(3)	0	0,00
							\$ (75)	\$ (117)	(0,08)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	\$ 102,234	12.08.2021	200	\$ (1)	\$ 0	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
CBK	Mexico Government International Bond	(1,000) %	20.12.2023	\$ 2.200	\$ 25	\$ (56)	\$ (31)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Baidu, Inc.	1,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ 0	\$ 2	\$ 2	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	1	4	5	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	100	0	1	1	0,00
FBF	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	1	13	14	0,01
					\$ 2	\$ 20	\$ 22	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2023	\$ 100	\$ 10	\$ 1	\$ 11	0,01
GST	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	200	23	(1)	22	0,01
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	300	39	(7)	32	0,02
					\$ 72	\$ (7)	\$ 65	0,04

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	MXN	1.384	\$ 70	\$ 1	\$ 1	0,00	
	09.2021	\$	90	PLN 343	0	0	0,00	
BPS	07.2021	€	1.187	\$ 1.440	32	0	0,03	
	07.2021	\$	1.305	¥ 142.700	0	(19)	(0,01)	
BRC	11.2021		16	MXN 323	0	0	0,00	
	07.2021		374	€ 307	0	(10)	(0,01)	
CBK	07.2021		445	£ 319	0	(5)	0,00	
	09.2021		59	PLN 225	0	0	0,00	
CBK	07.2021	PEN	3.185	\$ 870	37	0	0,02	
	07.2021	RUB	3.201	41	0	(2)	0,00	
GLM	07.2021	\$	152	BRL 767	1	0	0,00	
	08.2021		357	MXN 7.461	16	0	0,01	
GLM	09.2021		51	ZAR 703	0	(3)	0,00	
	11.2021	PEN	5.523	\$ 1.441	0	(5)	0,00	
GLM	03.2022	\$	788	PEN 2.901	0	(30)	(0,02)	
	07.2021	BRL	3.174	\$ 632	0	0	0,00	
GLM	07.2021	£	3.342	4.725	108	0	0,07	
	07.2021	RUB	6.417	83	0	(5)	0,00	
GLM	08.2021	\$	630	BRL 3.174	0	0	0,00	
	08.2021		299	COP 1.113.540	0	(1)	0,00	
GLM	09.2021		95	PLN 360	0	0	0,00	
	09.2021		31	ZAR 427	0	(1)	0,00	
HUS	07.2021		4.184	£ 3.023	0	(8)	(0,01)	
	08.2021	£	3.023	\$ 4.184	8	0	0,01	
HUS	09.2021	CNH	804	125	1	0	0,00	
	09.2021	\$	107	PLN 411	1	0	0,00	
JPM	09.2021		164	IDR 2.363.703	0	(3)	0,00	
	07.2021	€	307	\$ 365	2	0	0,00	
MYI	07.2021	RUB	3.151	41	0	(2)	0,00	
	07.2021	\$	451	BRL 2.407	29	0	0,02	
SCX	07.2021	€	4.091	\$ 5.005	153	0	0,10	
	12.2021	\$	281	INR 21.084	0	(3)	0,00	
SOG	07.2021	RUB	3.657	\$ 47	0	(3)	0,00	
UAG	07.2021		10.360	135	0	(6)	(0,01)	
	07.2021	\$	310	RUB 22.801	3	(2)	0,00	
					\$ 392	\$ (108)	\$ 284	0,20

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 8.449	CHF 7.580	\$ 0	\$ (249)	\$ (249)	(0,17)
BRC	07.2021	68	61	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07.2021	CHF 7.609	\$ 8.265	33	0	33	0,02
	07.2021	\$ 8.460	CHF 7.586	0	(254)	(254)	(0,18)
	08.2021	8.272	7.609	0	(33)	(33)	(0,02)
MYI	07.2021	8.296	7.475	0	(210)	(210)	(0,14)
				\$ 33	\$ (748)	\$ (715)	(0,49)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 765	€ 631	\$ 0	\$ (16)	\$ (16)	(0,01)
BPS	07.2021	20.067	16.425	0	(588)	(588)	(0,40)
BRC	07.2021	€ 1.969	\$ 2.399	64	0	64	0,04
GLM	07.2021	\$ 28	€ 23	0	(1)	(1)	0,00
HUS	07.2021	€ 212	\$ 258	7	0	7	0,01
	07.2021	\$ 687	€ 576	0	(4)	(4)	0,00
MYI	07.2021	152	128	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07.2021	2.371	1.938	0	(72)	(72)	(0,05)
SCX	07.2021	22.257	18.193	0	(681)	(681)	(0,47)
TOR	07.2021	22.138	18.096	0	(678)	(678)	(0,47)
UAG	07.2021	25	21	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 71	\$ (2.042)	\$ (1.971)	(1,35)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (2.375)	(1,63)
Summe Anlagen						\$ 138.750	95,25
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 6.926	4,75
Nettovermögen						\$ 145.676	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
AWAS Aviation Capital Ltd. 4,870 % fällig am 03.10.2021	02.10.2014	\$ 671	\$ 677	0,46
Stearns Holdings LLC 'B'	15.03.2021	276	226	0,15
		\$ 947	\$ 903	0,61

(j) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 421 und Barmittel in Höhe von USD 990 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 3.873 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 9	\$ 125.823	\$ 1.394	\$ 127.226
Investmentfonds	13.784	406	0	14.190
Finanzderivate ⁽³⁾	(5)	(2.661)	0	(2.666)
Summen	\$ 13.788	\$ 123.568	\$ 1.394	\$ 138.750

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 12	\$ 129.748	\$ 1.123	\$ 130.883
Investmentfonds	8.574	407	0	8.981
Pensionsgeschäfte	0	495	0	495
Finanzderivate ⁽³⁾	(54)	1.706	0	1.652
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(519)	0	(519)
Summen	\$ 8.532	\$ 131.837	\$ 1.123	\$ 141.492

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (264)	\$ 0	\$ (264)
BPS	(577)	450	(127)
BRC	52	0	52
CBK	(266)	0	(266)
DUB	(3)	0	(3)
FBF	14	0	14
GLM	95	0	95
GST	21	0	21
HUS	5	0	5
JPM	30	0	30
MYC	(10)	0	(10)
MYI	(182)	10	(172)
RBC	(72)	0	(72)
SCX	(531)	421	(110)
SOG	(3)	0	(3)
TOR	(678)	530	(148)
UAG	(6)	0	(6)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	28,22	34,68
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	53,11	49,69
Sonstige übertragbare Wertpapiere	6,01	6,21
Investmentfonds	9,74	6,21
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,08)	(0,04)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,12)	(0,09)
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,63)	1,27
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,36)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Argentinien	0,20	0,22
Australien	0,03	0,02
Österreich	0,33	0,68
Bermuda	0,90	0,45
Brasilien	0,77	0,74
Kanada	1,50	1,12

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Cayman-Inseln	5,83	3,73
China	0,54	0,14
Kolumbien	k. A.	0,14
Curacao	0,07	0,07
Finnland	0,28	k. A.
Frankreich	0,61	0,47
Deutschland	0,26	1,35
Guernsey, Kanalinseln	0,53	0,54
Hongkong	0,14	k. A.
Indien	0,29	0,29
Irland	0,46	0,50
Italien	0,84	0,87
Japan	k. A.	0,22
Jersey, Kanalinseln	0,60	0,61
Liberia	0,71	0,16
Luxemburg	1,39	2,21
Mauritius	k. A.	0,38
Mexiko	0,15	0,15
Multinational	0,67	0,45
Niederlande	1,74	2,02
Norwegen	0,08	0,09
Peru	0,92	1,11
Katar	0,31	0,33
Russland	0,31	1,06
Singapur	0,08	0,08
Südafrika	k. A.	0,51
Spanien	k. A.	0,30
Schweden	0,33	0,34
Ukraine	0,07	0,07
Großbritannien	4,67	2,77
USA	56,77	65,42
Jungferninseln (British)	0,70	k. A.
Kurzfristige Instrumente	4,26	0,97
Investmentfonds	9,74	6,21
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,08)	(0,04)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,01)	(0,10)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,02	k. A.
Zinsswaps	(0,15)	0,03
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,06	0,03
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,08)	(0,04)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,02)	(0,03)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,04	0,04
Devisenterminkontrakte	0,20	(0,05)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,84)	1,32
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,36)
Sonstige Aktiva und Passiva	4,75	2,09
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
ISRAEL											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
Huarong Finance Co. Ltd. 1,275 % fällig am 24.02.2023	\$ 12.200	\$ 9.125	0,05	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 0,720 % fällig am 15.01.2031	€ 8.600	\$ 10.186	0,05	Energean Israel Finance Ltd. 4,500 % fällig am 30.03.2024	\$ 11.700	\$ 11.978	0,06
2,125 % fällig am 30.09.2023	54.800	41.792	0,22	1,050 % fällig am 15.01.2031	1.000	1.185	0,01				
2,500 % fällig am 24.02.2023	7.600	5.873	0,03	Carlyle Euro CLO DAC 0,630 % fällig am 15.08.2030	400	474	0,00				
Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026	16.200	16.559	0,09	0,700 % fällig am 15.01.2031	12.700	15.061	0,08				
Summe Hongkong		166.760	0,89	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,750 % fällig am 15.11.2031	8.150	9.623	0,05				
INDIEN											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
Adani Electricity Mumbai Ltd. 3,949 % fällig am 12.02.2030	3.800	3.802	0,02	CVC Cordatus Loan Fund DAC 0,650 % fällig am 15.10.2031	20.000	23.770	0,13	Aeroporti di Roma SpA 1,750 % fällig am 30.07.2031	€ 3.700	4.579	0,02
Dryden Euro CLO BV 0,860 % fällig am 15.05.2034 (c)				Griffith Park CLO DAC 0,720 % fällig am 21.11.2031	16.000	18.974	0,10	Atlantia SpA 1,625 % fällig am 03.02.2025	8.400	10.237	0,05
Export-Import Bank of India 3,250 % fällig am 15.01.2030	2.200	2.240	0,01	Harvest CLO DAC 0,650 % fällig am 26.06.2030	2.700	3.199	0,02	1,875 % fällig am 13.07.2027	3.200	3.938	0,02
3,375 % fällig am 20.05.2026	5.900	6.299	0,04	0,760 % fällig am 15.07.2031	11.400	13.560	0,07	1,875 % fällig am 12.02.2028	63.400	77.479	0,42
		8.539	0,05	1,040 % fällig am 15.07.2031	1.600	1.901	0,01	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,875 % fällig am 09.01.2026	3.900	4.598	0,02
Summe Indien		12.341	0,07	Madison Park Euro Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2032	50.000	59.378	0,32	2,625 % fällig am 28.04.2025	40.335	48.668	0,26
INDONESIEN											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % fällig am 04.02.2039	182	212	0,00	Man GLG Euro CLO DAC 0,690 % fällig am 15.12.2031	11.800	14.020	0,07	3,625 % fällig am 24.09.2024	31.656	39.214	0,21
Pelabuhan Indonesia Persero PT 4,875 % fällig am 01.10.2024	5.700	6.304	0,04	OAK Hill European Credit Partners DAC 0,730 % fällig am 20.01.2032	2.200	2.611	0,01	4,000 % fällig am 10.07.2022 (I)	26.700	32.345	0,17
Pertamina Persero PT 1,400 % fällig am 09.02.2026	14.600	14.353	0,08	0,740 % fällig am 20.10.2031	22.200	26.293	0,14	5,375 % fällig am 18.01.2028 (I)	37.166	36.388	0,20
4,875 % fällig am 03.05.2022	1.990	2.065	0,01	Segovia European CLO DAC 0,880 % fällig am 20.07.2032 (c)	11.100	13.163	0,07	8,000 % fällig am 22.01.2030	29.650	32.314	0,17
6,500 % fällig am 07.11.2048	39.300	52.217	0,28	Vendome Funding CLO DAC 1,860 % fällig am 20.07.2031	7.700	9.141	0,05	8,500 % fällig am 10.09.2030	35.000	38.414	0,21
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 3,000 % fällig am 30.06.2030	20.700	20.795	0,11	Laurelin DAC 0,720 % fällig am 20.10.2031	12.000	14.218	0,08	Immobiliare Grande Distribuzione SIQ SpA 2,125 % fällig am 28.11.2024	300	357	0,00
		95.946	0,52	Madison Park Euro Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2032	50.000	59.378	0,32	Intesa Sanpaolo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2024	\$ 9.200	9.792	0,05
Summe Indonesien		400.310	2,15	Man GLG Euro CLO DAC 0,690 % fällig am 15.12.2031	11.800	14.020	0,07	4,000 % fällig am 23.09.2029	11.976	13.153	0,07
IRLAND											
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE											
Accunia European CLO DAC 0,930 % fällig am 15.10.2030	€ 1.400	1.659	0,01	ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC 2,700 % fällig am 11.06.2023	29.250	35.574	0,19	4,198 % fällig am 01.06.2032	1.500	1.540	0,01
Adagio CLO DAC 0,720 % fällig am 15.10.2031	6.300	7.463	0,04	AerCap Ireland Capital DAC 3,150 % fällig am 15.02.2024	\$ 15.300	16.069	0,09	5,017 % fällig am 26.06.2024	18.037	19.635	0,11
Ares European CLO DAC 0,660 % fällig am 15.10.2030	2.000	2.370	0,01	3,500 % fällig am 15.01.2025	200	212	0,00	5,148 % fällig am 12.09.2020	€ 6.400	10.094	0,05
0,780 % fällig am 15.10.2031	16.400	19.449	0,10	3,650 % fällig am 21.07.2027	400	428	0,00	5,710 % fällig am 15.01.2026	\$ 10.200	11.545	0,06
Armada Euro CLO DAC 0,720 % fällig am 15.07.2031	12.200	14.439	0,08	4,450 % fällig am 01.10.2025	400	441	0,00	5,500 % fällig am 01.03.2028 (h)(j)	€ 49.379	64.561	0,35
Bain Capital Euro DAC 0,740 % fällig am 20.01.2032	6.000	7.108	0,04	4,450 % fällig am 03.04.2026	6.050	6.647	0,04	5,710 % fällig am 15.01.2026	\$ 10.200	11.545	0,06
Black Diamond CLO DAC 0,860 % fällig am 20.01.2032	2.500	2.967	0,02	4,625 % fällig am 15.10.2027	41.050	46.011	0,25	5,875 % fällig am 01.09.2031 (h)(j)	€ 12.100	16.336	0,09
Blackrock European CLO DAC 0,620 % fällig am 15.10.2031	12.000	14.169	0,08	AIB Group PLC 6,250 % fällig am 23.06.2025 (h)(j)	€ 6.600	8.923	0,05	7,750 % fällig am 11.01.2027 (h)(j)	800	1.164	0,01
				Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025 (h)(j)	17.900	25.128	0,13	Telecom Italia SpA 2,375 % fällig am 12.10.2027	200	247	0,00
Summe Irland		593.674	3,18	GE Capital International Funding Co. Unlimited Co. 4,418 % fällig am 15.11.2035	\$ 2.600	3.121	0,02	UniCredit SpA 1,200 % fällig am 20.01.2026	10.500	12.717	0,07
INSEL MAN											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
NE Property BV 2,625 % fällig am 22.05.2023	€ 4.800	5.923	0,03	James Hardie International Finance DAC 3,625 % fällig am 01.10.2026	€ 5.000	6.078	0,03	1,800 % fällig am 20.01.2030	10.500	12.948	0,07
3,375 % fällig am 14.07.2027	29.750	39.270	0,21	Liberty Mutual Finance Europe DAC 1,750 % fällig am 27.03.2024	400	496	0,00	2,200 % fällig am 22.07.2027	51.600	65.121	0,35
Summe Insel Man		45.193	0,24	Mobile Telesystems OJSC Via MTS International Funding DAC 5,000 % fällig am 30.05.2023	\$ 1.600	1.699	0,01	2,569 % fällig am 22.09.2026	\$ 18.750	19.020	0,10
				Perrigo Finance Unlimited Co. 3,150 % fällig am 15.06.2030	1.900	1.943	0,01	4,086 % fällig am 14.01.2022	8.925	9.087	0,05
				Ryanair DAC 0,875 % fällig am 25.05.2026	€ 21.700	25.850	0,14	5,459 % fällig am 30.06.2035	400	437	0,00
				SMBC Aviation Capital Finance DAC 2,300 % fällig am 15.06.2028	\$ 900	911	0,00	6,572 % fällig am 14.01.2022	9.100	9.382	0,05
						209.013	1,12	6,750 % fällig am 10.09.2021 (h)(j)	€ 500	600	0,00
						593.674	3,18	7,500 % fällig am 03.06.2026 (h)(j)	€ 6.100	8.596	0,05
								7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 94.450	109.492	0,59
								Unipol Gruppo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2030	€ 63.800	85.324	0,46
								Summe Italien		809.322	4,34
								ELFENBEINKÜSTE			
								STAATSEMISSIONEN			
								Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	4.600	5.714	0,03
								5,875 % fällig am 17.10.2031	3.450	4.410	0,02
								6,625 % fällig am 22.03.2048	29.900	37.341	0,20
								6,875 % fällig am 17.10.2040	3.500	4.549	0,03
								Summe Elfenbeinküste		52.014	0,28
								JAPAN			
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % fällig am 17.03.2026	3.900	5.044	0,03
								3,201 % fällig am 17.09.2028	9.900	13.313	0,07
								4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 92.000	101.210	0,54
								4,810 % fällig am 17.09.2030	5.600	6.328	0,03
								Summe Japan		131.461	0,70
								STAATSEMISSIONEN			
								Japan Government International Bond 0,600 % fällig am 20.06.2050	¥ 630.000	5.566	0,03
								Summe Japan		131.461	0,70

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				NIGERIA STAATSEMISSIONEN				RUMÄNIEN STAATSEMISSIONEN			
Athora Netherlands NV 7,000 % fällig am 19.06.2025 (h)(j)	€ 5.000	\$ 6.823	0,04	Nigeria Government International Bond 6,500 % fällig am 28.11.2027	\$ 700	\$ 744	0,00	Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033	€ 1.500	\$ 1.769	0,01
Atrium Finance Issuer BV 2,625 % fällig am 05.09.2027	21.700	27.851	0,15	7,143 % fällig am 23.02.2030	11.800	12.486	0,07	4,125 % fällig am 11.03.2039	22.600	31.844	0,17
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	4.700	5.597	0,03	7,625 % fällig am 28.11.2047	19.900	19.957	0,11	Summe Rumänien		33.613	0,18
Conti-Gummi Finance BV 1,125 % fällig am 25.09.2024	4.200	5.149	0,03	7,875 % fällig am 16.02.2032	26.600	28.730	0,15	Summe Russland		99.920	0,54
1,125 % fällig am 27.11.2023	11.900	14.828	0,08	Summe Nigeria		61.917	0,33	RUSSLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % fällig am 18.03.2033	33.100	39.640	0,21	NORWEGEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				ALROSA Finance S.A. 3,100 % fällig am 25.06.2027	\$ 24.600	25.291	0,14
ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026 (h)(j)	\$ 10.600	11.749	0,06	Aker BP ASA 3,750 % fällig am 15.01.2030	13.915	15.031	0,08	4,650 % fällig am 09.04.2024	3.200	3.464	0,02
6,500 % fällig am 16.04.2025 (h)(j)	21.902	24.469	0,13	Summe Norwegen				MMK International Capital DAC 4,375 % fällig am 13.06.2024	9.500	10.205	0,05
6,750 % fällig am 16.04.2024 (h)(j)	16.880	18.652	0,10	OMAN STAATSEMISSIONEN				Summe Rumänien		33.613	0,18
JAB Holdings BV 2,250 % fällig am 19.12.2039	€ 1.800	2.249	0,01	Oman Government International Bond 6,250 % fällig am 25.01.2031	40.400	43.497	0,23	RUSSLAND STAATSEMISSIONEN			
Kazakhstan Temir Zholy Finance BV 6,950 % fällig am 10.07.2042	\$ 300	413	0,00	6,500 % fällig am 08.03.2047	22.600	22.185	0,12	Russia Government International Bond 2,875 % fällig am 04.12.2025	€ 32.200	41.787	0,22
LeasePlan Corp. NV 0,750 % fällig am 03.10.2022	€ 1.500	1.801	0,01	6,750 % fällig am 17.01.2048	58.600	58.490	0,32	4,750 % fällig am 27.05.2026	\$ 11.200	12.742	0,07
MDGH - GMTN BV 2,500 % fällig am 21.05.2026	\$ 7.500	7.891	0,04	Summe Oman		124.172	0,67	5,625 % fällig am 04.04.2042	5.000	6.431	0,04
3,950 % fällig am 21.05.2050	11.300	12.947	0,07	PANAMA STAATSEMISSIONEN				Summe Russland		99.920	0,54
Metinvest BV 7,750 % fällig am 23.04.2023	200	215	0,00	Panama Government International Bond 6,700 % fällig am 26.01.2036	24.200	32.931	0,17	SAUDI-ARABIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
NN Group NV 4,500 % fällig am 15.01.2026 (h)	€ 22.800	30.977	0,17	8,125 % fällig am 28.04.2034	700	1.010	0,01	Saudi Arabian Oil Co. 2,875 % fällig am 16.04.2024	11.000	11.593	0,06
Q-Park Holding BV 2,000 % fällig am 01.03.2027	1.500	1.699	0,01	Summe Panama		33.941	0,18	STAATSEMISSIONEN			
3,500 % fällig am 01.02.2025	38.350	46.203	0,25	PARAGUAY STAATSEMISSIONEN				Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	1.500	1.510	0,01
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	26.600	35.175	0,19	Paraguay Government International Bond 5,600 % fällig am 13.03.2048	8.300	9.784	0,05	2,900 % fällig am 22.10.2025	2.000	2.144	0,01
4,441 % fällig am 24.04.2023	\$ 9.450	9.981	0,05	6,100 % fällig am 11.08.2044	5.000	6.235	0,04	4,000 % fällig am 17.04.2025	40.600	44.897	0,24
4,892 % fällig am 24.04.2025	47.500	52.683	0,28	Summe Paraguay		16.019	0,09	4,500 % fällig am 26.10.2046	137.500	161.635	0,87
5,182 % fällig am 24.04.2028	11.654	13.329	0,07	PERU STAATSEMISSIONEN				5,000 % fällig am 17.04.2049	300	380	0,00
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,125 % fällig am 15.10.2024	€ 39.100	43.563	0,23	Peru Government International Bond 2,783 % fällig am 23.01.2031	11.900	12.153	0,06	5,250 % fällig am 16.01.2050	600	787	0,01
1,250 % fällig am 31.03.2023	7.384	8.578	0,05	3,300 % fällig am 11.03.2041	34.200	34.635	0,19	Summe Saudi-Arabien		222.946	1,20
2,200 % fällig am 21.07.2021	€ 17.756	17.753	0,10	Summe Peru		46.788	0,25	SERBIEN STAATSEMISSIONEN			
4,500 % fällig am 01.03.2025	€ 12.900	15.837	0,09	PORTUGAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Serbia Government International Bond 1,650 % fällig am 03.03.2033	€ 10.400	12.102	0,06
6,000 % fällig am 31.01.2025	500	640	0,00	Banco Espirito Santo S.A. 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	€ 200	38	0,00	3,125 % fällig am 15.05.2027	1.400	1.850	0,01
United Group BV 3,625 % fällig am 15.02.2028	1.600	1.849	0,01	Galp Energia SGPS S.A. 2,000 % fällig am 15.01.2026	21.300	26.622	0,14	Summe Serbien		13.952	0,07
4,875 % fällig am 01.07.2024	230	276	0,00	Summe Portugal		26.660	0,14	SINGAPUR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UPC Broadband Finco BV 4,875 % fällig am 15.07.2031	\$ 57.100	57.303	0,31	KATAR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Flex Ltd. 3,750 % fällig am 01.02.2026	\$ 34.000	37.214	0,20
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£ 8.400	11.704	0,06	Nakilat, Inc. 6,067 % fällig am 31.12.2033	\$ 14.950	18.448	0,10	SLOWENIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Volkswagen International Finance NV 3,500 % fällig am 17.06.2025 (h)	€ 11.900	15.265	0,08	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. 5,838 % fällig am 30.09.2027	12.831	14.740	0,08	Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 8.200	9.506	0,05
3,875 % fällig am 17.06.2029 (h)	22.600	29.821	0,16	6,332 % fällig am 30.09.2027	3.270	3.762	0,02	Summe Slowenien			
ZF Europe Finance BV 2,000 % fällig am 23.02.2026	17.300	20.774	0,11	Summe Katar		36.950	0,20	SUDAFRIKA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Summe Niederlande		593.684	3,18	STAATSEMISSIONEN				AngloGold Ashanti Holdings PLC 3,750 % fällig am 01.10.2030	\$ 2.000	2.071	0,01
				Qatar Government International Bond 4,400 % fällig am 16.04.2050	64.500	78.656	0,42	Growthpoint Properties International Pty. Ltd. 5,872 % fällig am 02.05.2023	2.000	2.147	0,01
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				4,500 % fällig am 23.04.2028	6.600	7.802	0,04	SASOL Financing USA LLC 5,875 % fällig am 27.03.2024	4.700	5.031	0,03
Diamond (BC) BV 3,147 % - 3,186 % fällig am 06.09.2024	\$ 1.083	1.079	0,01	4,625 % fällig am 02.06.2046	220	273	0,00	Summe Südafrika		9.249	0,05
Sigma Bidco BV 3,500 % fällig am 02.07.2025	€ 44.400	51.379	0,27	4,817 % fällig am 14.03.2049	13.700	17.674	0,10	STAATSEMISSIONEN			
Ziggo BV 3,000 % fällig am 31.01.2029	22.560	26.585	0,14	5,103 % fällig am 23.04.2048	6.200	8.246	0,04	South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029	16.100	17.120	0,09
Ziggo Financing Partnership BV 2,573 % fällig am 30.04.2028	\$ 19.040	18.879	0,10	Summe Katar		149.601	0,80	4,875 % fällig am 14.04.2026	7.700	8.379	0,04
Summe Niederlande		97.922	0,52					5,000 % fällig am 12.10.2046	18.800	17.887	0,10
NON-AGENCY-MBS											
EMF-NL Prime BV 0,263 % fällig am 17.04.2041	€ 41	47	0,00								
Eurosail PLC 0,963 % fällig am 17.10.2040	361	431	0,00								
		478	0,00								
		745.543	3,99								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
VENEZUELA				0,005 % fällig am 20.07.2021 (f)(g)				INVESTMENTFONDS				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,015 % fällig am 29.07.2021 (f)(g)(m)				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
Petroleos de Venezuela S.A.					45.000	44.998	0,24	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (i)				
6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	\$ 8.400	378	0,00	0,015 % fällig am 05.08.2021 (f)(g)	120.500	120.495	0,65	3.488.745	\$	35.481	0,19	
STAATSEMISSIONEN				0,015 % fällig am 26.08.2021 (f)(g)				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (i)				
Venezuela Government International Bond				0,020 % fällig am 01.07.2021 (f)(g)	42.900	42.900	0,23	7.821.400		92.684	0,50	
6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	2.651	263	0,00	0,025 % fällig am 15.07.2021 (f)(g)	83.900	83.899	0,45	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (i)				
7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	16.792	1.797	0,01	0,027 % fällig am 28.10.2021 (f)(g)(m)	159.200	159.187	0,85	3.637.652		46.633	0,25	
9,250 % fällig am 07.05.2028 ^	7.813	820	0,01	0,032 % fällig am 04.11.2021 (f)(g)(m)	5.100	5.099	0,03	52.324.201		533.707	2,86	
		2.880	0,02	0,041 % fällig am 23.09.2021 (f)(g)	8.600	8.598	0,05	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)				
Summe Venezuela		3.258	0,02	0,041 % fällig am 30.09.2021 (c)(f)(g)(m)	107.000	106.989	0,57	19.567.251		194.909	1,04	
JUNGFERNINSELN (BRITISCH)				0,051 % fällig am 30.09.2021 (c)(f)(g)(m)				BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,053 % fällig am 19.08.2021 (f)(g)				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (i)				
Champion Path Holdings Ltd.				0,061 % fällig am 19.08.2021 (f)(g)	5.500	5.499	0,03	9.439.840		958.601	5,14	
4,500 % fällig am 27.01.2026	6.800	7.084	0,04	0,061 % fällig am 02.09.2021 (f)(g)(m)	57.900	57.893	0,31	Summe Investmentfonds				
Easy Tactic Ltd.				0,096 % fällig am 22.07.2021 (f)(g)(m)	172.600	172.591	0,92	\$	1.862.015	9,98		
11,625 % fällig am 03.09.2024	300	286	0,00	Summe kurzfristige Instrumente	242.000	241.987	1,30					
Summe Jungferneinseln (Britisch)		7.370	0,04	Summe Übertragbare Wertpapiere	13.500	13.500	0,07					
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				1,453.319								
COMMERCIAL PAPER				1,499.887								
Sunac China Holdings Ltd.				Summe Investmentfonds								
5,950 % fällig am 30.12.2021 (k)	46.500	46.533	0,25	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 16.043.337	85,98						
ARGENTINA TREASURY BILLS				5,997								
(3,480) % fällig am 13.09.2021 (f)(g) ARS	5.997	35	0,00									
U.S. TREASURY BILLS				15.000								
0,005 % fällig am 01.07.2021 (f)(g)	\$	15.000	0,08									
0,005 % fällig am 08.07.2021 (f)(g)(m)		42.700	0,23									

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BOS	0,040 %	29.06.2021	06.07.2021	\$ 150.000	U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.05.2048	\$ (154.028)	\$ 150.000	\$ 150.002	0,80
FICC	0,000	30.06.2021	01.07.2021	32.917	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022	(33.575)	32.917	32.917	0,18
MBC	0,040	30.06.2021	01.07.2021	309.500	U.S. Treasury Bonds 0,00 % fällig am 02.09.2021	(18.547)	309.500	309.500	1,66
					U.S. Treasury Notes 0,250 % - 1,875 % fällig am 31.05.2022 - 30.09.2027	(262.312)			
	0,040	30.06.2021	07.07.2021	150.000	U.S. Treasury Floating Rate Note 0,084 % fällig am 30.04.2023	(38.510)			
					U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % - 0,625 % fällig am 15.04.2022 - 15.04.2026	(154.737)	150.000	150.000	0,80
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (661.709)	\$ 642.417	\$ 642.419	3,44

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	156	\$ 69	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2021	2.330	(478)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	1.565	1.799	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2021	7.523	(2.658)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	2.301	(803)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	23.303	25.328	0,13
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2021	4.653	40.330	0,22
				\$ 63.587	0,34
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 63.587	0,34

Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 27.300	\$ 486	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	9.200	21	0,00
Atlantia SpA	1,000	20.06.2025	€ 11.800	961	0,01
Atlantia SpA	1,000	20.12.2025	22.600	1.000	0,01
Auchan Holding S.A.	1,000	20.12.2027	8.000	192	0,00
Casino Guichard Perrachon S.A.	1,000	20.12.2021	11.000	769	0,01
Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.06.2022	19.900	2.554	0,01
Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.12.2022	16.300	1.709	0,01
Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.06.2023	9.900	(22)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2023	\$ 3.700	(387)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	5.400	386	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	14.300	547	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	7.400	223	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	36.800	273	0,00
Glencore Finance (Europe) Ltd.	5,000	20.12.2025	€ 38.900	(592)	0,00
Glencore Finance (Europe) Ltd.	5,000	20.12.2027	26.000	(596)	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	20.600	651	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2025	14.000	512	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.06.2027	2.862	30	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	69.500	(2.634)	(0,01)
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2026	23.300	145	0,00
				\$ 6.228	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 608.125	\$ 1.362	0,01
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	562.275	5.743	0,03
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	21.400	67	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	187.100	506	0,00
iTraxx Crossover 35 5-Year Index	5,000	20.06.2026	€ 970.200	12.482	0,07
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	879.600	907	0,00
				\$ 21.067	0,11

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	Variable Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		0,500 %	16.09.2025	£ 21.100	\$ (214)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		0,500	15.09.2026	114.000	(362)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		0,750	15.09.2031	6.500	(23)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		0,880	03.03.2024	CAD 273.400	(502)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		2,500	19.06.2029	91.700	1.163	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2025	\$ 180.850	3.338	0,02
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,250	15.09.2026	€ 249.600	452	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,500	15.09.2051	113.700	(167)	0,00
						\$ 3.685	0,02
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 30.980	0,17

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSoPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000 %	20.10.2021	5.800	\$ (26)	\$ (16)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	22.700	(22)	(4)	0,00
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	31.900	(33)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	6.900	(43)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	32.200	(38)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	16.500	(22)	(6)	0,00
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	40.700	(50)	(38)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	17.600	(10)	(11)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	17.600	(23)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	33.500	(37)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	32.800	(35)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	137.200	(192)	(38)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	67.000	(77)	(15)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	31.800	(35)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	32.000	(35)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	36.400	(49)	(14)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	40.900	(40)	(28)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	130.400	(140)	(79)	0,00
CBK	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	9.400	(42)	(26)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	22.000	(24)	(3)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	23.100	(22)	(5)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	69.000	(71)	(17)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	33.700	(38)	(7)	0,00
FBF	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	33.000	(36)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	34.100	(44)	(13)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	41.700	(47)	(39)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	15.09.2021	5.100	(30)	(11)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	20.10.2021	9.800	(58)	(43)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	20.400	(21)	(4)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	22.600	(21)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	20.400	(20)	(6)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	44.800	(47)	(11)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	23.900	(23)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	34.900	(45)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	22.000	(22)	(3)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	23.700	(24)	(3)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	45.300	(48)	(30)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	44.600	(47)	(25)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	32.100	(42)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	32.300	(33)	(2)	0,00
	JPM	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	25.200	(31)	(17)
Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index		Verkauf	0,850	20.10.2021	39.400	(48)	(24)	0,00
MYC	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	6.800	(16)	(2)	0,00
						\$ (1.807)	\$ (583)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlt/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BPS	Hochtief AG	5,000 %	20.12.2025	€ 5.900	\$ 1.387	\$ (108)	\$ 1.279	0,01
BRC	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	11.900	2.797	(217)	2.580	0,01
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2025	\$ 34.400	(1.545)	2.067	522	0,00
CBK	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2031	61.600	(2.646)	683	(1.963)	(0,01)
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 1.200	113	19	132	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 27.520	(1.082)	1.464	382	0,00
	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	€ 5.000	1.182	(98)	1.084	0,01
FBF	Intrum AB	5,000	20.12.2024	6.400	599	105	704	0,00
GST	Intrum AB	5,000	20.12.2024	41.200	4.386	147	4.533	0,03
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 29.580	(1.163)	1.574	411	0,00
JPM	Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.12.2022	€ 2.900	120	(5)	115	0,00
	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	13.400	3.132	(227)	2.905	0,02
MYC	Intrum AB	5,000	20.12.2024	1.000	92	18	110	0,00
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	6.400	650	54	704	0,00
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	8.200	893	9	902	0,01
					\$ 8.915	\$ 5.485	\$ 14.400	0,08

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income Fund (Forts.)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	AUD	23.345	\$ 17.579	\$ 53	\$ 53	0,00	
	07.2021	NOK	780.115	\$ 90.993	336	336	0,00	
	08.2021	RUB	1.857	25	0	(1)	0,00	
	08.2021	\$	17.581	AUD 23.345	0	(52)	(52)	0,00
	08.2021	\$	91.006	NOK 780.115	0	(335)	(335)	0,00
	09.2021	IDR	32.437.582	\$ 2.251	39	0	39	0,00
	09.2021	RUB	3.567	49	1	0	1	0,00
	09.2021	\$	213	PLN 809	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	€	1.669.388	\$ 2.041.445	61.716	0	61.716	0,33
	07.2021	¥	677.268	6.192	90	0	90	0,00
07.2021	\$	71.792	AUD 92.381	0	(2.437)	(2.437)	(0,01)	
07.2021	\$	14.512	€ 12.146	0	(108)	(108)	0,00	
07.2021	\$	1.229	£ 885	0	(7)	(7)	0,00	
08.2021	\$	9.054	MXN 193.111	605	0	605	0,00	
11.2021	MXN	208.771	\$ 10.342	30	0	30	0,00	
02.2022	\$	7.321	ZAR 115.010	496	0	496	0,00	
07.2021	CHF	125	\$ 139	4	0	4	0,00	
07.2021	\$	1.176	£ 829	0	(30)	(30)	0,00	
07.2021	\$	96.325	SEK 798.540	0	(2.951)	(2.951)	(0,02)	
09.2021	\$	140	PLN 531	0	0	0	0,00	
07.2021	RUB	1.875	\$ 24	0	(1)	(1)	0,00	
07.2021	\$	93.396	NOK 780.115	0	(2.740)	(2.740)	(0,01)	
08.2021	RUB	1.692	\$ 23	0	0	0	0,00	
08.2021	\$	229	MXN 4.791	11	0	11	0,00	
09.2021	ZAR	76.938	\$ 5.594	257	0	257	0,00	
07.2021	RUB	3.759	49	0	(3)	(3)	0,00	
08.2021	\$	2.364	32	0	(1)	(1)	0,00	
09.2021	\$	4.554	62	0	0	0	0,00	
09.2021	TWD	4.327	158	2	0	2	0,00	
09.2021	\$	224	PLN 851	0	0	0	0,00	
09.2021	ZAR	37.283	\$ 2.709	122	0	122	0,00	
07.2021	£	1.244	1.765	46	0	46	0,00	
07.2021	\$	5.829	€ 4.771	0	(171)	(171)	0,00	
07.2021	\$	6.618	£ 4.727	0	(88)	(88)	0,00	
08.2021	RUB	3.819	\$ 51	0	(1)	(1)	0,00	
09.2021	KRW	716.416	643	9	0	9	0,00	
09.2021	RUB	1.878	26	0	0	0	0,00	
09.2021	\$	192.852	CNH 1.239.388	0	(1.975)	(1.975)	(0,01)	
09.2021	\$	253	PLN 970	2	0	2	0,00	
07.2021	AUD	17.280	\$ 13.071	98	0	98	0,00	
07.2021	BRL	9.801	1.831	0	(123)	(123)	0,00	
07.2021	€	2.254.061	2.743.767	70.675	0	70.675	0,38	
07.2021	£	8.792	12.416	270	0	270	0,00	
07.2021	SGD	1.824	1.357	0	0	0	0,00	
07.2021	\$	57	AUD 76	0	0	0	0,00	
07.2021	\$	1.954	BRL 9.801	0	(1)	(1)	0,00	
07.2021	\$	20	€ 17	0	0	0	0,00	
07.2021	\$	10.667	£ 7.711	0	(15)	(15)	0,00	
08.2021	BRL	9.801	\$ 1.948	1	0	1	0,00	
08.2021	\$	13.073	AUD 17.280	0	(98)	(98)	0,00	
07.2021	\$	1.162	£ 831	0	(14)	(14)	0,00	
12.2021	INR	49.680	\$ 662	7	0	7	0,00	
12.2021	SGD	539	407	6	0	6	0,00	
07.2021	RUB	2.142	28	0	(2)	(2)	0,00	
08.2021	\$	2.122	28	0	(1)	(1)	0,00	
08.2021	£	851.810	1.177.232	395	0	395	0,00	
07.2021	\$	5.879	CAD 7.103	0	(143)	(143)	0,00	
07.2021	AUD	83.765	\$ 63.540	654	0	654	0,00	
07.2021	£	849.223	1.203.237	30.078	0	30.078	0,16	
07.2021	RUB	4.079	53	0	(3)	(3)	0,00	
07.2021	\$	24.812	AUD 32.010	0	(781)	(781)	0,00	
08.2021	\$	63.549	83.765	0	(652)	(652)	0,00	
09.2021	RUB	1.856	\$ 25	0	0	0	0,00	
				\$ 166.003	\$ (12.735)	\$ 153.268	0,82	

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Administrative AUD (Hedged) ausschüttend und M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	AUD	38.169	\$ 28.746	\$ 90	\$ 90	0,00	
	07.2021	\$	29.754	AUD 38.509	0	(844)	(844)	0,00
	08.2021	\$	28.480	37.816	0	(84)	(84)	0,00
BPS	07.2021	AUD	11	\$ 8	0	0	0,00	
	07.2021	\$	22.308	AUD 28.706	0	(757)	(757)	0,00
BRC	07.2021	AUD	47	\$ 36	0	0	0,00	
CBK	07.2021	\$	427	AUD 553	0	(13)	(13)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
GLM	07.2021	AUD 752	\$ 580	\$ 16	\$ 0	\$ 16	0,00
HUS	07.2021	1.498	1.161	36	0	36	0,00
MYI	07.2021	16.745	12.666	94	0	94	0,00
	07.2021	\$ 529	AUD 697	0	(5)	(5)	0,00
	08.2021	12.144	16.053	0	(91)	(91)	0,00
RBC	07.2021	AUD 104	\$ 81	3	0	3	0,00
SCX	07.2021	1.281	975	14	0	14	0,00
TOR	07.2021	\$ 7.461	AUD 9.639	0	(225)	(225)	0,00
UAG	07.2021	AUD 25.585	\$ 19.410	202	0	202	0,00
	07.2021	\$ 30.011	AUD 38.717	0	(944)	(944)	(0,01)
	08.2021	19.281	25.415	0	(198)	(198)	0,00
				\$ 455	\$ (3.161)	\$ (2.706)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional CAD (Hedged) thesaurierend und Class W CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	CAD 152.049	\$ 122.826	\$ 37	\$ 0	\$ 37	0,00
	07.2021	\$ 1.686	CAD 2.071	0	(13)	(13)	0,00
	08.2021	122.824	152.049	0	(37)	(37)	0,00
BPS	07.2021	131.106	158.388	0	(3.199)	(3.199)	(0,02)
CBK	07.2021	CAD 157.524	\$ 128.088	878	0	878	0,01
	08.2021	\$ 128.087	CAD 157.524	0	(879)	(879)	0,00
JPM	07.2021	81.405	98.548	0	(1.822)	(1.822)	(0,01)
SCX	07.2021	44.172	53.403	0	(1.045)	(1.045)	(0,01)
SSB	07.2021	CAD 444	\$ 357	0	(1)	(1)	0,00
TOR	07.2021	\$ 128.657	CAD 155.436	0	(3.133)	(3.133)	(0,02)
				\$ 915	\$ (10.129)	\$ (9.214)	(0,05)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	CHF 99	\$ 110	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07.2021	\$ 24.171	CHF 21.693	0	(704)	(704)	(0,01)
BPS	07.2021	16	15	0	0	0	0,00
BRC	07.2021	1.078	968	0	(30)	(30)	0,00
CBK	07.2021	CHF 20.279	\$ 22.028	89	0	89	0,00
	07.2021	\$ 21.926	CHF 19.660	0	(658)	(658)	0,00
	08.2021	22.046	20.279	0	(89)	(89)	0,00
GLM	07.2021	273	245	0	(7)	(7)	0,00
MYI	07.2021	21.237	19.134	0	(537)	(537)	0,00
SCX	07.2021	CHF 127	\$ 139	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 17	CHF 16	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	CHF 1.991	\$ 2.223	68	0	68	0,00
	07.2021	\$ 462	CHF 425	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07.2021	189	171	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 162	\$ (2.031)	\$ (1.869)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) ausschüttend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€ 6.354	\$ 7.654	\$ 119	\$ 0	\$ 119	0,00
	07.2021	\$ 22.688	€ 18.606	0	(623)	(623)	0,00
BPS	07.2021	€ 5.237	\$ 6.327	117	0	117	0,00
		2.272.67					
	07.2021	\$ 3	€ 1.857.821	0	(69.482)	(69.482)	(0,37)
BRC	07.2021	€ 3.877	\$ 4.722	125	0	125	0,00
	07.2021	\$ 123.323	€ 100.806	0	(3.777)	(3.777)	(0,02)
GLM	07.2021	2.409	1.987	0	(52)	(52)	0,00
HUS	07.2021	€ 6.238	\$ 7.486	88	0	88	0,00
	07.2021	\$ 8.048	€ 6.618	0	(200)	(200)	0,00
MYI	07.2021	1.693	1.422	0	(7)	(7)	0,00
RBC		2.517.86					
	07.2021	4	2.058.143	0	(77.112)	(77.112)	(0,41)
SCX	07.2021	€ 1.739	\$ 2.115	53	0	53	0,00
		2.646.40					
	07.2021	\$ 4	€ 2.163.213	0	(81.048)	(81.048)	(0,44)
UAG	07.2021	€ 3.001	\$ 3.651	92	0	92	0,00
				\$ 594	\$ (232.301)	\$ (231.707)	(1,24)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 21.741	\$ 30.735	\$ 701	\$ 0	\$ 701	0,00
	07.2021	\$ 469	£ 336	0	(4)	(4)	0,00
BRC	07.2021	£ 64	\$ 91	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 4.093	£ 2.931	0	(44)	(44)	0,00
GLM	07.2021	1.295.679	916.499	0	(29.582)	(29.582)	(0,16)
HUS	07.2021	£ 963.585	\$ 1.333.688	2.543	0	2.543	0,01
	07.2021	\$ 81	£ 58	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	1.333.177	963.149	0	(2.516)	(2.516)	(0,01)
MYI	07.2021	£ 2.111	\$ 2.953	37	0	37	0,00
	07.2021	\$ 14.087	£ 10.162	0	(49)	(49)	0,00
RYL	07.2021	£ 301	\$ 425	8	0	8	0,00
SCX	07.2021	795	1.123	26	0	26	0,00
	07.2021	\$ 22.313	£ 15.696	0	(630)	(630)	0,00
SSB	07.2021	£ 976.201	\$ 1.349.503	930	0	930	0,01
	07.2021	\$ 1.264.148	£ 892.131	0	(31.714)	(31.714)	(0,17)
	08.2021	1.331.107	963.149	0	(446)	(446)	0,00
UAG	07.2021	1.298.558	916.499	0	(32.460)	(32.460)	(0,18)
				\$ 4.247	\$ (97.447)	\$ (93.200)	(0,50)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklasse Institutional MXN (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	MXN 1.837	\$ 93	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2021	\$ 91	MXN 1.811	0	0	0	0,00
	08.2021	92	1.837	0	0	0	0,00
BPS	07.2021	MXN 1.798	\$ 89	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	\$ 88	MXN 1.798	2	0	2	0,00
SCX	07.2021	89	1.778	0	0	0	0,00
UAG	07.2021	93	1.863	0	0	0	0,00
				\$ 2	\$ (1)	\$ 1	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	\$ 9.375	SEK 77.718	\$ 0	\$ (288)	\$ (288)	0,00
BRC	07.2021	10.935	90.653	0	(335)	(335)	(0,01)
RBC	07.2021	10.935	90.653	0	(335)	(335)	0,00
				\$ 0	\$ (958)	\$ (958)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend, M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 89.674	\$ 66.789	\$ 77	\$ 0	\$ 77	0,00
	08.2021	\$ 66.783	SGD 89.674	0	(77)	(77)	0,00
BPS	07.2021	68.791	91.003	0	(1.090)	(1.090)	(0,01)
GLM	07.2021	SGD 201	\$ 152	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 18.482	SGD 24.830	0	(10)	(10)	0,00
	08.2021	761	1.023	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	68.712	90.911	0	(1.080)	(1.080)	(0,01)
MYI	07.2021	SGD 90.071	\$ 67.010	3	0	3	0,00
	08.2021	\$ 67.005	SGD 90.071	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2021	67.472	89.426	0	(944)	(944)	(0,01)
SSB	07.2021	SGD 52.683	\$ 39.321	141	(13)	128	0,01
	07.2021	\$ 17.452	SGD 23.384	2	(58)	(56)	0,00
				\$ 225	\$ (3.275)	\$ (3.050)	(0,02)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (175.618)	(0,94)
Summe Anlagen						\$ 18.466.718	98,97
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 192.100	1,03
Nettovermögen						\$ 18.658.818	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
 (b) Reines Kapitalwertpapier.
 (c) Wertpapier per Emissionstermin.
 (d) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
 (e) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
 (f) Nullkuponwertpapier.
 (g) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
 (i) Mit dem Fonds verbunden.
 (j) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (k) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc. 2,572 % fällig am 03.06.2031	26.05.2020	\$ 8.000	\$ 8.232	0,04
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	25.05.2021	300	306	0,00
Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032	11.01.2021 - 01.02.2021	16.542	16.810	0,09
General Motors Co. 6,800 % fällig am 01.10.2027	07.05.2020	1.796	2.269	0,01
Noble Corp.	05.02.2021 - 25.02.2021	1.765	3.607	0,02
Occidental Petroleum Corp. 5,500 % fällig am 01.12.2025	08.12.2020 - 12.05.2021	58.744	63.386	0,34
Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 30.12.2021	11.01.2021	46.495	46.533	0,25
		\$ 133.642	\$ 141.143	0,75

(l) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 93.369 und Barmittel in Höhe von USD 890 als Sicherheiten verpfändet.

(m) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 143.073 und Barmittel in Höhe von USD 83.570 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 279 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 405.372 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 5.513	\$ 16.037.824	\$ 0	\$ 16.043.337
Investmentfonds	903.414	958.601	0	1.862.015
Pensionsgeschäfte	0	642.417	0	642.417
Finanzderivate ⁽³⁾	1.390	(82.441)	0	(81.051)
Summen	\$ 910.317	\$ 17.556.401	\$ 0	\$ 18.466.718

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 16.281.328	\$ 2.507	\$ 16.283.835
Investmentfonds	822.567	959.907	0	1.782.474
Pensionsgeschäfte	0	46.261	0	46.261
Finanzderivate ⁽³⁾	(5.300)	290.257	0	284.957
Summen	\$ 817.267	\$ 17.577.753	\$ 2.507	\$ 18.397.527

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	(2,500) %	20.04.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (5.472)	\$ (6.472)	(0,03)
	(1,250)	04.03.2021	TBD ⁽¹⁾	(2.784)	(3.287)	(0,02)
	(1,250)	16.03.2021	TBD ⁽¹⁾	(5.481)	(6.475)	(0,04)
	(1,250)	19.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(2.894)	(3.424)	(0,02)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften		% des Nettovermögens
					\$	(%)	
	(1,250) %	09.06.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (919)	\$ (1.089)	(0,01)	
	(1,000)	14.04.2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (1.230)	(1.228)	(0,01)	
BRC	(4,000)	18.01.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (5.273)	(6.219)	(0,03)	
	(4,000)	15.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(4.213)	(4.994)	(0,03)	
	(1,500)	14.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.917)	(2.266)	(0,01)	
	(1,350)	12.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(2.864)	(3.396)	(0,02)	
	(0,950)	05.02.2021	TBD ⁽¹⁾	(2.220)	(2.622)	(0,01)	
	(0,950)	04.03.2021	TBD ⁽¹⁾	(8.316)	(9.831)	(0,05)	
FBF	(1,350)	23.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.951)	(2.313)	(0,01)	
JML	(2,800)	22.12.2020	23.04.2022	(1.156)	(1.357)	(0,01)	
	(2,600)	02.08.2019	31.07.2021	(10.029)	(11.311)	(0,06)	
	(2,600)	16.08.2019	14.08.2021	(5.046)	(5.697)	(0,03)	
MEI	(1,150)	29.01.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.038)	(1.225)	(0,01)	
NOM	(0,030)	24.06.2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (21.220)	(21.220)	(0,11)	
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (94.426)	(0,51)	

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (2.038)	\$ 2.013	\$ (25)
BPS	(12.388)	11.570	(818)
BRC	(5.587)	4.697	(890)
CBK	(2.095)	1.461	(634)
DUB	(82)	(20)	(102)
FBF	625	(550)	75
GLM	(29.513)	26.162	(3.351)
GST	4.876	(4.880)	(4)
HUS	(3.309)	3.299	(10)
JPM	1.267	(1.230)	37
MYC	702	(620)	82
MYI	71.151	(60.850)	10.301
RBC	(77.444)	68.300	(9.144)
RYL	8	0	8
SCX	(83.573)	73.612	(9.961)
SOG	(3)	0	(3)
SSB	(30.698)	28.079	(2.619)
TOR	(3.501)	3.600	99
UAG	(4.016)	3.750	(266)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	68,46	59,79
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	14,96	24,85
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,56	2,71
Investmentfonds	9,98	9,56
Pensionsgeschäfte	3,44	0,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,34	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,17	0,65
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,94)	0,91
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,51)	(0,37)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Albanien	0,13	0,13
Angola	k. A.	0,09
Argentinien	0,52	0,56
Australien	0,04	0,02
Österreich	0,26	0,26
Weissrussland	0,04	0,08
Belgien	0,13	k. A.
Bermuda	0,48	0,41
Brasilien	0,48	0,62
Kanada	0,33	0,38
Cayman-Inseln	3,60	2,55
Chile	0,23	0,25
China	0,52	0,91
Kolumbien	0,36	0,42
Curacao	0,23	0,21

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Dominikanische Republik	0,54	0,55
Ecuador	0,24	0,19
Ägypten	0,67	0,46
Finnland	k. A.	0,12
Frankreich	2,39	2,71
Deutschland	4,24	3,57
Ghana	0,12	0,12
Guernsey, Kanalinseln	0,47	0,45
Hongkong	0,89	0,58
Indien	0,07	0,07
Indonesien	2,15	2,11
Irland	3,18	1,21
Insel Man	0,24	0,24
Israel	0,06	0,00
Italien	4,34	3,30
Elfenbeinküste	0,28	0,06
Japan	0,70	0,78
Jersey, Kanalinseln	0,86	0,86
Jordanien	0,07	0,07
Kasachstan	0,01	0,20
Kenia	k. A.	0,05
Liberia	0,08	0,08
Luxemburg	3,74	3,78
Mazedonien	0,05	0,06
Malaysia	0,01	0,07
Mauritius	0,05	0,05
Mexiko	2,40	2,33
Marokko	0,04	0,04
Multinational	0,53	0,28
Niederlande	3,99	2,87
Nigeria	0,33	0,23
Norwegen	0,08	0,16
Oman	0,67	0,42
Panama	0,18	0,20
Paraguay	0,09	0,09
Peru	0,25	0,07
Portugal	0,14	0,14
Katar	0,80	0,86
Rumänien	0,18	0,19
Russland	0,54	0,55
Saudi-Arabien	1,20	1,23
Senegal	k. A.	0,05
Serbien	0,07	0,01
Singapur	0,20	0,20
Slowenien	0,05	0,05
Südafrika	0,62	0,59
Spanien	0,96	0,98
Sri Lanka	0,09	0,08
Supranational	0,05	k. A.
Schweden	0,01	0,01
Schweiz	1,12	1,17
Trinidad und Tobago	k. A.	0,02
Tunesien	0,02	0,02
Türkei	1,29	1,21
Ukraine	0,96	0,95
Vereinigte Arabische Emirate	0,46	0,57
Großbritannien	8,48	9,14
USA	19,28	19,31
Uruguay	k. A.	0,00
Venezuela	0,02	0,02
Jungferninseln (Britisch)	0,04	k. A.
Kurzfristige Instrumente	8,04	14,68
Investmentfonds	9,98	9,56
Pensionsgeschäfte	3,44	0,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,34	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,11	0,67
Zinsswaps	0,02	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,08	0,04
Devisenterminkontrakte	0,82	(0,47)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,84)	1,35
Sonstige Aktiva und Passiva	1,03	1,31
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income Duration Hedged Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
ALBANIEN											
STAATSEMISSIONEN											
Albania Government International Bond 3,500 % fällig am 16.06.2027	€ 800	\$ 1.021	0,06	Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd. 0,000 % fällig am 30.07.2021 (e)(g) 0,000 % fällig am 02.08.2021 (e)(g)	\$ 753	\$ 1.579	0,00	New Metro Global Ltd. 4,500 % fällig am 02.05.2026	\$ 1.200	\$ 1.179	0,07
				Petrobras Global Finance BV 5,375 % fällig am 01.10.2029 6,250 % fällig am 14.12.2026 6,625 % fällig am 16.01.2034 6,900 % fällig am 19.03.2049	£ 1.400	2.131	0,13	Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK) 11,000 % fällig am 15.02.2028 (c)	117	130	0,01
					500	794	0,05	Odebrecht Drilling Norge Ltd. 6,350 % fällig am 01.12.2021 ^	97	97	0,01
					1.000	1.596	0,09	Odebrecht Drilling Norge Ltd. (6,350 % bar und 10,000 % PIK) 7,350 % fällig am 01.12.2026 ^ (c)	3.413	1.753	0,11
					\$ 400	477	0,03	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^	73	72	0,00
				Summe Brasilien		8.171	0,49	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. (6,720 % bar und 1,000 % PIK) 7,720 % fällig am 01.12.2026 ^ (c)	796	192	0,01
				KANADA							
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
				Air Canada Pass-Through Trust 5,250 % fällig am 01.10.2030	937	1.019	0,06	Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.03.2023	3.000	3.154	0,19
				Bausch Health Cos., Inc. 4,875 % fällig am 01.06.2028	400	410	0,03	5,250 % fällig am 15.08.2022 5,500 % fällig am 15.02.2024	270	283	0,02
				Bombardier, Inc. 6,000 % fällig am 15.10.2022 6,125 % fällig am 15.01.2023 7,500 % fällig am 01.12.2024	400	401	0,02	5,500 % fällig am 15.02.2024	500	550	0,03
					97	102	0,01	QNB Finance Ltd. 1,256 % fällig am 12.02.2022	6.900	6.930	0,42
					300	314	0,02	S.A. Global Sukuk Ltd. 2,694 % fällig am 17.06.2031	800	811	0,05
				Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 2.400	3.132	0,19	Sands China Ltd. 3,800 % fällig am 08.01.2026	4.300	4.608	0,28
				Fairstone Financial, Inc. 7,875 % fällig am 15.07.2024	\$ 200	209	0,01	4,375 % fällig am 18.06.2030 4,600 % fällig am 08.08.2023 5,400 % fällig am 08.08.2028	300	325	0,02
						5.587	0,34	5,400 % fällig am 08.08.2028	400	465	0,03
				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG							
				Bausch Health Cos., Inc. 3,104 % fällig am 02.06.2025	366	365	0,02	Seagate HDD Cayman 4,125 % fällig am 15.01.2031	200	204	0,01
				Summe Kanada		5.952	0,36	Seazen Group Ltd. 4,450 % fällig am 13.07.2025 6,000 % fällig am 12.08.2024	1.000	993	0,06
				CAYMAN INSELN							
				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE							
				Madison Park Funding Ltd. 1,518 % fällig am 20.04.2026	157	157	0,01	Sitka Holdings LLC 4,643 % fällig am 06.07.2026 (b)	800	800	0,05
				Vibrant CLO Ltd. 1,228 % fällig am 15.09.2030	300	300	0,02	Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 26.04.2024	900	888	0,05
						457	0,03	6,500 % fällig am 09.07.2023 6,650 % fällig am 03.08.2024 7,000 % fällig am 09.07.2025 7,250 % fällig am 14.06.2022 7,500 % fällig am 01.02.2024 7,950 % fällig am 11.10.2023 8,350 % fällig am 19.04.2023	700	713	0,04
								800	804	0,05	
								1.000	984	0,06	
								3.500	3.583	0,22	
								900	920	0,06	
								300	310	0,02	
								200	207	0,01	
				STAMMAKTIEN							
				Noble Corp. (d)	3.661	91	0,01	Trafford Centre Finance Ltd. 0,811 % fällig am 28.07.2038	£ 300	360	0,02
				Noble Corp. (d)(j)	30.521	755	0,04	Transocean Guardian Ltd. 5,875 % fällig am 15.01.2024	\$ 290	283	0,02
						846	0,05	Transocean Poseidon Ltd. 6,875 % fällig am 01.02.2027	200	201	0,01
								Wynn Macau Ltd. 5,125 % fällig am 15.12.2029	1.200	1.239	0,07
								5,500 % fällig am 15.01.2026	900	945	0,06
								5,500 % fällig am 01.10.2027	900	939	0,06
								5,625 % fällig am 26.08.2028	400	418	0,03
								Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % fällig am 13.01.2026	300	305	0,02
									57.128	3,44	
								Summe Cayman Inseln	58.431	3,52	
				PARI (000S)							
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
				21Vianet Group, Inc. 7,875 % fällig am 15.10.2021	\$ 500	501	0,03	CHILE			
				Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025 3,250 % fällig am 15.02.2027 4,250 % fällig am 15.04.2026 5,125 % fällig am 01.10.2023 5,500 % fällig am 15.01.2023 5,500 % fällig am 15.01.2026	500	515	0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
					400	413	0,02	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A. 3,650 % fällig am 07.05.2030	300	325	0,02
					100	108	0,01	4,700 % fällig am 07.05.2050	800	905	0,05
					600	649	0,04	GNL Quintero S.A. 4,634 % fällig am 31.07.2029	600	655	0,04
					900	956	0,06			1.885	0,11
					600	681	0,04				
				Baidu, Inc. 3,875 % fällig am 29.09.2023	200	213	0,01	STAATSEMISSIONEN			
				Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,125 % fällig am 22.10.2025 3,300 % fällig am 12.01.2031 4,750 % fällig am 17.01.2023 6,500 % fällig am 08.04.2024	4.500	4.528	0,27	Chile Government International Bond 2,450 % fällig am 31.01.2031	2.100	2.142	0,13
					1.300	1.227	0,07	Summe Chile		4.027	0,24
					200	205	0,01				
					1.300	1.381	0,08				
				Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % fällig am 30.06.2024 9,750 % fällig am 28.09.2023 10,500 % fällig am 15.01.2025 10,875 % fällig am 23.07.2023 11,250 % fällig am 16.04.2025 11,700 % fällig am 11.11.2025	1.100	1.041	0,06				
					3.000	2.966	0,18				
					1.200	1.132	0,07				
					400	401	0,02				
					1.500	1.421	0,09				
					400	378	0,02				
				Lima Metro Line Finance Ltd. 5,875 % fällig am 05.07.2034	667	780	0,05				
				Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025 5,375 % fällig am 04.12.2029	700	717	0,04				
					700	741	0,04				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
CHINA				CHINA				CHINA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Bank of China Ltd. 0,884 % fällig am 24.06.2023	\$ 2.400	\$ 2.415	0,15	Loxam S.A.S. 2,875 % fällig am 15.04.2026	€ 200	\$ 238	0,01	8,750 % fällig am 11.03.2061	\$ 300	\$ 289	0,02
1,250 % fällig am 24.06.2025	4.000	3.994	0,24	3,250 % fällig am 14.01.2025	800	958	0,06	8,950 % fällig am 26.03.2051	200	198	0,01
CNPC Global Capital Ltd. 1,125 % fällig am 23.06.2023	3.000	3.008	0,18	3,750 % fällig am 15.07.2026	200	243	0,01	Summe Ghana		2.250	0,14
New Metro Global Ltd. 4,800 % fällig am 15.12.2024	1.300	1.311	0,08	Mercialys S.A. 4,625 % fällig am 07.07.2027	600	846	0,05	GUERNSEY, KANALINSELN			
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 2,150 % fällig am 13.05.2025	2.900	2.975	0,18	Renault S.A. 1,250 % fällig am 24.06.2025	1.100	1.288	0,08	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 15.04.2024	2.600	2.512	0,15	2,375 % fällig am 25.05.2026	6.500	7.833	0,47	Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust 5,250 % fällig am 30.05.2025	49	50	0,00
Summe China		16.215	0,98	Societe Generale S.A. 4,000 % fällig am 12.01.2027	\$ 300	332	0,02	Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust 5,125 % fällig am 30.11.2024	597	600	0,04
KOLUMBIEN				KOLUMBIEN				KOLUMBIEN			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN			
Colombia Government International Bond 5,000 % fällig am 15.06.2045	5.500	5.863	0,35	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,875 % fällig am 20.06.2022	€ 800	974	0,06
CURACAO				CURACAO				CURACAO			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 3,500 % fällig am 10.11.2021	6.800	6.830	0,41	Altice France S.A. 3,000 % fällig am 02.02.2026	€ 2.966	3.468	0,21	3,000 % fällig am 29.03.2025	4.600	5.870	0,35
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				DOMINIKANISCHE REPUBLIK				DOMINIKANISCHE REPUBLIK			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN			
Dominican Republic Government International Bond 4,875 % fällig am 23.09.2032	2.300	2.375	0,14	3,871 % fällig am 31.01.2026	\$ 193	192	0,01	Summe Guernsey, Kanalinseln		7.494	0,45
5,300 % fällig am 21.01.2041	600	600	0,04	Casino Guichard Perrachon S.A. 4,000 % fällig am 31.08.2025	€ 3.700	4.409	0,26	HONGKONG			
6,500 % fällig am 15.02.2048	3.500	3.827	0,23	Numericable Group S.A. 2,936 % fällig am 31.07.2025	\$ 1.447	1.427	0,09	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
6,850 % fällig am 27.01.2045	1.600	1.814	0,11	Summe Frankreich		41.272	2,48	Far East Horizon Ltd. 3,375 % fällig am 18.02.2025	\$ 400	405	0,02
6,875 % fällig am 29.01.2026	500	581	0,03	DEUTSCHLAND				Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026 (b)	€ 3.600	4.261	0,26
Summe Dominikanische Republik		9.197	0,55	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,050 % fällig am 27.01.2027	\$ 1.600	1.621	0,10
ECUADOR				ECUADOR				ECUADOR			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN			
Ecuador Government International Bond 0,000 % fällig am 31.07.2030				Deutsche Bank AG 0,750 % fällig am 17.02.2027	€ 400	478	0,03	5,950 % fällig am 19.10.2025	1.600	1.682	0,10
(e)	1.816	1.010	0,06	1,369 % fällig am 27.02.2023	\$ 400	404	0,02	Huarong Finance Co. Ltd. 1,275 % fällig am 24.02.2023	1.200	898	0,05
0,500 % fällig am 31.07.2035	2.675	1.842	0,11	1,375 % fällig am 03.09.2026	€ 900	1.107	0,07	2,125 % fällig am 30.09.2023	4.800	3.661	0,22
0,500 % fällig am 31.07.2040	1.226	763	0,05	1,375 % fällig am 17.02.2032	2.900	3.493	0,21	2,500 % fällig am 24.02.2023	700	541	0,03
Summe Ecuador		3.615	0,22	1,625 % fällig am 20.01.2027	4.500	5.615	0,34	Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030	600	628	0,04
ÄGYPTEN				ÄGYPTEN				ÄGYPTEN			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN			
Egypt Government International Bond 4,750 % fällig am 11.04.2025	€ 900	1.116	0,07	1,750 % fällig am 17.01.2028	300	377	0,02	Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026	1.400	1.431	0,09
5,625 % fällig am 16.04.2030	100	119	0,01	1,750 % fällig am 19.11.2030	3.400	4.265	0,26	Summe Hongkong		15.128	0,91
6,375 % fällig am 11.04.2031	3.800	4.710	0,28	2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 900	1.299	0,08	INDIEN			
7,500 % fällig am 16.02.2061	\$ 4.000	3.762	0,22	3,547 % fällig am 18.09.2031	\$ 3.600	3.836	0,23	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
8,500 % fällig am 31.01.2047	900	941	0,06	3,729 % fällig am 14.01.2032 (j)	1.500	1.528	0,09	Adani Electricity Mumbai Ltd. 3,949 % fällig am 12.02.2030	400	400	0,02
Summe Ägypten		10.648	0,64	3,875 % fällig am 12.02.2024	€ 1.900	2.811	0,17	STAATSEMISSIONEN			
FRANKREICH				FRANKREICH				FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Altice France S.A. 4,000 % fällig am 15.07.2029	€ 1.800	2.126	0,13	3,961 % fällig am 26.11.2025	€ 1.700	1.839	0,11	Export-Import Bank of India 3,375 % fällig am 05.08.2026	1.200	1.281	0,08
7,375 % fällig am 01.05.2026	\$ 2.814	2.930	0,18	4,500 % fällig am 01.04.2025 (i)	800	864	0,05	Summe Indien		1.681	0,10
BNP Paribas S.A. 1,904 % fällig am 30.09.2028	1.100	1.094	0,06	5,625 % fällig am 19.05.2031	€ 1.600	2.249	0,13	INDONESIEN			
2,219 % fällig am 09.06.2026	600	619	0,04	5,882 % fällig am 08.07.2031 (i)	\$ 4.200	4.918	0,30	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
2,819 % fällig am 19.11.2025	500	526	0,03	Frappot AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	€ 1.700	2.087	0,12	Pelabuhan Indonesia Persero PT 4,875 % fällig am 01.10.2024	700	774	0,05
3,500 % fällig am 16.11.2027	600	655	0,04	1,875 % fällig am 31.03.2028	1.800	2.239	0,13	Pertamina Persero PT 4,875 % fällig am 03.05.2022	400	415	0,02
4,705 % fällig am 10.01.2025	5.600	6.114	0,37	IHO Verwaltungen GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK) 3,625 % fällig am 15.05.2025 (c)	1.000	1.206	0,07	6,500 % fällig am 07.11.2048	3.700	4.916	0,30
5,198 % fällig am 10.01.2030	700	844	0,05	IHO Verwaltungen GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)	3.450	4.180	0,25	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 3,000 % fällig am 30.06.2030	2.000	2.009	0,12
BPCE S.A. 1,000 % fällig am 01.04.2025	€ 200	245	0,01	INEOS Styrolution Group GmbH 2,250 % fällig am 16.01.2027	3.300	3.872	0,23	Summe Indonesien		8.114	0,49
2,375 % fällig am 14.01.2025	\$ 300	313	0,02	MTU Aero Engines AG 3,000 % fällig am 01.07.2025	200	259	0,01	STAATSEMISSIONEN			
3,500 % fällig am 23.10.2027	400	435	0,03	Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	900	1.103	0,07	Indonesia Government International Bond 0,900 % fällig am 14.02.2027	€ 3.000	3.604	0,22
Credit Agricole S.A. 1,907 % fällig am 16.06.2026	1.600	1.632	0,10	Volkswagen Bank GmbH 1,250 % fällig am 10.06.2024	2.700	3.321	0,20	1,100 % fällig am 12.03.2033	2.300	2.673	0,16
Electricite de France S.A. 4,500 % fällig am 21.09.2028	1.200	1.399	0,08	1,875 % fällig am 31.01.2024	100	124	0,01	1,400 % fällig am 30.10.2031	1.500	1.816	0,11
La Mondiale SAM 5,050 % fällig am 17.12.2025 (g)	€ 800	1.106	0,07	2,500 % fällig am 31.07.2026	600	792	0,05	1,450 % fällig am 18.09.2026	1.600	1.979	0,12
				Volkswagen Financial Services AG 0,875 % fällig am 12.04.2023	100	121	0,01	2,150 % fällig am 18.07.2024	600	755	0,05
				Volkswagen Leasing GmbH 0,000 % fällig am 12.07.2023 (e)	500	594	0,04	3,375 % fällig am 30.07.2025	800	1.064	0,06
				1,125 % fällig am 04.04.2024	100	122	0,01	3,750 % fällig am 14.06.2028	800	1.130	0,07
				2,625 % fällig am 15.01.2024	100	127	0,01	4,625 % fällig am 15.04.2043	\$ 3.500	4.061	0,24
				ZF Finance GmbH 2,750 % fällig am 25.05.2027	1.500	1.852	0,11	5,125 % fällig am 15.01.2045	2.400	2.977	0,18
				3,750 % fällig am 21.09.2028	6.100	7.937	0,48	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,300 % fällig am 23.06.2025	3.100	3.223	0,19
				Summe Deutschland		65.019	3,91	2,800 % fällig am 23.06.2030	400	410	0,02
				GHANA				3,800 % fällig am 23.06.2050	200	210	0,01
				STAATSEMISSIONEN				4,150 % fällig am 29.03.2027	1.600	1.797	0,11
				Ghana Government International Bond 7,875 % fällig am 26.03.2027	\$ 800	848	0,05	4,450 % fällig am 20.02.2029	500	576	0,04
				8,125 % fällig am 26.03.2032	900	915	0,06	Summe Indonesien		34.389	2,07

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
STAATSEMISSIONEN				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				RUMANIEN			
Mexico				Sigma Bidco BV				STAATSEMISSIONEN			
Mexico Government International Bond				3,500 % fällig am 02.07.2025	€ 2.500	\$ 2.893	0,18	Romania Government International Bond			
2,125 % fällig am 25.10.2051	€ 800	\$ 803	0,05					2,000 % fällig am 14.04.2033	€ 900	\$ 1.061	0,06
3,771 % fällig am 24.05.2061	\$ 500	466	0,03					4,125 % fällig am 11.03.2039	1.600	2.255	0,14
5,750 % fällig am 12.10.2110	1.100	1.319	0,08								
		2.588	0,16					Summe Rumänien		3.316	0,20
Summe Mexiko		38.764	2,34			6.783	0,41				
						58.683	3,53	RUSSLAND			
MAROKKO				Summe Niederlande				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
STAATSEMISSIONEN				NIGERIA				ALROSA Finance S.A.			
Morocco				STAATSEMISSIONEN				3,100 % fällig am 25.06.2027			
Morocco Government International Bond				Nigeria Government International Bond				2,200		2.262	0,14
4,000 % fällig am 15.12.2050	700	651	0,04	7,143 % fällig am 23.02.2030	700	741	0,04	4,650 % fällig am 09.04.2024	700	758	0,04
				7,625 % fällig am 28.11.2047	1.700	1.705	0,10	MMK International Capital DAC			
				7,875 % fällig am 16.02.2032	2.400	2.592	0,16	4,375 % fällig am 13.06.2024	1.500	1.611	0,10
				Summe Nigeria		5.038	0,30			4.631	0,28
MULTINATIONAL				NORWEGEN				STAATSEMISSIONEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Russia			
Allied Universal Holdco LLC				Aker BP ASA				2,875 % fällig am 04.12.2025	€ 3.300	4.283	0,26
3,625 % fällig am 01.06.2028	€ 1.900	2.239	0,13	3,750 % fällig am 15.01.2030	500	540	0,03	4,750 % fällig am 27.05.2026	\$ 1.200	1.365	0,08
American Airlines, Inc.										5.648	0,34
5,500 % fällig am 20.04.2026	\$ 400	424	0,03	OMAN				Summe Russland		10.279	0,62
Ardagh Packaging Finance PLC				STAATSEMISSIONEN				SAUDI-ARABIEN			
4,125 % fällig am 15.08.2026	1.700	1.757	0,11	Oman Government International Bond				STAATSEMISSIONEN			
Connect Finco SARL				6,250 % fällig am 25.01.2031	3.000	3.230	0,20	Saudi Government International Bond			
6,750 % fällig am 01.10.2026	2.600	2.753	0,16	6,500 % fällig am 08.03.2047	2.200	2.160	0,13	2,900 % fällig am 22.10.2025			
Delta Air Lines, Inc.				6,750 % fällig am 17.01.2048	5.700	5.689	0,34	4,000 % fällig am 17.04.2025			
4,500 % fällig am 20.10.2025	400	430	0,03	Summe Oman		11.079	0,67	4,500 % fällig am 26.10.2046			
Summe multinational		7.603	0,46					4,625 % fällig am 04.10.2047			
				PANAMA				Summe Saudi-Arabien			
NIEDERLANDE				STAATSEMISSIONEN				SERBIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Panama Government International Bond				STAATSEMISSIONEN			
Athora Netherlands NV				6,700 % fällig am 26.01.2036	1.400	1.905	0,11	Serbia Government International Bond			
7,000 % fällig am 19.06.2025 (g)(i)	€ 400	546	0,03	8,125 % fällig am 28.04.2034	100	144	0,01	1,650 % fällig am 03.03.2033			
Atrium Finance Issuer BV				Summe Panama		2.049	0,12	3,125 % fällig am 15.05.2027			
2,625 % fällig am 05.09.2027	1.300	1.668	0,10					Summe Serbien			
Citycon Treasury BV				PARAGUAY				SINGAPUR			
1,625 % fällig am 12.03.2028	400	476	0,03	STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Conti-Gummi Finance BV				Paraguay Government International Bond				Flex Ltd.			
1,125 % fällig am 25.09.2024	500	613	0,04	5,600 % fällig am 13.03.2048	1.100	1.297	0,08	3,750 % fällig am 01.02.2026			
2,125 % fällig am 27.11.2023	1.100	1.371	0,08	6,100 % fällig am 11.08.2044	300	374	0,02	Summe Singapur			
Imperial Brands Finance Netherlands BV				Summe Paraguay		1.671	0,10	SLOWENIEN			
1,750 % fällig am 18.03.2033	2.600	3.114	0,19	PERU				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ING Groep NV				STAATSEMISSIONEN				Nova Ljubljanska Banka d.d.			
5,750 % fällig am 16.11.2026 (g)(i)	\$ 500	554	0,03	Peru Government International Bond				3,400 % fällig am 05.02.2030			
6,500 % fällig am 16.04.2025 (g)(i)	1.700	1.899	0,11	3,300 % fällig am 11.03.2041	3.400	3.443	0,21	Summe Slowenien			
6,750 % fällig am 16.04.2024 (g)(i)	1.500	1.657	0,10	PORTUGAL				SÜDAFRIKA			
MDGH - GMTN BV				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
3,950 % fällig am 21.05.2050	800	917	0,06	Galp Energia SGPS S.A.				AngloGold Ashanti Holdings PLC			
NN Group NV				2,000 % fällig am 15.01.2026				3,750 % fällig am 01.10.2030			
4,500 % fällig am 15.01.2026 (g)	€ 1.500	2.038	0,12	Summe Portugal		2.625	0,16	5,872 % fällig am 02.05.2023			
NXP BV				KATAR				SASOL Financing USA LLC			
5,350 % fällig am 01.03.2026	\$ 1.150	1.343	0,08	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,875 % fällig am 27.03.2024			
Q-Park Holding BV				Nakilat, Inc.				Summe Südafrika			
3,500 % fällig am 01.02.2025	€ 3.100	3.735	0,22	6,067 % fällig am 31.12.2033				Summe Südafrika			
Syngenta Finance NV				Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.				Summe Spanien			
3,375 % fällig am 16.04.2026	2.000	2.645	0,16	5,838 % fällig am 30.09.2027				Abertis Infraestructuras S.A.			
4,441 % fällig am 24.04.2023	\$ 2.000	2.112	0,13	Summe Katar		14.238	0,86	1,625 % fällig am 15.07.2029			
4,892 % fällig am 24.04.2025	2.100	2.329	0,14					1,875 % fällig am 26.03.2032			
5,182 % fällig am 24.04.2028	2.000	2.287	0,14					Summe Spanien			
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				STAATSEMISSIONEN				Summe Spanien			
1,125 % fällig am 15.10.2024	€ 4.300	4.791	0,29	Qatar Government International Bond				Summe Spanien			
1,250 % fällig am 31.03.2023	730	848	0,05	4,400 % fällig am 16.04.2050	5.800	7.073	0,43	Summe Spanien			
2,200 % fällig am 21.07.2021	\$ 1.600	1.600	0,10	4,817 % fällig am 14.03.2049	1.300	1.677	0,10	Summe Spanien			
4,500 % fällig am 01.03.2025	€ 400	491	0,03	5,103 % fällig am 23.04.2048	400	532	0,03	Summe Spanien			
UPC Broadband Finco BV								Summe Spanien			
4,875 % fällig am 15.07.2031	\$ 6.100	6.122	0,37					Summe Spanien			
Volkswagen Financial Services NV								Summe Spanien			
1,125 % fällig am 18.09.2023	£ 2.800	3.901	0,23					Summe Spanien			
Volkswagen International Finance NV								Summe Spanien			
3,500 % fällig am 17.06.2025 (g)	€ 1.100	1.411	0,08					Summe Spanien			
3,875 % fällig am 17.06.2029 (g)	1.600	2.111	0,13					Summe Spanien			
ZF Europe Finance BV								Summe Spanien			
2,000 % fällig am 23.02.2026	1.100	1.321	0,08					Summe Spanien			
		51.900	3,12					Summe Spanien			

Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
2,250 % fällig am 29.03.2029 €	1.100	\$ 1.432	0,09	UKRAINE				Marks & Spencer PLC			
3,000 % fällig am 27.03.2031	500	694	0,04	STAATSEMISSIONEN				3,750 % fällig am 19.05.2026 £	100	\$ 144	0,01
3,375 % fällig am 27.11.2026 £	2.800	4.197	0,25	Ukraine Government International Bond	5.000	\$ 5.553	0,33	4,500 % fällig am 10.07.2027	1.500	2.222	0,13
ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.				6,750 % fällig am 20.06.2026	200	259	0,02	6,000 % fällig am 12.06.2025	100	156	0,01
1,375 % fällig am 17.06.2025 €	900	1.083	0,06	6,876 % fällig am 21.05.2029 \$	700	728	0,04	Mitchells & Butlers Finance PLC			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				7,375 % fällig am 25.09.2032	600	633	0,04	0,531 % fällig am 15.12.2030	254	330	0,02
5,875 % fällig am 24.09.2023 (g/i)	200	257	0,02	7,750 % fällig am 01.09.2021	2.300	2.323	0,14	0,569 % fällig am 15.12.2030 \$	1.018	968	0,06
6,000 % fällig am 29.03.2024 (g/i)	200	260	0,02	8,994 % fällig am 01.02.2024	300	333	0,02	6,469 % fällig am 15.09.2032 £	332	525	0,03
6,000 % fällig am 15.01.2026 (g/i)	1.000	1.357	0,08	Summe Ukraine		12.671	0,76	Nationwide Building Society			
Banco de Sabadell S.A.								4,363 % fällig am 01.08.2024 \$	5.000	5.367	0,32
1,125 % fällig am 27.03.2025	400	484	0,03	VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				Natwest Group PLC			
1,125 % fällig am 11.03.2027	300	366	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,750 % fällig am 02.03.2026 €	1.200	1.501	0,09
1,750 % fällig am 29.06.2023	700	846	0,05	DAB Sukuk Difs Ltd.				2,000 % fällig am 04.03.2025	100	125	0,01
1,750 % fällig am 10.05.2024	100	123	0,01	3,750 % fällig am 15.02.2026	1.100	1.167	0,07	2,500 % fällig am 22.03.2023	3.600	4.462	0,27
Banco Santander S.A.								4,800 % fällig am 05.04.2026 \$	1.700	1.947	0,12
3,490 % fällig am 28.05.2030	200	216	0,01	STAATSEMISSIONEN				4,892 % fällig am 18.05.2029	1.700	1.993	0,12
4,375 % fällig am 14.01.2026 (g/i)	€ 400	491	0,03	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond				6,000 % fällig am 29.12.2025 (g/i)	2.300	2.569	0,15
6,250 % fällig am 11.09.2021 (g/i)	1.800	2.158	0,13	2,700 % fällig am 02.09.2070	5.000	4.545	0,28	8,625 % fällig am 15.08.2021 (g/i)	700	707	0,04
CaixaBank S.A.				3,875 % fällig am 16.04.2050	1.600	1.848	0,11	Pearson Funding PLC			
5,875 % fällig am 09.10.2027 (g/i)	600	816	0,05					3,750 % fällig am 04.06.2030 £	100	154	0,01
Summe Spanien		16.167	0,97	Summe Vereinigte Arabische Emirate		7.560	0,46	Rolls-Royce PLC			
SRI LANKA				GROSSBRITANNIEN				0,875 % fällig am 09.05.2024 €	1.200	1.404	0,08
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,625 % fällig am 16.02.2026	300	389	0,02
Sri Lanka Government International Bond				Barclays Bank PLC				5,750 % fällig am 15.10.2027 £	200	220	0,01
7,550 % fällig am 28.03.2030 \$	1.600	1.013	0,06	7,625 % fällig am 21.11.2022 (i)	1.025	1.118	0,07	5,750 % fällig am 15.10.2027 £	200	303	0,02
7,850 % fällig am 14.03.2029	600	384	0,02	Barclays PLC				Santander UK Group Holdings PLC			
Summe Sri Lanka		1.397	0,08	3,375 % fällig am 02.04.2025 €	700	905	0,05	0,312 % fällig am 27.03.2024 €	200	240	0,01
SUPRANATIONAL				6,125 % fällig am 15.12.2025 (g/i)	€ 1.500	1.664	0,10	2,896 % fällig am 15.03.2032 \$	600	619	0,04
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,250 % fällig am 15.03.2023 (g/i)	€ 300	448	0,03	3,625 % fällig am 22.03.2023	300	456	0,03
Banque Ouest Africaine de Developpement				7,750 % fällig am 15.09.2023 (g/i)	€ 800	881	0,05	3,823 % fällig am 03.11.2028 \$	2.100	2.311	0,14
2,750 % fällig am 22.01.2033 €	600	748	0,05	7,875 % fällig am 15.03.2022 (g/i)	200	209	0,01	6,750 % fällig am 24.06.2024 (g/i)	€ 2.100	3.244	0,19
SCHWEDEN				7,875 % fällig am 15.09.2022 (g/i)	€ 2.000	2.968	0,18	Swiss Re Finance UK PLC			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Bellis Acquisition Co. PLC				2,714 % fällig am 04.06.2052 €	200	261	0,02
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB				3,250 % fällig am 16.02.2026	5.100	7.067	0,43	Tesco Property Finance PLC			
1,750 % fällig am 14.01.2025	300	373	0,02	British Telecommunications PLC				5,411 % fällig am 13.07.2044 £	2.432	4.408	0,27
SCHWEIZ				9,625 % fällig am 15.12.2030 \$	600	930	0,06	5,744 % fällig am 13.04.2040	95	176	0,01
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FCE Bank PLC				TP ICAP Ltd.			
Credit Suisse AG				0,869 % fällig am 13.09.2021 €	500	594	0,04	5,250 % fällig am 26.01.2024	1.300	1.973	0,12
6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)	\$ 7.600	8.414	0,51	1,134 % fällig am 10.02.2022	3.000	3.579	0,22	Travis Perkins PLC			
Credit Suisse Group AG				Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				3,750 % fällig am 17.02.2026	300	441	0,03
3,750 % fällig am 26.03.2025	300	326	0,02	2,950 % fällig am 27.01.2029 \$	3.200	3.143	0,19	4,500 % fällig am 07.09.2023	900	1.330	0,08
7,125 % fällig am 29.07.2022 (g/i)	900	940	0,06	3,000 % fällig am 29.06.2027	7.800	7.935	0,48	Unique Pub Finance Co. PLC			
7,500 % fällig am 17.07.2023 (g/i)	200	218	0,01	3,250 % fällig am 25.02.2030	200	200	0,01	5,659 % fällig am 30.06.2027	1.182	1.841	0,11
7,500 % fällig am 11.12.2023 (g/i)	700	778	0,05	Greene King Finance PLC				Virgin Media Secured Finance PLC			
UBS AG				5,106 % fällig am 15.03.2034 £	300	480	0,03	4,125 % fällig am 15.08.2030	1.900	2.607	0,16
5,125 % fällig am 15.05.2024 (i)	200	221	0,01	HSBC Holdings PLC				4,250 % fällig am 15.01.2030	3.200	4.416	0,27
7,625 % fällig am 17.08.2022 (i)	2.650	2.851	0,17	2,099 % fällig am 18.04.2026 \$	400	406	0,02	5,000 % fällig am 15.04.2027	700	1.007	0,06
UBS Group AG				2,804 % fällig am 24.05.2032	500	513	0,03	Virgin Money UK PLC			
4,125 % fällig am 15.04.2026	1.100	1.234	0,07	2,848 % fällig am 04.06.2031	400	416	0,02	2,875 % fällig am 24.06.2025 €	2.600	3.314	0,20
5,125 % fällig am 29.07.2026 (g/i)	500	545	0,03	3,900 % fällig am 25.05.2026	3.400	3.784	0,23	3,375 % fällig am 24.04.2028 £	100	147	0,01
Summe Schweiz		15.527	0,93	3,973 % fällig am 22.05.2030	800	896	0,05	4,000 % fällig am 25.09.2026	400	605	0,04
TUNESIEN				4,000 % fällig am 09.03.2026 (g/i)	200	204	0,01	4,000 % fällig am 03.09.2027	700	1.073	0,06
STAATSEMISSIONEN				4,041 % fällig am 13.03.2028	500	555	0,03	Vmed O2 UK Financing PLC			
Banque Centrale de Tunisie Government International Bond				4,300 % fällig am 08.03.2026	3.900	4.402	0,26	3,250 % fällig am 31.01.2031 €	600	715	0,04
5,625 % fällig am 17.02.2024 €	400	444	0,03	Informa PLC				4,000 % fällig am 31.01.2029 £	2.600	3.559	0,21
TÜRKEI				InterContinental Hotels Group PLC				4,500 % fällig am 15.04.2027	2.800	3.888	0,23
STAATSEMISSIONEN				1,625 % fällig am 08.10.2024	600	742	0,04	4,750 % fällig am 15.07.2031 (b)	\$ 2.700	2.747	0,17
Turkey Government International Bond				Jaguar Land Rover Automotive PLC				Vodafone Group PLC			
4,750 % fällig am 26.01.2026 \$	2.700	2.661	0,16	3,875 % fällig am 01.03.2023 £	100	141	0,01	7,000 % fällig am 04.04.2079	2.300	2.789	0,17
4,875 % fällig am 09.10.2026	3.600	3.532	0,21	5,875 % fällig am 15.11.2024 €	3.200	4.180	0,25			129.722	7,81
4,875 % fällig am 16.04.2043	2.800	2.237	0,14	John Lewis PLC				NON-AGENCY-MBS			
5,125 % fällig am 17.02.2028	3.500	3.408	0,21	4,250 % fällig am 18.12.2034 £	800	1.161	0,07	Towd Point Mortgage Funding PLC			
5,600 % fällig am 14.11.2024	2.800	2.884	0,17	6,125 % fällig am 21.01.2025	800	1.251	0,08	1,111 % fällig am 20.10.2051 £	3.037	4.219	0,25
5,750 % fällig am 11.05.2047	6.600	5.656	0,34	Legal & General Group PLC				Summe Großbritannien		133.941	8,06
6,125 % fällig am 24.10.2028	200	204	0,01	5,625 % fällig am 24.03.2031 (g/i)	200	310	0,02	USA			
6,750 % fällig am 30.05.2040	300	295	0,02	Lloyds Banking Group PLC				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
6,875 % fällig am 17.03.2036	400	405	0,02	1,875 % fällig am 15.01.2026	800	1.133	0,07	Ames Mortgage Investment Trust			
Summe Türkei		21.282	1,28	2,250 % fällig am 16.10.2024	500	720	0,04	0,872 % fällig am 25.10.2035 \$	200	200	0,01
				2,438 % fällig am 05.02.2026 \$	600	626	0,04	1,292 % fällig am 25.06.2035	375	376	0,02
				3,500 % fällig am 01.04.2026 €	200	267	0,02	Accredited Mortgage Loan Trust			
				4,450 % fällig am 08.05.2025 \$	4.100	4.603	0,28	0,572 % fällig am 25.09.2035	400	398	0,02
								ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
								0,692 % fällig am 25.02.2036	233	233	0,01

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Ameritrust Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				MASTR Asset-Backed Securities Trust				American Airlines Pass-Through Trust			
0,797 % fällig am 25.11.2035	137	137	0,01	0,292 % fällig am 25.08.2036	4.012	1.636	0,10	3,000 % fällig am 15.04.2030	80	81	0,00
3,467 % fällig am 25.11.2032 ^	630	641	0,04	0,392 % fällig am 25.03.2036	1.315	1.230	0,07	3,150 % fällig am 15.08.2033	95	98	0,01
Argent Securities Trust				0,782 % fällig am 25.03.2035	818	819	0,05	3,200 % fällig am 15.12.2029	787	805	0,05
0,412 % fällig am 25.05.2036	614	226	0,01	0,842 % fällig am 25.12.2034 ^	15	15	0,00	3,350 % fällig am 15.04.2031	251	256	0,01
Asset-Backed Funding Certificates Trust				0,992 % fällig am 25.04.2034	130	129	0,01	3,375 % fällig am 01.11.2028	491	489	0,03
0,312 % fällig am 25.10.2036	7.629	7.026	0,42	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				3,575 % fällig am 15.07.2029	393	401	0,02
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				0,232 % fällig am 25.05.2037	253	215	0,01	3,650 % fällig am 15.02.2029	242	249	0,01
0,392 % fällig am 25.06.2036	36	36	0,00	0,252 % fällig am 25.09.2036	267	153	0,01	3,650 % fällig am 15.12.2029	472	458	0,03
0,432 % fällig am 25.05.2036 ^	44	44	0,00	0,672 % fällig am 25.01.2035	560	556	0,03	3,700 % fällig am 01.04.2028	65	66	0,00
0,722 % fällig am 25.12.2035	198	198	0,01	0,797 % fällig am 25.01.2035	290	281	0,02	AT&T, Inc.			
1,097 % fällig am 25.06.2035	704	700	0,04	1,992 % fällig am 25.02.2047	163	154	0,01	2,600 % fällig am 19.05.2038	€ 300	409	0,02
1,892 % fällig am 25.07.2034	53	54	0,00	Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust				3,100 % fällig am 01.02.2043	€ 200	196	0,01
Carrington Mortgage Loan Trust				1,667 % fällig am 25.11.2032	63	64	0,00	3,150 % fällig am 04.09.2036	€ 200	289	0,02
0,152 % fällig am 25.01.2037	8	8	0,00	New Century Home Equity Loan Trust				3,500 % fällig am 15.09.2053	€ 1.389	1.398	0,08
0,352 % fällig am 25.02.2037	957	925	0,06	3,092 % fällig am 25.01.2033 ^	242	226	0,01	3,650 % fällig am 15.09.2059	5.184	5.265	0,32
1,142 % fällig am 25.05.2035	300	298	0,02	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				3,800 % fällig am 01.12.2057	271	283	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				0,827 % fällig am 25.05.2035	364	364	0,02	Aviation Capital Group LLC			
1,022 % fällig am 25.05.2035	193	193	0,01	NovaStar Mortgage Funding Trust				5,500 % fällig am 15.12.2024	1.100	1.244	0,07
Countrywide Asset-Backed Certificates				0,252 % fällig am 25.09.2037	643	636	0,04	BAT Capital Corp.			
0,242 % fällig am 25.05.2037	32	32	0,00	Option One Mortgage Loan Trust				3,557 % fällig am 15.08.2027	200	214	0,01
0,272 % fällig am 25.11.2047 ^	784	745	0,05	0,312 % fällig am 25.01.2037	307	217	0,01	Berry Global, Inc.			
0,542 % fällig am 25.03.2036	100	99	0,01	0,827 % fällig am 25.08.2035	461	462	0,03	1,570 % fällig am 15.01.2026	100	100	0,01
0,572 % fällig am 25.02.2037 ^	1.600	1.461	0,09	Park Place Securities, Inc.				Blue Racer Midstream LLC			
0,617 % fällig am 25.08.2036	2.100	2.048	0,12	0,797 % fällig am 25.09.2035	958	962	0,06	6,625 % fällig am 15.07.2026	100	105	0,01
0,642 % fällig am 25.02.2047 ^	1.069	942	0,06	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Boardwalk Pipelines LP			
0,672 % fällig am 25.07.2036	13	13	0,00	0,812 % fällig am 25.08.2035	250	251	0,02	3,400 % fällig am 15.02.2031	300	319	0,02
0,752 % fällig am 25.04.2036	711	712	0,04	1,142 % fällig am 25.09.2034	26	26	0,00	British Airways Pass-Through Trust			
0,827 % fällig am 25.02.2036	86	86	0,01	1,892 % fällig am 25.12.2034	473	478	0,03	4,250 % fällig am 15.05.2034	119	128	0,01
1,142 % fällig am 25.11.2034	150	151	0,01	RAAC Trust				Broadcom, Inc.			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				1,292 % fällig am 25.09.2047	58	58	0,00	2,450 % fällig am 15.02.2031	800	787	0,05
0,252 % fällig am 25.03.2037	8	8	0,00	Residential Asset Mortgage Products Trust				5,000 % fällig am 15.04.2030	300	354	0,02
0,552 % fällig am 25.05.2036	90	90	0,01	1,022 % fällig am 25.05.2035	55	55	0,00	Buckeye Partners LP			
0,932 % fällig am 25.10.2047	2.834	2.809	0,17	Residential Asset Securities Corp. Trust				4,125 % fällig am 01.03.2025	900	936	0,06
1,082 % fällig am 25.02.2036 ^	6.000	5.447	0,33	0,242 % fällig am 25.01.2037	34	34	0,00	Caesars Resort Collection LLC			
1,667 % fällig am 25.11.2034	200	198	0,01	0,782 % fällig am 25.11.2035	265	265	0,02	5,750 % fällig am 01.07.2025	500	527	0,03
Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				0,797 % fällig am 25.09.2035	888	876	0,05	Cantor Fitzgerald LP			
0,652 % fällig am 25.04.2034	176	164	0,01	0,977 % fällig am 25.01.2034	81	81	0,01	4,875 % fällig am 01.05.2024	100	110	0,01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				Saxon Asset Securities Trust				6,500 % fällig am 17.06.2022	300	316	0,02
0,712 % fällig am 25.01.2032	6	6	0,00	0,557 % fällig am 25.03.2036	497	495	0,03	CCO Holdings LLC			
Credit Suisse Mortgage Capital Asset-Backed Trust				Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				4,250 % fällig am 01.02.2031	2.500	2.550	0,15
0,692 % fällig am 25.09.2037	94	94	0,01	0,272 % fällig am 25.07.2036	96	45	0,00	4,500 % fällig am 01.06.2033	600	615	0,04
Ellington Loan Acquisition Trust				0,767 % fällig am 25.01.2035	24	23	0,00	Centene Corp.			
1,142 % fällig am 25.05.2037	466	468	0,03	Soundview Home Loan Trust				4,250 % fällig am 15.12.2027	200	211	0,01
First Franklin Mortgage Loan Trust				0,402 % fällig am 25.06.2036 ^	11.990	11.531	0,69	4,625 % fällig am 15.12.2029	600	661	0,04
0,000 % fällig am 25.04.2036 (a)(e)	954	944	0,06	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				Charter Communications Operating LLC			
1,367 % fällig am 25.07.2034	253	254	0,02	0,917 % fällig am 25.05.2035	75	74	0,01	4,200 % fällig am 15.03.2028	900	1.020	0,06
Fremont Home Loan Trust				Structured Asset Investment Loan Trust				4,800 % fällig am 01.03.2050	1.000	1.151	0,07
0,632 % fällig am 25.04.2036	300	277	0,02	0,472 % fällig am 25.03.2036	270	261	0,02	5,125 % fällig am 01.07.2049	1.200	1.432	0,09
1,022 % fällig am 25.06.2035 ^	700	687	0,04	0,722 % fällig am 25.11.2035	487	481	0,03	5,375 % fällig am 01.04.2038	100	123	0,01
GSAA Home Equity Trust				1,067 % fällig am 25.10.2033	111	111	0,01	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC			
0,212 % fällig am 25.11.2036	85	32	0,00	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				5,125 % fällig am 30.06.2027	1.300	1.513	0,09
GSAMP Trust				1,092 % fällig am 25.08.2037	314	317	0,02	Cheniere Energy Partners LP			
0,142 % fällig am 25.12.2046	29	18	0,00	Structured Asset Securities Corp. Trust				4,000 % fällig am 01.03.2031	1.800	1.883	0,11
0,182 % fällig am 25.01.2037	49	36	0,00	0,782 % fällig am 25.09.2035	342	336	0,02	Chubb INA Holdings, Inc.			
0,332 % fällig am 25.08.2036	736	667	0,04	Truman Capital Mortgage Loan Trust				0,875 % fällig am 15.06.2027	€ 100	123	0,01
0,412 % fällig am 25.05.2046	13	13	0,00	0,352 % fällig am 25.03.2036	1.071	1.065	0,06	CIT Group, Inc.			
0,572 % fällig am 25.06.2036	234	168	0,01	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				5,000 % fällig am 15.08.2022	\$ 132	138	0,01
0,827 % fällig am 25.09.2035 ^	129	129	0,01	0,242 % fällig am 25.01.2037	229	213	0,01	5,000 % fällig am 01.08.2023	230	249	0,01
Home Equity Asset Trust				AKTIEN				Citigroup, Inc.			
1,187 % fällig am 25.05.2035	136	136	0,01	STAMMAKTIVEN				1,250 % fällig am 06.07.2026	€ 100	124	0,01
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				ENERGIE				2,572 % fällig am			
0,472 % fällig am 25.06.2036	68	67	0,00	Valaris Ltd. (d)	7.498	217	0,01	03.06.2031 (j)	\$ 800	823	0,05
IXIS Real Estate Capital Trust				PARI (000S)				Constellation Brands, Inc.			
0,722 % fällig am 25.02.2036	37	37	0,00	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,700 % fällig am 06.12.2026	200	223	0,01
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				AbbVie, Inc.				Continental Airlines Pass-Through Trust			
0,282 % fällig am 25.03.2047	353	352	0,02	1,500 % fällig am 15.11.2023	€ 100	123	0,01	4,150 % fällig am 11.10.2025	364	387	0,02
0,352 % fällig am 25.07.2036	273	270	0,02	Alaska Airlines Pass-Through Trust				Continental Resources, Inc.			
0,352 % fällig am 25.06.2037	320	318	0,02	4,800 % fällig am 15.02.2029	\$ 288	320	0,02	4,375 % fällig am 15.01.2028	600	665	0,04
0,392 % fällig am 25.07.2036	750	440	0,03	Ally Financial, Inc.				Coty, Inc.			
Long Beach Mortgage Loan Trust				8,000 % fällig am 01.11.2031	1.207	1.736	0,10	3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 2.200	2.625	0,16
0,632 % fällig am 25.05.2046	594	274	0,02					CyrusOne LP			
0,692 % fällig am 25.02.2036	1.026	944	0,06					1,450 % fällig am 22.01.2027	100	121	0,01
0,852 % fällig am 25.08.2045	215	215	0,01					DAE Funding LLC			
								1,550 % fällig am 01.08.2024	\$ 2.300	2.300	0,14
								1,625 % fällig am 15.02.2024	1.100	1.118	0,07
								2,625 % fällig am 20.03.2025	700	714	0,04

Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
3,375 % fällig am 20.03.2028	\$ 800	\$ 820	0,05	General Motors Financial Co., Inc.				Nielsen Finance LLC			
5,000 % fällig am 01.08.2024	1.100	1.132	0,07	5,100 % fällig am 17.01.2024	\$ 400	\$ 441	0,03	4,500 % fällig am 15.07.2029	\$ 500	\$ 502	0,03
DaVita, Inc.				Global Atlanta Fin Co.				4,750 % fällig am 15.07.2031	700	703	0,04
4,625 % fällig am 01.06.2030	2.600	2.677	0,16	4,400 % fällig am 15.10.2029	1.300	1.438	0,09	Nissan Motor Acceptance Corp.			
Dell International LLC				GLP Capital LP				2,000 % fällig am 09.03.2026	100	101	0,01
4,900 % fällig am 01.10.2026	100	116	0,01	3,350 % fällig am 01.09.2024	100	106	0,01	2,600 % fällig am 28.09.2022	100	102	0,01
5,300 % fällig am 01.10.2029	200	242	0,01	5,750 % fällig am 01.06.2028	600	715	0,04	NuStar Logistics LP			
5,450 % fällig am 15.06.2023	1.800	1.953	0,12	Goldman Sachs Group, Inc.				5,625 % fällig am 28.04.2027	1.800	1.934	0,12
6,020 % fällig am 15.06.2026	1.100	1.321	0,08	2,082 % fällig am 26.09.2023	€ 1.300	1.546	0,09	6,000 % fällig am 01.06.2026	400	435	0,03
6,100 % fällig am 15.07.2027	1.485	1.821	0,11	2,125 % fällig am 30.09.2024	400	506	0,03	Occidental Petroleum Corp.			
8,100 % fällig am 15.07.2036	400	611	0,04	3,375 % fällig am 27.03.2025	100	133	0,01	3,200 % fällig am 15.08.2026	500	505	0,03
Delta Air Lines, Inc.				Gray Oak Pipeline LLC				3,400 % fällig am 15.04.2026	900	923	0,06
7,000 % fällig am 01.05.2025	2.100	2.452	0,15	3,450 % fällig am 15.10.2027	\$ 700	737	0,04	3,500 % fällig am 15.08.2029	2.340	2.351	0,14
Digital Euro Finco LLC				Greif, Inc.				5,500 % fällig am 01.12.2025 (j)	5.700	6.316	0,38
2,500 % fällig am 16.01.2026	€ 500	652	0,04	6,500 % fällig am 01.03.2027	500	529	0,03	5,875 % fällig am 01.09.2025	1.000	1.114	0,07
Doctors Co. An Interinsurance Exchange				Hawaiian Airlines Pass-Through Certificates				OneMain Finance Corp.			
6,500 % fällig am 15.10.2023	\$ 1.800	1.934	0,12	7,375 % fällig am 15.09.2027	1.225	1.398	0,08	3,500 % fällig am 15.01.2027	1.600	1.614	0,10
EI Paso Natural Gas Co. LLC				HCA, Inc.				4,000 % fällig am 15.09.2030	1.900	1.886	0,11
8,375 % fällig am 15.06.2032	100	147	0,01	4,750 % fällig am 01.05.2023	3.150	3.377	0,20	6,125 % fällig am 15.03.2024	2.200	2.370	0,14
Enable Midstream Partners LP				Hyatt Hotels Corp.				6,875 % fällig am 01.12.2025	1.300	1.469	0,09
4,150 % fällig am 15.09.2029	600	657	0,04	3,135 % fällig am 01.09.2022	1.000	1.004	0,06	7,125 % fällig am 15.03.2026	1.300	1.516	0,09
4,950 % fällig am 15.05.2028	1.700	1.948	0,12	Indigo Natural Resources LLC				ONEOK, Inc.			
Energy Transfer LP				5,375 % fällig am 01.02.2029	100	105	0,01	5,850 % fällig am 15.01.2026	200	237	0,01
3,600 % fällig am 01.02.2023	400	415	0,02	Ingram Micro, Inc.				Oracle Corp.			
5,000 % fällig am 15.05.2050	700	811	0,05	5,000 % fällig am 10.08.2022	500	514	0,03	3,600 % fällig am 01.04.2050	1.300	1.337	0,08
5,350 % fällig am 15.05.2045	100	116	0,01	International Lease Finance Corp.				Organon Finance LLC			
6,625 % fällig am 15.10.2036	100	133	0,01	5,875 % fällig am 15.08.2022	4.300	4.552	0,27	2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 600	723	0,04
7,500 % fällig am 01.07.2038	1.700	2.401	0,14	8,625 % fällig am 15.01.2022	450	469	0,03	4,125 % fällig am 30.04.2028	\$ 1.800	1.838	0,11
Energy Transfer Partners LP				IPALCO Enterprises, Inc.				Oxford Finance LLC			
4,500 % fällig am 01.11.2033	1.200	1.288	0,08	4,250 % fällig am 01.05.2030	200	225	0,01	6,375 % fällig am 15.12.2022	300	303	0,02
5,000 % fällig am 01.10.2022	4.900	5.109	0,31	Jefferies Finance LLC				Pacific Gas & Electric Co.			
EPR Properties				6,250 % fällig am 03.06.2026	1.600	1.680	0,10	1,367 % fällig am 10.03.2023	1.700	1.700	0,10
3,750 % fällig am 15.08.2029	100	100	0,01	JetBlue Pass-Through Trust				2,500 % fällig am 01.02.2031	100	94	0,01
EQM Midstream Partners LP				4,000 % fällig am 15.05.2034	1.161	1.284	0,08	3,150 % fällig am 01.01.2026	600	619	0,04
4,000 % fällig am 01.08.2024	300	309	0,02	Kinder Morgan Energy Partners LP				3,300 % fällig am 15.03.2027 ^	200	207	0,01
EQT Corp.				6,500 % fällig am 01.02.2037	600	825	0,05	3,300 % fällig am 01.12.2027 ^	100	103	0,01
7,625 % fällig am 01.02.2025	6.200	7.240	0,44	6,950 % fällig am 01.01.2038	600	860	0,05	3,300 % fällig am 01.08.2040	2.400	2.173	0,13
8,500 % fällig am 01.02.2030	100	130	0,01	Kinder Morgan, Inc.				3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	200	210	0,01
Fidelity National Financial, Inc.				5,300 % fällig am 01.12.2034	300	371	0,02	3,450 % fällig am 01.07.2025	300	315	0,02
3,400 % fällig am 15.06.2030	300	324	0,02	7,750 % fällig am 15.01.2032	1.800	2.585	0,16	3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	200	210	0,01
FirstEnergy Corp.				7,800 % fällig am 01.08.2031	800	1.146	0,07	3,750 % fällig am 15.02.2024 ^	100	105	0,01
7,375 % fällig am 15.11.2031	900	1.234	0,07	Las Vegas Sands Corp.				3,750 % fällig am 01.07.2028	300	315	0,02
Ford Motor Credit Co. LLC				3,200 % fällig am 08.08.2024	900	945	0,06	3,950 % fällig am 01.12.2047	100	93	0,01
0,000 % fällig am 07.12.2022	€ 200	236	0,01	3,500 % fällig am 18.08.2026	900	958	0,06	4,200 % fällig am 01.06.2041	100	99	0,01
0,157 % fällig am 01.12.2024	1.800	2.081	0,12	3,900 % fällig am 08.08.2029	400	426	0,03	4,250 % fällig am 01.08.2023	200	212	0,01
1,068 % fällig am 12.10.2021	\$ 600	599	0,04	Lumen Technologies, Inc.				4,250 % fällig am 15.03.2046 ^	100	96	0,01
1,391 % fällig am 15.02.2023	700	698	0,04	4,000 % fällig am 15.02.2027	100	102	0,01	4,450 % fällig am 15.04.2042 ^	200	199	0,01
1,744 % fällig am 19.07.2024	€ 300	362	0,02	Marriott International, Inc.				4,500 % fällig am 01.07.2040	1.050	1.052	0,06
2,330 % fällig am 25.11.2025	2.900	3.561	0,21	4,625 % fällig am 15.06.2030	100	115	0,01	4,550 % fällig am 01.07.2030	600	642	0,04
2,386 % fällig am 17.02.2026	500	617	0,04	Marriott Ownership Resorts, Inc.				4,600 % fällig am 15.06.2043 ^	300	299	0,02
2,748 % fällig am 14.06.2024	€ 400	561	0,03	6,500 % fällig am 15.09.2026	250	260	0,02	4,650 % fällig am 01.08.2028	200	220	0,01
3,021 % fällig am 06.03.2024	€ 1.300	1.619	0,10	Mattel, Inc.				Patterson-UTI Energy, Inc.			
3,096 % fällig am 04.05.2023	\$ 500	511	0,03	3,375 % fällig am 01.04.2026	200	208	0,01	5,150 % fällig am 15.11.2029	1.500	1.571	0,09
3,250 % fällig am 15.09.2025	€ 200	255	0,01	MGM Resorts International				Piper Sandler Cos.			
3,340 % fällig am 07.01.2022	\$ 200	202	0,01	7,750 % fällig am 15.03.2022	400	419	0,02	4,740 % fällig am 15.10.2021	200	201	0,01
3,350 % fällig am 01.11.2022	2.300	2.360	0,14	Midwest Connector Capital Co. LLC				5,200 % fällig am 15.10.2023	600	601	0,04
3,375 % fällig am 13.11.2025	300	311	0,02	3,625 % fällig am 01.04.2022	300	305	0,02	Plains All American Pipeline LP			
3,625 % fällig am 17.06.2031	1.300	1.327	0,08	3,900 % fällig am 01.04.2024	200	209	0,01	4,300 % fällig am 31.01.2043	300	304	0,02
4,063 % fällig am 01.11.2024	2.600	2.769	0,17	Mileage Plus Holdings LLC				4,500 % fällig am 15.12.2026	300	337	0,02
5,584 % fällig am 18.03.2024	600	658	0,04	6,500 % fällig am 20.06.2027	200	220	0,01	4,900 % fällig am 15.02.2045	2.100	2.287	0,14
5,596 % fällig am 07.01.2022	1.800	1.839	0,11	MPLX LP				5,150 % fällig am 01.06.2042	1.800	2.022	0,12
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				4,250 % fällig am 01.12.2027	100	113	0,01	6,650 % fällig am 15.01.2037	800	1.051	0,06
5,500 % fällig am 01.05.2028	600	625	0,04	MPT Operating Partnership LP				Puget Energy, Inc.			
6,500 % fällig am 01.10.2025	2.140	2.226	0,13	3,692 % fällig am 05.06.2028	€ 300	442	0,03	4,100 % fällig am 15.06.2030	400	448	0,03
Freedom Mortgage Corp.				4,000 % fällig am 19.08.2022	€ 400	491	0,03	QVC, Inc.			
6,625 % fällig am 15.01.2027 (b)	1.100	1.109	0,07	National Fuel Gas Co.				4,375 % fällig am 15.03.2023	550	581	0,03
7,625 % fällig am 01.05.2026	2.400	2.501	0,15	5,200 % fällig am 15.07.2025	\$ 600	677	0,04	Rio Oil Finance Trust			
8,125 % fällig am 15.11.2024	1.450	1.504	0,09	Navient Corp.				9,250 % fällig am 06.07.2024	3.325	3.691	0,22
8,250 % fällig am 15.04.2025	3.300	3.455	0,21	5,500 % fällig am 25.01.2023	200	211	0,01	9,750 % fällig am 06.01.2027	146	173	0,01
GE Capital Funding LLC				6,500 % fällig am 15.06.2022	100	104	0,01	RLJ Lodging Trust LP			
4,550 % fällig am 15.05.2032	1.100	1.316	0,08	7,250 % fällig am 25.01.2022	700	727	0,04	3,750 % fällig am 01.07.2026	200	202	0,01
General Electric Co.				Newell Brands, Inc.				Rockies Express Pipeline LLC			
0,875 % fällig am 17.05.2025	€ 200	244	0,01	4,875 % fällig am 01.06.2025	200	222	0,01	3,600 % fällig am 15.05.2025	100	102	0,01
4,125 % fällig am 19.09.2035	500	804	0,05	NGPL PipeCo LLC				4,800 % fällig am 15.05.2030	1.000	1.002	0,06
5,625 % fällig am 16.09.2031	€ 1.400	2.536	0,15	7,768 % fällig am 15.12.2037	2.340	3.353	0,20	4,950 % fällig am 15.07.2029	500	516	0,03
6,875 % fällig am 10.01.2039	\$ 14	21	0,00					Sabine Pass Liquefaction LLC			
General Motors Co.								4,500 % fällig am 15.05.2030	300	347	0,02
6,800 % fällig am 01.10.2027 (j)	200	252	0,01					5,000 % fällig am 15.03.2027	200	231	0,01

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
5,625 % fällig am 15.04.2023	\$ 600	\$ 645	0,04	Charter Communications Operating LLC	\$ 6.309	\$ 6.267	0,38	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates	\$ 207	\$ 208	0,01
5,625 % fällig am 01.03.2025	5.400	6.176	0,37	1,860 % fällig am 01.02.2027				2,561 % fällig am 26.04.2038			
5,750 % fällig am 15.05.2024	2.700	3.031	0,18	CommScope, Inc.	491	490	0,03	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust	13	14	0,00
5,875 % fällig am 30.06.2026	1.200	1.421	0,09	3,346 % fällig am 06.04.2026				2,890 % fällig am 25.09.2035			
Santander Holdings USA, Inc.				Coty, Inc.	173	204	0,01	HarborView Mortgage Loan Trust			
3,450 % fällig am 02.06.2025	600	645	0,04	1,750 % fällig am 05.04.2023	€ 173	204	0,01	0,533 % fällig am 19.05.2035	205	198	0,01
Sensata Technologies, Inc.				Dell International LLC				0,573 % fällig am 19.06.2035	5	5	0,00
4,375 % fällig am 15.02.2030	100	106	0,01	2,000 % fällig am 19.09.2025	\$ 3.785	3.789	0,23	0,633 % fällig am 20.10.2045	529	513	0,03
Service Properties Trust				Envision Healthcare Corp.	779	669	0,04	0,713 % fällig am 19.11.2035	9	8	0,00
4,350 % fällig am 01.10.2024	300	302	0,02	3,854 % fällig am 10.10.2025				HSI Asset Securitization Corp. Trust	1.786	1.689	0,10
4,750 % fällig am 01.10.2026	500	495	0,03	Hilton Worldwide Finance LLC	5.185	5.148	0,31	0,532 % fällig am 25.11.2035			
Southwest Airlines Co.				1,842 % fällig am 22.06.2026				Impac Secured Assets Trust	53	52	0,00
5,125 % fällig am 15.06.2027	1.300	1.530	0,09	INEOS Finance PLC	9.820	11.596	0,70	0,252 % fällig am 25.03.2037 ^			
5,250 % fällig am 04.05.2025	1.300	1.484	0,09	2,500 % fällig am 01.04.2024	€ 9.820	11.596	0,70	IndyMac Mortgage Loan Trust			
Sprint Corp.				Jefferies Finance LLC				0,272 % fällig am 25.07.2047	70	56	0,00
7,250 % fällig am 15.09.2021	100	102	0,01	3,125 % fällig am 03.06.2026	\$ 196	195	0,01	2,644 % fällig am 25.06.2037 ^	14	14	0,00
7,875 % fällig am 15.09.2023	100	114	0,01	Level 3 Financing, Inc.	4.163	4.109	0,25	3,002 % fällig am 25.12.2036 ^	3	3	0,00
Sprint Spectrum Co. LLC				1,854 % fällig am 01.03.2027				Lehman Mortgage Trust	116	117	0,01
5,152 % fällig am 20.09.2029	800	922	0,06	MPH Acquisition Holdings LLC	864	862	0,05	6,000 % fällig am 25.09.2037 ^			
Standard Industries, Inc.				3,750 % fällig am 07.06.2023				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 2.600	3.075	0,18	Nielsen Finance LLC	1.520	1.520	0,09	0,752 % fällig am 25.11.2029	1	1	0,00
4,750 % fällig am 15.01.2028	\$ 250	262	0,02	2,081 % fällig am 04.10.2023				2,842 % fällig am 25.05.2036	5	5	0,00
Summer BC Bidco LLC								Morgan Stanley Mortgage Loan Trust	48	40	0,00
5,500 % fällig am 31.10.2026 (b)	400	407	0,02			41.412	2,49	3,020 % fällig am 25.03.2036 ^			
Synchrony Financial								Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust	1	1	0,00
5,150 % fällig am 19.03.2029	200	237	0,01	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				3,134 % fällig am 25.08.2035			
Synovus Bank				American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010	600	1.129	0,07	Residential Accredit Loans, Inc. Trust	85	83	0,01
2,289 % fällig am 10.02.2023	250	252	0,01	8,084 % fällig am 15.02.2050				0,492 % fällig am 25.05.2047			
Tallgrass Energy Partners LP				Illinois State General Obligation Bonds, (BABS), Series 2010	400	500	0,03	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust	314	303	0,02
5,500 % fällig am 15.01.2028	700	713	0,04	6,630 % fällig am 01.02.2035	220	277	0,01	0,312 % fällig am 25.06.2037			
6,000 % fällig am 31.12.2030	700	730	0,04	6,725 % fällig am 01.04.2035	350	452	0,03	Structured Asset Mortgage Investments Trust	749	820	0,05
Targa Resources Partners LP				7,350 % fällig am 01.07.2035				0,302 % fällig am 25.09.2047 ^	552	539	0,03
5,500 % fällig am 01.03.2030	900	991	0,06	Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABS), Series 2010	970	1.496	0,09	0,492 % fällig am 25.05.2036			
Time Warner Cable LLC				6,655 % fällig am 01.04.2057				SunTrust Alternative Loan Trust	4	3	0,00
5,875 % fällig am 15.11.2040	800	1.038	0,06	Texas Public Finance Authority Revenue Notes, Series 2014	165	167	0,01	0,742 % fällig am 25.12.2035 ^			
6,750 % fällig am 15.06.2039	100	140	0,01	8,250 % fällig am 01.07.2024				Thornburg Mortgage Securities Trust	18	17	0,00
Toll Brothers Finance Corp.				Tobacco Settlement Financing Corp., Virginia Revenue Bonds, Series 2007	95	100	0,01	1,342 % fällig am 25.06.2037 ^			
4,875 % fällig am 15.03.2027	1.000	1.138	0,07	6,706 % fällig am 01.06.2046				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	10	10	0,00
U.S. Airways Pass-Through Trust								1,316 % fällig am 25.11.2042			
3,950 % fällig am 15.05.2027	218	220	0,01			4.121	0,25	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust	138	58	0,00
United Airlines Pass-Through Trust								4,146 % fällig am 25.09.2036 ^			
2,900 % fällig am 01.11.2029	96	95	0,01	NON-AGENCY-MBS						8.965	0,54
3,450 % fällig am 01.06.2029	152	161	0,01	Banc of America Alternative Loan Trust	117	90	0,01	Summe USA		359.868	21,66
3,450 % fällig am 07.01.2030	163	166	0,01	0,492 % fällig am 25.01.2037 ^				VENEZUELA			
3,500 % fällig am 01.09.2031	177	185	0,01	Banc of America Funding Trust	69	66	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,875 % fällig am 15.04.2029	4.282	4.761	0,29	3,348 % fällig am 20.01.2047 ^				Petroleos de Venezuela S.A.	1.600	72	0,00
United Airlines, Inc.				BCAP LLC Trust	78	78	0,01	6,000 % fällig am 16.05.2024 ^			
4,375 % fällig am 15.04.2026	200	207	0,01	0,967 % fällig am 26.11.2046	2.097	1.218	0,07	STAATSEMISSIONEN			
4,625 % fällig am 15.04.2029	600	622	0,04	6,250 % fällig am 26.08.2036				Venezuela Government International Bond	241	24	0,00
VEREIT Operating Partnership LP				Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust	11	11	0,00	6,000 % fällig am 09.12.2020 ^			
VICI Properties LP				2,370 % fällig am 25.02.2036				7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	1.528	164	0,01
VMware, Inc.				Bear Stearns ALT-A Trust	7	7	0,00	7,750 % fällig am 13.10.2019 ^	1.900	204	0,01
4,500 % fällig am 15.05.2025	700	782	0,05	0,532 % fällig am 25.04.2035				Summe Venezuela		392	0,02
4,650 % fällig am 15.05.2027	1.300	1.494	0,09	Citigroup Mortgage Loan Trust	35	35	0,00	JUNGFERNINSELN (BRITISCH)			
4,700 % fällig am 15.05.2030	100	118	0,01	2,530 % fällig am 25.10.2035	91	92	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Wells Fargo & Co.				2,625 % fällig am 25.10.2046 ^				Champion Path Holdings Ltd.	500	521	0,03
1,338 % fällig am 04.05.2025	€ 200	246	0,01	Countrywide Alternative Loan Trust	4	2	0,00	4,500 % fällig am 27.01.2026			
1,741 % fällig am 04.05.2030	300	384	0,02	0,492 % fällig am 25.07.2036 ^	368	319	0,02	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
Western Midstream Operating LP				0,513 % fällig am 20.05.2046 ^	634	218	0,01	COMMERCIAL PAPER			
4,350 % fällig am 01.02.2025	\$ 1.500	1.587	0,09	0,592 % fällig am 25.04.2036	14	15	0,00	Sunac China Holdings Ltd.	3.700	3.703	0,22
6,500 % fällig am 01.02.2050	3.000	3.482	0,21	1,596 % fällig am 25.01.2036	153	116	0,01	5,950 % fällig am 30.12.2021 (j)			
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.				6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	970	636	0,04	(3,480) % fällig am			
3,200 % fällig am 15.06.2025	100	106	0,01	6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	239	189	0,01	13.09.2021 (e)(f)	ARS 8.752	52	0,00
Wynn Resorts Finance LLC				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust	1.873	701	0,04	ARGENTINA TREASURY BILLS			
5,125 % fällig am 01.10.2029	1.300	1.375	0,08	0,632 % fällig am 25.04.2046	19	8	0,00				
		246.414	14,83	1,076 % fällig am 25.04.2046	14	13	0,00				
				2,949 % fällig am 25.03.2037 ^	408	264	0,02				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	73	43	0,00				
Adient U.S. LLC				6,000 % fällig am 25.07.2037	136	87	0,01				
3,604 % fällig am 08.04.2028	400	401	0,02	6,500 % fällig am 25.11.2036 ^							
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.	0	0	0,00				
3,250 % fällig am 01.12.2027	2.189	2.192	0,13	6,500 % fällig am 25.04.2033							
CenturyLink, Inc.											
2,354 % fällig am 15.03.2027	4.017	3.970	0,24								

Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
U.S. TREASURY BILLS							
0,003 % fällig am 13.07.2021 (e)(f)(l)	\$ 3.300	\$ 3.300	0,20	INVESTMENTFONDS			
0,005 % fällig am 08.07.2021 (e)(f)	10.900	10.900	0,66	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
0,011 % fällig am 26.08.2021 (e)(f)(l)	5.000	5.000	0,30	PIMCO Funds: Global Investors			
0,012 % fällig am 21.09.2021 (e)(f)	8.700	8.699	0,52	Series plc – Asia Strategic Interest Bond Fund (h)			
0,018 % fällig am 22.07.2021 (e)(f)(l)	3.700	3.700	0,22	250.000	\$ 2.542	0,15	
0,027 % fällig am 03.08.2021 (b)(e)(f)(l)	5.300	5.300	0,32	PIMCO Funds: Global Investors			
0,027 % fällig am 28.10.2021 (e)(f)	12.200	12.198	0,73	Series plc – PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)			
0,033 % fällig am 07.10.2021 (e)(f)	11.500	11.497	0,69	651.264	7.718	0,46	
0,033 % fällig am 02.12.2021 (e)(f)(l)	6.400	6.399	0,39	PIMCO Funds: Global Investors			
0,038 % fällig am 24.08.2021 (e)(f)	3.100	3.100	0,19	Series plc – PIMCO European High Yield Bond Fund (h)			
0,039 % fällig am 09.09.2021 (e)(f)(l)	3.200	3.200	0,19	538.168	6.899	0,41	
0,047 % fällig am 19.10.2021 (e)(f)	6.500	6.499	0,39	PIMCO Funds: Global Investors			
0,048 % fällig am 23.09.2021 (e)(f)	4.400	4.399	0,27	Series plc - US Short-Term Fund (h)			
0,061 % fällig am 02.09.2021 (e)(f)	62.300	62.295	3,75	1.864.745	18.575	1,12	
		146.486	8,82		87.178	5,24	
Summe kurzfristige Instrumente		150.241	9,04	5.043.495	51.444	3,10	
				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)			
Summe Übertragbare Wertpapiere	\$1.452.289	87,40		1.864.745	18.575	1,12	
					87.178	5,24	
				BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
				PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)			
				771.770	78.372	4,72	
				Summe Investmentfonds	\$165.550	9,96	

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2021	660	\$ (102)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	13	17	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	1.184	21	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	88	3	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	127	12	0,00
				\$ (49)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (49)	0,00

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 2.900	\$ 52	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	1.500	4	0,00
Atlantia SpA	1,000	20.06.2025	€ 700	56	0,00
Atlantia SpA	1,000	20.12.2025	1.700	75	0,00
Auchan Holding S.A.	1,000	20.12.2027	700	17	0,00
Casino Guichard Perrachon S.A.	1,000	20.12.2021	1.600	106	0,01
Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.06.2022	1.200	155	0,01
Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.12.2022	1.100	136	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	\$ 2.800	198	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	800	25	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	900	29	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	4.000	26	0,00
Glencore Finance (Europe) Ltd.	5,000	20.12.2025	€ 3.300	(50)	0,00
Glencore Finance (Europe) Ltd.	5,000	20.12.2027	2.200	(50)	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	4.100	130	0,01
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2025	800	29	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.06.2027	100	1	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	6.800	(257)	(0,01)
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2026	4.600	29	0,00
				\$ 711	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 50.600	\$ 63	0,00
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	53.400	494	0,03
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	1.700	5	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	14.800	40	0,00
iTraxx Crossover 35 5-Year Index	5,000	20.06.2026	€ 86.700	1.141	0,07
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	78.700	89	0,01
				\$ 1.832	0,11

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,250 %	15.09.2023	£ 17.600	\$ 21	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	21.500	36	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	10.900	(60)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	1.000	(6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,250	16.06.2023	\$ 40.800	9	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	23.300	50	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	12.600	(274)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025	9.500	170	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	108.900	5.050	0,31
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025	95.400	1.249	0,08
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050	31.120	2.812	0,17
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	36.500	(2.079)	(0,12)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2024	43.100	(1.250)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	17.06.2050	14.800	2.700	0,16
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.12.2026	98.400	(1.961)	(0,12)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2024	33.600	(938)	(0,06)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	19.12.2023	31.600	(2.187)	(0,13)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 17.600	45	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	32.500	53	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	13.100	127	0,01
					\$ 3.567	0,22
					\$ 6.110	0,37

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000 %	20.10.2021	500	\$ (2)	\$ (1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	1.900	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.700	(3)	0	0,00
BPS	Put – OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	600	(4)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	2.700	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.500	(2)	(1)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	3.600	(4)	(3)	0,00
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	1.400	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.400	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	3.000	(3)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.800	(3)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	12.100	(17)	(3)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	5.900	(7)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	2.700	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	2.700	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	3.200	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	3.700	(4)	(3)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	10.800	(12)	(7)	0,00
CBK	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	800	(4)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.800	(2)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	1.900	(2)	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
DUB	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	15.09.2021	6.100	\$ (6)	\$ (2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	2.800	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	2.800	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	3.000	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	3.700	(4)	(4)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	15.09.2021	500	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	20.10.2021	900	(5)	(4)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	1.800	(2)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.900	(2)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	1.800	(2)	(1)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	4.000	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.000	(2)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.900	(2)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	2.000	(2)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	4.000	(4)	(3)	0,00
JPM	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	4.000	(4)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.600	(3)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.700	(3)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	2.800	(4)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	2.300	(3)	(2)	0,00
MYC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	3.500	(4)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	600	(1)	0	0,00
						\$ (157)	\$ (51)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Hochtief AG	5,000 %	20.12.2025	€ 500	\$ 118	\$ (10)	\$ 108	0,01
BRC	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	1.000	235	(18)	217	0,01
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2031	\$ 8.300	(355)	91	(264)	(0,02)
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 200	19	3	22	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 1.490	(59)	80	21	0,00
CBK	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	200	(1)	2	1	0,00
FBF	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 700	66	11	77	0,00
GST	Intrum AB	5,000	20.12.2024	3.400	364	9	373	0,02
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 2.010	(67)	95	28	0,00
JPM	Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.12.2022	€ 300	12	0	12	0,00
	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	1.200	262	(22)	260	0,02
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	\$ 200	(2)	3	1	0,00
MYC	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 1.100	109	12	121	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 300	(3)	7	4	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	500	(7)	11	4	0,00
MYI	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	700	(4)	6	2	0,00
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 900	100	(1)	99	0,01
					\$ 807	\$ 279	\$ 1.086	0,06

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	NOK	\$ 64.350	\$ 7.506	\$ 28	\$ 0	\$ 28	0,00
	08.2021	\$	7.507	NOK 64.350	0	(28)	(28)	0,00
	09.2021		7	PLN 27	0	0	0	0,00
BPS	09.2021		13	RUB 962	0	0	0	0,00
	07.2021	€	8.320	\$ 10.090	223	0	223	0,01
	07.2021	\$	6.085	AUD 7.830	0	(207)	(207)	(0,01)
BRC	07.2021		7.878	€ 6.803	0	(47)	(47)	0,00
	07.2021		30	RUB 2.209	1	0	1	0,00
	07.2021		34	MXN 689	0	0	0	0,00
CBK	07.2021		7.464	SEK 61.880	0	(229)	(229)	(0,02)
	09.2021		4	PLN 13	0	0	0	0,00
	07.2021		2.098	AUD 2.713	0	(62)	(62)	0,00
GLM	07.2021		7.704	NOK 64.350	0	(226)	(226)	(0,01)
	09.2021	ZAR	206	\$ 15	1	0	1	0,00
	07.2021	£	64.548	91.253	2.083	0	2.083	0,12
	08.2021	\$	30	RUB 2.209	0	0	0	0,00
	09.2021		4	PLN 15	0	0	0	0,00
	09.2021		10	RUB 740	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
HUS	09.2021	ZAR 109	\$ 8	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2021	\$ 89.339	£ 64.548	0	(169)	(169)	(0,01)
	08.2021	£ 64.548	\$ 89.346	169	0	169	0,01
	09.2021	\$ 15.189	CNH 97.614	0	(155)	(155)	(0,01)
JPM	09.2021	6	PLN 25	0	0	0	0,00
	09.2021	7	RUB 506	0	0	0	0,00
	09.2021	IDR 978.813	\$ 68	1	0	1	0,00
	07.2021	BRL 3.491	652	0	(44)	(44)	0,00
MYI	07.2021	€ 390	465	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 696	BRL 3.491	0	0	0	0,00
	07.2021	2.586	£ 1.869	0	(4)	(4)	0,00
	08.2021	BRL 3.491	\$ 694	1	0	1	0,00
SCX	07.2021	€ 338.902	414.597	12.693	0	12.693	0,76
	07.2021	AUD 7.100	5.385	55	0	55	0,00
UAG	08.2021	\$ 5.386	AUD 7.100	0	(55)	(55)	0,00
				\$ 15.257	\$ (1.226)	\$ 14.031	0,84

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 997	€ 821	\$ 0	\$ (23)	\$ (23)	0,00
BFS	07.2021	170.297	139.417	0	(4.962)	(4.962)	(0,30)
BRC	07.2021	1.348	1.107	0	(36)	(36)	0,00
GLM	07.2021	€ 149	\$ 181	4	0	4	0,00
	07.2021	93	112	2	0	2	0,00
HUS	07.2021	\$ 2.228	€ 1.841	0	(45)	(45)	0,00
	07.2021	269	226	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2021	€ 94	\$ 114	3	0	3	0,00
	07.2021	\$ 181.511	€ 148.370	0	(5.559)	(5.559)	(0,34)
TOR	07.2021	181.511	148.370	0	(5.559)	(5.559)	(0,33)
				\$ 9	\$ (16.185)	\$ (16.176)	(0,97)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BFS	07.2021	£ 2.678	\$ 3.769	\$ 70	\$ 0	\$ 70	0,00
BRC	07.2021	7	9	0	0	0	0,00
GLM	07.2021	\$ 340.576	£ 240.906	0	(7.776)	(7.776)	(0,47)
HUS	07.2021	£ 249.149	\$ 344.841	654	0	654	0,04
	07.2021	\$ 2.957	£ 2.085	0	(78)	(78)	0,00
MYI	08.2021	344.867	249.148	0	(651)	(651)	(0,04)
	07.2021	£ 13.221	\$ 18.482	218	0	218	0,01
RYL	07.2021	\$ 28	£ 20	0	0	0	0,00
	07.2021	666	472	0	(13)	(13)	0,00
SSB	07.2021	£ 249.201	\$ 344.377	119	0	119	0,01
	07.2021	\$ 337.448	£ 238.143	0	(8.466)	(8.466)	(0,51)
UAG	08.2021	344.331	249.148	0	(115)	(115)	(0,01)
	07.2021	341.333	240.906	0	(8.532)	(8.532)	(0,51)
				\$ 1.061	\$ (25.631)	\$ (24.570)	(1,48)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (25.680) (1,55)

Summe Anlagen

\$ 1.598.220 96,18

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 63.488 3,82

Nettovermögen

\$ 1.661.708 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Reines Kapitalwertpapier.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(e) Nullkuponwertpapier.

(f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
 (h) Mit dem Fonds verbunden.
 (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (j) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Netto- ver- mögens
Citigroup, Inc. 2,572 % fällig am 03.06.2031	26.05.2020	\$ 800	\$ 823	0,05
Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032	11.01.2021 - 28.01.2021	1.504	1.528	0,09
General Motors Co. 6,800 % fällig am 01.10.2027	07.05.2020	200	252	0,01
Noble Corp.	05.02.2021 - 08.02.2021	356	755	0,04
Occidental Petroleum Corp. 5,500 % fällig am 01.12.2025	08.12.2020 - 12.05.2021	5.903	6.316	0,38
Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 30.12.2021	11.01.2021	3.700	3.703	0,22
		\$ 12.463	\$ 13.377	0,79

(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.942 als Sicherheiten verpfändet.

(l) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 21.328 und Barmittel in Höhe von USD 9.080 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 54.849 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 971	\$ 1.451.318	\$ 0	\$ 1.452.289
Investmentfonds	87.178	78.372	0	165.550
Finanzderivate ⁽³⁾	(64)	(19.555)	0	(19.619)
Summen	\$ 88.085	\$ 1.510.135	\$ 0	\$ 1.598.220

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.228.306	\$ 409	\$ 1.228.715
Investmentfonds	68.365	78.479	0	146.844
Pensionsgeschäfte	0	39.170	0	39.170
Finanzderivate ⁽³⁾	21	24.764	0	24.785
Summen	\$ 68.386	\$ 1.370.719	\$ 409	\$ 1.439.514

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettover- mögens
BPS	(1,300) %	09.06.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (1.673)	\$ (1.982)	(0,12)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (1.982)	(0,12)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (24)	\$ 1	\$ (23)
BPS	(4.819)	4.190	(629)
BRC	(287)	332	45
CBK	(288)	351	63
DUB	(9)	(10)	(19)
FBF	70	0	70
GLM	(5.689)	5.047	(642)
GST	396	(280)	116
HUS	(273)	281	8

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
JPM	\$ 270	\$ (370)	\$ (100)
MYC	131	0	131
MYI	271	(260)	11
RYL	(13)	0	(13)
SCX	7.137	(6.260)	877
SSB	(8.462)	7.655	(807)
TOR	(5.559)	4.890	(669)
UAG	(8.532)	7.661	(871)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	67,00	60,58
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	17,60	19,32
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,80	2,73
Investmentfonds	9,96	9,88
Pensionsgeschäft	k. A.	2,64
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,37	0,04
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,55)	1,62
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,12)	(0,07)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Albanien	0,06	0,16
Angola	k. A.	0,09
Argentinien	0,50	0,59
Australien	0,03	0,01
Österreich	0,24	0,26
Weissrussland	0,04	0,10
Belgien	0,13	k. A.
Bermudas	0,41	0,38
Brasilien	0,49	0,69
Kanada	0,36	0,49
Cayman Inseln	3,52	2,82
Chile	0,24	0,29
China	0,98	1,04
Kolumbien	0,35	0,42
Curacao	0,41	0,39
Dominikanische Republik	0,55	0,59
Ecuador	0,22	0,19
Ägypten	0,64	0,50
Finnland	k. A.	0,14
Frankreich	2,48	3,00
Deutschland	3,91	3,51
Ghana	0,14	0,15
Guernsey, Kanalinseln	0,45	0,52
Hongkong	0,91	0,61
Indien	0,10	0,12
Indonesien	2,07	2,47
Irland	2,36	1,10
Insel Man	0,24	0,27
Israel	0,06	k. A.
Italien	4,57	3,61
Elfenbeinküste	0,26	0,06
Japan	0,70	0,78
Jersey, Kanalinseln	0,82	0,90
Jordanien	0,05	0,09
Kasachstan	k. A.	0,33
Kenia	k. A.	0,05
Liberia	0,09	0,10
Luxemburg	3,89	4,53
Mazedonien	0,05	0,06
Malaysia	k. A.	0,09
Mauritius	0,09	0,10
Mexiko	2,34	2,52
Marokko	0,04	0,05
Multinational	0,46	0,34
Niederlande	3,53	2,99
Nigeria	0,30	0,22
Norwegen	0,03	0,15
Oman	0,67	0,43
Panama	0,12	0,15
Paraguay	0,10	0,11
Peru	0,21	k. A.
Portugal	0,16	0,18
Katar	0,86	1,03

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Rumänien	0,20	0,21
Russland	0,62	0,71
Saudi-Arabien	1,01	1,13
Senegal	k. A.	0,07
Serbien	0,06	0,01
Singapur	0,20	0,23
Slowenien	0,05	0,05
Südafrika	0,64	0,69
Spanien	0,97	1,09
Sri Lanka	0,08	0,08
Supranational	0,05	k. A.
Schweden	0,02	0,03
Schweiz	0,93	1,10
Trinidad und Tobago	k. A.	0,05
Tunesien	0,03	0,03
Türkei	1,28	1,29
Ukraine	0,76	0,83
Vereinigte Arabische Emirate	0,46	0,59
Großbritannien	8,06	9,63
USA	21,66	23,85
Venezuela	0,02	0,03
Jungferninseln (Britisch)	0,03	k. A.
Kurzfristige Instrumente	9,04	1,16
Investmentfonds	9,96	9,88
Pensionsgeschäfte	k. A.	2,64
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,00	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,11	0,73
Zinsswaps	0,22	(0,65)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,06	0,04
Devisenterminkontrakte	0,84	(0,47)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,45)	2,06
Sonstige Aktiva und Passiva	3,82	3,19
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Bond Fund

30. Juni 2021

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG											
Adient U.S. LLC	1.600	1.604	0,04	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	2.000	2.715	0,07	5,250 % fällig am 11.02.2027 (h)(j)	800	848	0,02
3,604 % fällig am 08.04.2028				6,000 % fällig am 15.01.2026 (h)(j)				6,250 % fällig am 18.12.2024 (h)(j)	500	549	0,01
At Home Group, Inc.	1.300	1.302	0,03	Banco Santander S.A.	4.400	6.109	0,16	6,375 % fällig am 21.08.2026 (h)(j)	1.000	1.116	0,03
TBD % fällig am 30.07.2028				1,500 % fällig am 14.04.2026	3.200	3.929	0,10	7,125 % fällig am 29.07.2022 (h)(j)	1.700	1.775	0,05
Caesars Resort Collection LLC	3.897	3.868	0,10	4,375 % fällig am 14.01.2026 (h)(j)	2.200	2.638	0,07	7,500 % fällig am 11.12.2023 (h)(j)	2.100	2.289	0,06
2,854 % fällig am 23.12.2024				6,250 % fällig am 11.09.2021 (h)(j)				7,500 % fällig am 11.12.2023 (h)(j)	3.700	4.112	0,11
4,604 % fällig am 21.07.2025				Bank of America Corp.	2.200	2.312	0,06	Cromwell Ereit Lux Finco SARL	3.100	3.817	0,10
Carnival Corp.	2.680	2.747	0,07	3,550 % fällig am 05.03.2024	5.300	5.652	0,15	2,125 % fällig am 19.11.2025			
8,500 % fällig am 30.06.2025				3,864 % fällig am 23.07.2024	5.050	5.500	0,15	Crown Castle International Corp.	4.050	4.503	0,12
DEI Sales, Inc.	6.700	6.633	0,18	4,125 % fällig am 22.01.2024				3,800 % fällig am 15.02.2028			
6,250 % fällig am 23.04.2028				Bank of Ireland Group PLC	3.700	5.194	0,14	CTP NV	2.200	2.600	0,07
Delos Finance SARL	3.220	3.221	0,09	7,500 % fällig am 19.05.2025 (h)(j)	1.659	1.810	0,05	0,500 % fällig am 21.06.2025	4.000	4.694	0,12
1,897 % fällig am 06.10.2023				Barclays Bank PLC	1.100	1.422	0,04	1,250 % fällig am 21.06.2029			
Hertz Corp.	2.850	2.850	0,08	7,625 % fällig am 21.11.2022 (j)	1.800	1.846	0,05	Cyrusone Europe Finance DAC	2.200	2.596	0,07
TBD % fällig am 14.06.2028				Barclays PLC	1.800	2.633	0,07	1,125 % fällig am 26.05.2028			
Hilton Grand Vacations Borrower LLC	1.600	1.603	0,04	3,375 % fällig am 02.04.2025	1.700	2.633	0,07	Deutsche Bank AG	1.900	1.892	0,05
TBD % fällig am 19.05.2028				4,610 % fällig am 15.02.2023	200	316	0,01	0,898 % fällig am 28.05.2024 (k)	6.400	7.870	0,21
Hilton Worldwide Finance LLC	4.774	4.740	0,13	6,375 % fällig am 15.12.2025 (h)(j)	2.500	3.734	0,10	1,375 % fällig am 03.09.2026	4.600	5.541	0,15
1,842 % fällig am 22.06.2026				7,125 % fällig am 15.06.2025 (h)(j)	600	661	0,02	1,375 % fällig am 17.02.2032	1.900	2.371	0,06
IRB Holding Corp.	1.596	1.597	0,04	7,250 % fällig am 15.03.2023 (h)(j)	200	297	0,01	1,625 % fällig am 20.01.2027	1.200	1.732	0,05
4,250 % fällig am 15.12.2027				7,750 % fällig am 15.09.2023 (h)(j)	400	455	0,01	2,625 % fällig am 16.12.2024	800	815	0,02
Organon & Co.	3.000	3.006	0,08	7,875 % fällig am 15.09.2022 (h)(j)	4.400	5.175	0,14	3,035 % fällig am 28.05.2032 (k)	5.000	5.409	0,14
3,500 % fällig am 02.06.2028				8,000 % fällig am 15.06.2024 (h)(j)	2.100	2.547	0,07	3,875 % fällig am 14.10.2021	11.050	11.170	0,30
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.	4.479	4.476	0,12	Bevo Lux SARL	1.100	1.360	0,04	4,250 % fällig am 14.10.2021	1.200	1.482	0,04
3,854 % fällig am 16.11.2025				1,000 % fällig am 16.01.2030	1.100	1.360	0,04	4,625 % fällig am 30.10.2027 (h)(j)	5.100	5.240	0,14
Starfruit Finco BV	5.476	6.471	0,17	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	4.500	4.476	0,12	5,000 % fällig am 14.02.2022			
3,000 % fällig am 01.10.2025				1,250 % fällig am 26.04.2027	10.400	10.340	0,27	Digital Dutch Finco BV	1.100	1.379	0,04
U.S. Foods, Inc.	1.439	1.428	0,04	2,000 % fällig am 15.02.2024	2.400	3.073	0,08	1,500 % fällig am 15.03.2030	49	49	0,00
1,854 % fällig am 27.06.2023				Blue Owl Finance LLC	4.800	5.539	0,15	Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust	405	407	0,01
United Airlines, Inc.	1.500	1.522	0,04	3,125 % fällig am 10.06.2031	1.200	1.310	0,03	5,250 % fällig am 30.05.2025			
4,500 % fällig am 21.04.2028				BNP Paribas S.A.	7.500	8.227	0,22	Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust			
Zayo Group Holdings, Inc.	6.204	6.143	0,16	1,904 % fällig am 30.09.2028				5,125 % fällig am 30.11.2024			
3,104 % fällig am 09.03.2027				2,125 % fällig am 23.01.2027				E*TRADE Financial Corp.	7.500	8.696	0,23
3,250 % fällig am 09.03.2027				4,400 % fällig am 14.08.2028				4,500 % fällig am 20.06.2028			
	59.941	1,59		4,705 % fällig am 10.01.2025				Equinix, Inc.	1.500	1.769	0,05
				Brown & Brown, Inc.	1.800	2.491	0,07	0,250 % fällig am 15.03.2027			
				4,200 % fällig am 15.09.2024				Fairfax Financial Holdings Ltd.	2.500	2.869	0,08
				CaixaBank S.A.	2.000	2.351	0,06	4,625 % fällig am 29.04.2030			
				1,500 % fällig am 03.12.2026				Five Corners Funding Trust	800	873	0,02
				CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan				4,419 % fällig am 15.11.2023			
				European Core Fund				Ford Motor Credit Co. LLC	700	830	0,02
				0,500 % fällig am 27.01.2028				0,000 % fällig am 01.12.2021	400	400	0,01
				Ceetrus S.A.	1.800	2.335	0,06	1,068 % fällig am 12.10.2021	300	299	0,01
				2,750 % fällig am 26.11.2026				1,256 % fällig am 03.08.2022	400	399	0,01
				Citigroup, Inc.	1.000	1.006	0,03	1,391 % fällig am 15.02.2023	500	499	0,01
				1,136 % fällig am 25.04.2022				1,416 % fällig am 28.03.2022	200	246	0,01
				1,565 % fällig am 01.09.2023				2,330 % fällig am 25.11.2025	2.300	3.227	0,09
				3,200 % fällig am 21.10.2026				2,748 % fällig am 14.06.2024	1.800	1.794	0,05
				4,044 % fällig am 01.06.2024				2,900 % fällig am 16.02.2028	900	1.121	0,03
				Citycon Treasury BV	2.900	3.454	0,09	3,021 % fällig am 06.03.2024	100	127	0,00
				1,625 % fällig am 12.03.2028				3,250 % fällig am 15.09.2025	3.800	3.907	0,10
				Cooperative Rabobank UA	1.100	1.183	0,03	3,550 % fällig am 07.10.2022	200	297	0,01
				3,875 % fällig am 26.09.2023				4,535 % fällig am 06.03.2025	5.100	5.211	0,14
				4,375 % fällig am 29.06.2027 (h)(j)				5,596 % fällig am 07.01.2022			
				Corp. Andina de Fomento	140.341	7.077	0,19	Goldman Sachs Group, Inc.	4.900	5.815	0,15
				3,950 % fällig am 15.10.2021 (g)				0,010 % fällig am 30.04.2024	1.500	1.502	0,04
				CPI Property Group S.A.	3.400	3.938	0,10	0,523 % fällig am 08.03.2023	1.500	1.503	0,04
				1,500 % fällig am 27.01.2031				0,673 % fällig am 08.03.2024	500	501	0,01
				1,625 % fällig am 23.04.2027				0,966 % fällig am 31.10.2022	2.500	3.446	0,09
				2,750 % fällig am 12.05.2026				1,000 % fällig am 16.12.2025	800	822	0,02
				2,750 % fällig am 22.01.2028				1,328 % fällig am 15.05.2026	2.500	3.464	0,09
				Credit Suisse AG	11.300	11.378	0,30	1,875 % fällig am 16.12.2030	3.800	3.966	0,10
				2,100 % fällig am 12.11.2021				3,200 % fällig am 23.02.2023			
				6,500 % fällig am 08.08.2023 (j)				HSBC Holdings PLC	2.300	2.331	0,06
				Credit Suisse Group AG	500	709	0,02	1,155 % fällig am 18.05.2024	5.200	7.269	0,19
				2,125 % fällig am 12.09.2025				1,750 % fällig am 24.07.2027	700	790	0,02
				3,869 % fällig am 12.01.2029				4,300 % fällig am 08.03.2026	2.900	3.354	0,09
				4,550 % fällig am 17.04.2026				4,583 % fällig am 19.06.2029	2.200	2.958	0,08
								4,750 % fällig am 04.07.2029 (h)(j)	200	249	0,01
								5,250 % fällig am 16.09.2022 (h)(j)			
								IMMOFINANZ AG	1.600	1.964	0,05
								2,500 % fällig am 15.10.2027	3.000	3.671	0,10
								2,625 % fällig am 27.01.2023			
								Intesa Sanpaolo SpA	3.100	3.699	0,10
								0,750 % fällig am 16.03.2028	5.800	6.173	0,16
								3,250 % fällig am 23.09.2024	400	439	0,01
								4,000 % fällig am 23.09.2029	1.400	2.208	0,06
								5,148 % fällig am 10.06.2030			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	
GATX Corp.				Scripps Escrow, Inc.				WANDELANLEIHEN & WECHSEL				
0,896 % fällig am 05.11.2021	800	\$	802	5,375 % fällig am 15.01.2031	1.600	1.597	0,04	Royal Caribbean Cruises Ltd.				
Glencore Finance Canada Ltd.				Six Flags Theme Parks, Inc.				4,250 % fällig am 15.06.2023	\$	5.000	6.838	0,18
4,950 % fällig am 15.11.2021	1.000		1.016	7,000 % fällig am 01.07.2025	\$	2.500	0,07	Southwest Airlines Co.				
Gruenthal GmbH				Sixt SE				1,250 % fällig am 01.05.2025	7.500	11.395	0,30	
3,625 % fällig am 15.11.2026	€	2.900	3.542	1,750 % fällig am 09.12.2024	€	500	0,02			18.233	0,48	
4,125 % fällig am 15.05.2028	700		857	Sprint Spectrum Co. LLC				KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
HCA, Inc.				3,360 % fällig am 20.03.2023	\$	19	0,00	California State General Obligation Bonds, (BABs), (AGM/CR Insured), Series 2010				
4,750 % fällig am 01.05.2023	\$	100	107	Syngenta Finance NV				6,875 % fällig am 01.11.2026	2.345	3.064	0,08	
5,375 % fällig am 01.09.2026	900		1.037	3,375 % fällig am 16.04.2026	€	1.000	0,04	California State General Obligation Bonds, Series 2017				
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				T-Mobile USA, Inc.				0,866 % fällig am 01.04.2047	2.600	2.603	0,07	
3,625 % fällig am 15.02.2032	2.200		2.175	3,300 % fällig am 15.02.2051	\$	2.700	0,07	Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2012				
3,750 % fällig am 01.05.2029	600		607	3,875 % fällig am 15.04.2030	\$	4.200	0,12	5,500 % fällig am 01.07.2026 ^	110	97	0,00	
4,000 % fällig am 01.05.2031	10.400		10.506	Tesco Corporate Treasury Services PLC				Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010				
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC				0,875 % fällig am 29.05.2026	€	2.200	0,07	7,350 % fällig am 01.07.2035	750	969	0,03	
5,000 % fällig am 01.06.2029	4.000		4.095	Toyota Industries Corp.				Texas Public Finance Authority Revenue Notes, Series 2014				
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				3,110 % fällig am 12.03.2022	\$	2.100	0,06	8,250 % fällig am 01.07.2024	375	378	0,01	
3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)	€	3.200	3.877	Toyota Tsusho Corp.				Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007				
Imperial Brands Finance Netherlands BV				3,625 % fällig am 13.09.2023	3.400	3.621	0,10	0,000 % fällig am 01.06.2047 (e)	22.700	2.544	0,07	
1,750 % fällig am 18.03.2033	4.200		5.030	Transocean, Inc.				Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020				
Imperial Brands Finance PLC				7,250 % fällig am 01.11.2025	8.000	6.989	0,19	3,151 % fällig am 01.06.2032	1.500	1.560	0,04	
2,125 % fällig am 12.02.2027	2.500		3.180	7,500 % fällig am 15.01.2026	750	646	0,02	3,301 % fällig am 01.06.2033	800	832	0,02	
Intelsat Jackson Holdings S.A.				UCB S.A.						12.047	0,32	
8,500 % fällig am 15.10.2024 ^	\$	2.000	1.187	1,000 % fällig am 30.03.2028	€	5.700	0,18	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
InterContinental Hotels Group PLC				United Airlines Pass-Through Trust				Fannie Mae				
1,625 % fällig am 08.10.2024	€	2.500	3.092	5,875 % fällig am 15.04.2029	\$	3.521	0,10	0,212 % fällig am 25.03.2034	64	63	0,00	
3,375 % fällig am 08.10.2028	€	1.000	1.496	Virgin Media Secured Finance PLC				0,222 % fällig am 25.11.2031	18	18	0,00	
Interpublic Group of Cos., Inc.				4,250 % fällig am 15.01.2030	€	4.000	0,15	0,232 % fällig am 25.02.2032	35	35	0,00	
3,750 % fällig am 01.10.2021	\$	400	404	Vmed O2 UK Financing PLC				0,262 % fällig am 25.11.2032	12	12	0,00	
JetBlue Pass-Through Trust				4,500 % fällig am 15.07.2031 (b)	2.800	3.888	0,10	0,442 % fällig am 25.03.2037	33	33	0,00	
2,750 % fällig am 15.11.2033	188		194	VMware, Inc.				0,480 % fällig am 25.07.2042 (a)	26.091	380	0,01	
Kraft Heinz Foods Co.				2,950 % fällig am 21.08.2022	\$	2.700	0,07	0,492 % fällig am 25.09.2032	2	2	0,00	
5,000 % fällig am 15.07.2035	100		123	Volkswagen Group of America Finance LLC				0,533 % fällig am 18.10.2030	5	5	0,00	
Melco Resorts Finance Ltd.				4,000 % fällig am 12.11.2021	1.000	1.014	0,03	0,616 % fällig am 25.06.2042 (a)	21.266	367	0,01	
5,375 % fällig am 04.12.2029	200		212	Wabtec Transportation Netherlands BV				1,962 % fällig am 25.09.2060 (a)	21.652	524	0,01	
Micron Technology, Inc.				1,250 % fällig am 03.12.2027	€	4.600	0,15	2,000 % fällig am 25.11.2050 (a)	4.818	470	0,01	
4,640 % fällig am 06.02.2024	7.500		8.227	Zimmer Biomet Holdings, Inc.				2,245 % fällig am 25.06.2043 (a)	7.125	542	0,02	
Mileage Plus Holdings LLC				3,150 % fällig am 03.11.2021	\$	400	0,01	3,506 % fällig am 25.08.2046	218	201	0,01	
6,500 % fällig am 20.06.2027	5.200		5.732	3,375 % fällig am 30.11.2021	800	804	0,02	4,000 % fällig am 25.06.2050 (a)	8.984	1.512	0,04	
MPLX LP				American Transmission Systems, Inc.				5,949 % fällig am 25.11.2046 (a)	9.167	1.127	0,03	
3,500 % fällig am 01.12.2022	400		416	5,250 % fällig am 15.01.2022	200	205	0,01	5,959 % fällig am 25.07.2059 (a)	14.114	2.734	0,07	
NCL Corp. Ltd.				CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.				6,009 % fällig am 25.10.2050 (a)	7.665	1.212	0,03	
10,250 % fällig am 01.02.2026	5.800		6.757	1,500 % fällig am 17.10.2031	€	2.500	0,08	6,059 % fällig am 25.07.2043 (a)	1.699	300	0,01	
12,250 % fällig am 15.05.2024	5.000		6.045	2,625 % fällig am 17.10.2034	€	2.500	0,10	6,109 % fällig am 25.05.2048 (a)	3.458	591	0,02	
Nidec Corp.				Duke Energy Corp.				6,409 % fällig am 25.03.2042 (a)	11.640	2.164	0,06	
0,046 % fällig am 30.03.2026	€	2.600	3.084	0,775 % fällig am 11.03.2022	\$	5.000	0,13	6,509 % fällig am 25.11.2035 (a)	166	19	0,00	
Nissan Motor Co. Ltd.				Enel Finance International NV				6,539 % fällig am 25.10.2039 (a)	4.481	353	0,01	
3,522 % fällig am 17.09.2025	\$	7.500	8.014	4,250 % fällig am 14.09.2023	2.300	2.480	0,07	24,231 % fällig am 25.03.2036	413	665	0,02	
4,345 % fällig am 17.09.2027	2.900		3.190	Midwest Connector Capital Co. LLC				Freddie Mac				
NVR, Inc.				3,625 % fällig am 01.04.2022	1.200	1.220	0,03	0,372 % fällig am 25.09.2031	136	134	0,00	
3,950 % fällig am 15.09.2022	600		620	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				1,516 % fällig am 25.07.2044	474	490	0,01	
Ovintiv Exploration, Inc.				0,867 % fällig am 25.02.2022	3.200	3.213	0,09	1,650 % fällig am 25.10.2021 (a)	6.228	0	0,00	
5,375 % fällig am 01.01.2026	3.500		3.948	1,950 % fällig am 01.09.2022	3.000	3.056	0,08	2,000 % fällig am 25.12.2050 (a)	4.856	465	0,01	
Panasonic Corp.				ONEOK, Inc.				2,325 % fällig am 01.09.2027	2	2	0,00	
2,536 % fällig am 19.07.2022	1.600		1.632	4,350 % fällig am 15.03.2029	100	113	0,00	2,519 % fällig am 15.08.2042	1.327	1.207	0,03	
Penske Truck Leasing Co. LP				Pacific Gas & Electric Co.				4,000 % fällig am 15.01.2033 - 25.07.2050 (a)	26.878	4.306	0,12	
3,950 % fällig am 10.03.2025	2.000		2.189	2,100 % fällig am 01.08.2027	4.800	4.667	0,12	4,000 % fällig am 01.07.2047	220	237	0,01	
Petroleos Mexicanos				3,000 % fällig am 15.06.2028	2.400	2.414	0,06	5,500 % fällig am 01.04.2027 - 01.01.2040	663	759	0,02	
6,840 % fällig am 23.01.2030	5.000		5.159	3,150 % fällig am 01.01.2026	500	516	0,01	5,857 % fällig am 15.12.2037 (a)	432	75	0,00	
Petronas Capital Ltd.				3,300 % fällig am 01.12.2027 ^	3.000	3.087	0,08	6,009 % fällig am 25.06.2050 (a)	16.088	2.995	0,08	
3,500 % fällig am 21.04.2030	400		439	3,500 % fällig am 01.08.2050	300	268	0,01	6,537 % fällig am 15.04.2042 (a)	237	49	0,00	
QVC, Inc.				4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	500	482	0,01	Ginnie Mae				
4,375 % fällig am 15.03.2023	700		739	Petrobras Global Finance BV				2,125 % fällig am 20.11.2029	3	3	0,00	
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC				5,999 % fällig am 27.01.2028	13.004	14.955	0,40	2,250 % fällig am 20.09.2031	141	146	0,00	
0,694 % fällig am 24.06.2022	2.200		2.211	Rio Oil Finance Trust				3,500 % fällig am 15.07.2045	12.773	14.087	0,37	
RELX Capital, Inc.				9,750 % fällig am 06.01.2027	996	1.178	0,03	4,500 % fällig am 20.10.2045 (a)	3.901	642	0,02	
3,500 % fällig am 16.03.2023	400		420	Southern Co. Gas Capital Corp.				Ginnie Mae, TBA				
Sabine Pass Liquefaction LLC				2,450 % fällig am 01.10.2023	500	520	0,01	4,000 % fällig am 01.07.2051	8.000	8.566	0,23	
4,200 % fällig am 15.03.2028	4.000		4.520	Sprint Corp.								
Safran S.A.				7,125 % fällig am 15.06.2024	800	924	0,03					
0,750 % fällig am 17.03.2031	€	3.300	3.980			52.793	1,40					
Sands China Ltd.				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		1.071.376	28,34					
5,400 % fällig am 08.08.2028	\$	7.800	9.065									

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Residential Asset Mortgage Products Trust				Zais CLO Ltd.				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
0,462 % fällig am 25.05.2037	\$ 3.933	\$3.748	0,10	1,334 % fällig am 15.04.2028	\$ 2.207	\$2.210	0,06	COMMERCIAL PAPER			
0,652 % fällig am 25.06.2032	3	3	0,00			563.987	14,92	Sunac China Holdings Ltd.			
1,022 % fällig am 25.05.2035	139	139	0,00					5,950 % fällig am 30.12.2021 (k)	\$ 6.300	\$6.304	0,17
Residential Asset Securities Corp. Trust				STAATSEMISSIONEN				KURZFRISTIGE SCHULDITITEL			
0,392 % fällig am 25.07.2036	740	737	0,02	Argentina Government International Bond				Pacific Gas and Electric Co.			
0,432 % fällig am 25.11.2036	2.926	2.795	0,07	0,125 % fällig am 09.07.2030	3.875	1.372	0,04	1,531 % fällig am 15.11.2021	6.100	6.113	0,16
0,612 % fällig am 25.07.2036 ^	1.006	916	0,02	0,125 % fällig am 09.07.2035	10.189	3.236	0,09				
0,632 % fällig am 25.07.2036	1.296	1.192	0,03	1,000 % fällig am 05.08.2021	ARS 53.990	320	0,01	ARGENTINA TREASURY BILLS			
0,917 % fällig am 25.07.2034	489	483	0,01	1,000 % fällig am 09.07.2029	\$ 483	184	0,00	(3,480) % fällig am			
Saxon Asset Securities Trust				2,500 % fällig am 22.07.2021	ARS 165.079	\$980	0,03	13,09.2021 (e)(f)	ARS 304.122	1.797	0,05
0,262 % fällig am 25.10.2046	579	568	0,02	15,500 % fällig am 17.10.2026	17.300	42	0,00	38,001 % fällig am			
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				34,069 % fällig am 04.10.2022	3.300	15	0,00	30,07.2021 (e)(f)	53.778	309	0,01
0,752 % fällig am 25.08.2035 ^	2.436	1.996	0,05	36,104 % fällig am 03.04.2022	20.060	116	0,00	40,499 % fällig am			
0,857 % fällig am 25.02.2034	387	384	0,01	Australia Government International Bond				29,10.2021 (e)(f)	215.461	1.134	0,03
1,052 % fällig am 25.01.2036 ^	377	338	0,01	2,500 % fällig am 21.05.2030	AUD 48.300	39.690	1,05			3.240	0,09
Segovia European CLO				Autonomous City of Buenos Aires Argentina				ISRAEL TREASURY BILLS			
0,870 % fällig am 15.04.2030	€ 3.000	3.563	0,09	39,117 % fällig am				(0,028) % fällig am			
SG Mortgage Securities Trust				23,01.2022	ARS 29.780	175	0,00	30,11.2021 (e)(f)	ILS 20.200	6.200	0,16
0,302 % fällig am 25.10.2036	\$ 1.700	1.381	0,04	China Development Bank				0,006 % fällig am			
Shackleton CLO Ltd.				3,230 % fällig am 10.01.2025	CNY 258.200	40.091	1,06	08,06.2022 (e)(f)	44.400	13.625	0,36
1,318 % fällig am 20.10.2028	5.896	5.901	0,16	3,340 % fällig am 14.07.2025	230.200	35.814	0,95			19.825	0,52
Sierra Madre Funding Ltd.				Israel Government International Bond				U.S. TREASURY BILLS			
0,460 % fällig am 07.09.2039	2.789	2.483	0,07	2,750 % fällig am 03.07.2030	\$ 4.000	4.275	0,11	0,030 % fällig am			
0,480 % fällig am 07.09.2039	16.003	14.249	0,38	3,800 % fällig am 13.05.2060	8.600	9.815	0,26	05,10.2021 (e)(f)(m)	\$ 3.300	3.300	0,09
SLM Student Loan Trust				Kuwait International Government Bond				Summe kurzfristige Instrumente		38.782	1,03
1,676 % fällig am 25.04.2023	354	357	0,01	3,500 % fällig am 20.03.2022	1.150	1.171	0,03	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.868.401	75,87	
Soundview Home Loan Trust				3,500 % fällig am 20.03.2027	4.600	5.139	0,14	AKTIEN			
0,152 % fällig am 25.11.2036	283	116	0,00	Peru Government International Bond				INVESTMENTFONDS			
0,262 % fällig am 25.08.2037	1.968	1.828	0,05	5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 21.700	6.203	0,16	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
0,302 % fällig am 25.06.2037	3.202	2.625	0,07	6,150 % fällig am 12.08.2032	53.300	14.224	0,38	PIMCO Funds: Global Investors			
0,372 % fällig am 25.06.2037	4.631	3.827	0,10	6,350 % fällig am 12.08.2028	35.800	10.463	0,28	Series plc – Asia Strategic			
0,652 % fällig am 25.10.2036	586	578	0,02	8,200 % fällig am 12.08.2026	11.900	3.862	0,10	Interest Bond Fund (i)	1.496.908	15.223	0,40
0,992 % fällig am 25.10.2037	4.492	3.966	0,11	Provincia de Buenos Aires				PIMCO Funds: Global Investors			
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				37,854 % fällig am				Yield Bond Fund (i)	770.713	9.133	0,24
0,392 % fällig am 25.09.2037	529	269	0,01	12,04.2025	ARS 315.510	1.597	0,04	PIMCO Funds: Global Investors			
0,692 % fällig am 25.12.2036	1.899	1.871	0,05	37,954 % fällig am				Series plc – US Short-Term			
0,917 % fällig am 25.05.2035	285	284	0,01	31,05.2022	17.888	101	0,00	Fund (i)	9.111.550	92.938	2,46
3,639 % fällig am 25.02.2037 ^	1.687	898	0,02	Qatar Government International Bond				PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
Structured Asset Investment Loan Trust				3,875 % fällig am 23.04.2023	\$ 4.900	5.208	0,14	US Dollar Short-Term			
0,812 % fällig am 25.05.2035	1.103	1.104	0,03	4,500 % fällig am 23.04.2028	5.100	6.028	0,16	Floating NAV Fund (i)	12.123.441	120.762	3,19
1,067 % fällig am 25.01.2035	5.219	5.080	0,13	Republic of Greece Government International Bond				238.056	6,29		
1,217 % fällig am 25.01.2035	397	377	0,01	1,875 % fällig am 24.01.2052	€ 1.700	2.123	0,06	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
1,667 % fällig am 25.01.2035	456	384	0,01	3,500 % fällig am 30.01.2023	154	194	0,01	PIMCO ETFs plc – PIMCO US			
1,817 % fällig am 25.01.2035 ^	264	72	0,00	3,750 % fällig am 30.01.2028	360	522	0,01	Dollar Short Maturity			
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				3,900 % fällig am 30.01.2033 (I)	2.035	3.221	0,09	UCITS ETF (i)	1.328.250	134.882	3,57
0,247 % fällig am 25.09.2036	8.194	6.426	0,17	4,000 % fällig am 30.01.2037 (I)	1.120	1.898	0,05	Summe Investmentfonds	\$ 372.938	9,86	
0,272 % fällig am 25.01.2037	927	579	0,02	Saudi Government International Bond							
0,592 % fällig am 25.11.2037	2.785	2.688	0,07	2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 550	554	0,01				
1,097 % fällig am 25.11.2035	6.400	6.326	0,17	3,625 % fällig am 04.03.2028	4.000	4.428	0,12				
1,592 % fällig am 25.04.2035	118	118	0,00	South Africa Government International Bond							
Structured Asset Securities Corp. Trust				4,850 % fällig am 30.09.2029	10.100	10.740	0,28				
0,782 % fällig am 25.09.2035	5.723	5.624	0,15	10,500 % fällig am							
Tikehau CLO BV				21,12.2026	ZAR 894.100	71.166	1,88				
0,880 % fällig am 07.12.2029	€ 8.718	10.347	0,27	Turkey Government International Bond							
Toro European CLO DAC				5,750 % fällig am 22.03.2024	\$ 1.800	1.871	0,05				
0,650 % fällig am 15.04.2030	2.000	2.372	0,06	6,350 % fällig am 10.08.2024	9.400	9.883	0,26				
Triaxx Prime CDO Ltd.				7,250 % fällig am 23.12.2023	4.000	4.323	0,11				
0,346 % fällig am 02.10.2039	\$ 1.842	133	0,00			301.044	7,96				
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				AKTIEN							
0,317 % fällig am 25.05.2037	4.215	3.982	0,11	STAMMAKTIE							
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				FINANZWERTE							
0,392 % fällig am 25.05.2036	1.024	897	0,02	National Bank of Greece							
0,572 % fällig am 25.05.2036	837	743	0,02	S.A. (d)	307.710	877	0,02				
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				VORZUGSWERTPAPIERE							
0,392 % fällig am 25.04.2037	2.867	2.407	0,06	Nationwide Building Society							
1,142 % fällig am 25.10.2034	281	280	0,01	10,250 %	38.168	9.913	0,26				
1,817 % fällig am 25.11.2035	7.389	7.459	0,20								

Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Bond Fund (Forts.)

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
TDM	0,030 %	30.06.2021	01.07.2021	\$ 498.300	U.S. Treasury Floating Rate Note 0,084 % fällig am 30.04.2023 U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	\$ (418.263) (90.698)	\$ 498.300	\$ 498.300	13,18
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (508.961)	\$ 498.300	\$ 498.300	13,18

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend³, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	862	\$ 1.603	0,04
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	121	(141)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	6.315	(1.861)	(0,05)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	1.218	(24)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	612	(1.230)	(0,03)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	573	(2.667)	(0,07)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	264	(2.434)	(0,07)
				\$ (6.754)	(0,18)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (6.754)	(0,18)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend³)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AES Corp.	5,000 %	20.12.2025	\$ 500	\$ 0	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	7.100	150	0,01
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	1.200	2	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.03.2023	1.600	(2)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2021	1.800	2	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	3.800	7	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	€ 7.000	116	0,00
DISH DBS Corp.	5,000	20.09.2021	\$ 2.500	(270)	(0,01)
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	4.800	15	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2021	8.800	(129)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2022	7.200	(54)	0,00
Stellantis NV	5,000	20.06.2026	€ 3.000	(8)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	3.100	24	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	4.300	18	0,00
				\$ (129)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	\$ 95	\$ (6)	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000)	20.12.2025	47.800	(3.184)	(0,08)
CDX.HY-36 5-Year Index	(5,000)	20.06.2026	123.400	(1.039)	(0,03)
iTraxx Europe Senior 27 5-Year Index	(1,000)	20.06.2022	€ 21.300	292	0,01
				\$ (3.937)	(0,10)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 2.400	\$ 6	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	12.300	33	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 1.400	13	0,00
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	2.500	4	0,00
				\$ 56	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	15.09.2026	£ 84.200	\$ (268)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	67.200	212	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	44.400	(622)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,840	03.01.2022	BRL 69.920	172	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,850	03.01.2022	250.000	620	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,860	03.01.2022	111.400	278	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,865	03.01.2022	86.180	208	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	76.500	185	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,871	03.01.2022	67.600	164	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,880	03.01.2022	42.200	102	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,330	03.01.2022	693.500	(804)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,345	03.01.2022	19.000	(32)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,350	03.01.2022	449.300	(742)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	29.000	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,700	03.01.2022	365.100	(11)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,978	03.01.2022	35.900	(38)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,040	03.01.2022	15.400	(15)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,115	02.01.2023	513.000	166	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,790	02.01.2024	344.000	238	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 107.600	14	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	9.200	14	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	13.600	9	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,270	03.03.2022	10.200	67	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025	8.300	27	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	5.000	17	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,290	03.03.2025	2.500	9	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	\$ 30.760	99	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,640	18.02.2026	102.800	(888)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	7.440	(286)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	03.02.2050	13.000	496	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.01.2030	24.500	(688)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,875	07.02.2050	7.600	(189)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.12.2029	25.240	(902)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.02.2030	14.200	(606)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.03.2030	7.100	(413)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.12.2051	46.700	320	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	191.270	(24.857)	(0,06)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	11.12.2049	2.600	(280)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	12.03.2050	6.000	(678)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	28-Day MXN-TIIE	5,660	24.03.2023	MXN 3.650.000	(1.459)	(0,04)
Zahlung	UKRPI	3,579	15.10.2033	£ 19.400	1.127	0,03
Zahlung	UKRPI	3,596	15.05.2034	6.900	267	0,01
					\$ (28.968)	(0,77)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (32.978)	(0,87)

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.
- (2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,023 %	29.06.2023	17.500	\$ 931	\$ 856	0,02
MYC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	29.09.2021	78.200	1.721	350	0,01
							\$ 2.652	\$ 1.206	0,03

Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Bond Fund (Forts.)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 100,156	05.08.2021	2.300	\$ 21	\$ 7	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	2.300	22	9	0,00
					\$ 43	\$ 16	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	4.200	\$ (19)	\$ (12)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	6.400	(6)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	3.500	(4)	0	0,00
BPS	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	2.000	(2)	0	0,00
BRC	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	5.300	(4)	(4)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	5.300	(7)	(2)	0,00
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	12.200	(7)	(8)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	12.200	(16)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	10.000	(10)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	7.100	(8)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	8.800	(10)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	30.400	(31)	(18)	0,00
CBK	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	4.600	(21)	(13)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	9.700	(10)	(2)	0,00
DUB	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	9.100	(7)	(7)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	9.100	(11)	(3)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	19.600	(20)	(5)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	12.900	(14)	(3)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	11.400	(12)	(2)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	20.10.2021	4.800	(28)	(20)	0,00
	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	3.700	(3)	(3)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	7.600	(8)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	9.600	(9)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	7.700	(8)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	14.800	(16)	(4)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	3.300	(3)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	8.700	(9)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	2.800	(3)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	12.800	(14)	(8)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	22.200	(23)	(13)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	9.200	(12)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	8.700	(9)	(1)	0,00
JPM	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	5.500	(7)	(4)	0,00
MYC	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	1.500	(4)	0	0,00
						\$ (375)	\$ (143)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021 %	29.06.2023	85.800	\$ (931)	\$ (876)	(0,03)
MYC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	1.700	(13)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	78.200	(622)	(49)	0,00
							\$ (1.566)	\$ (925)	(0,03)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	\$ 102,297	05.08.2021	6.600	\$ (23)	\$ (9)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,797	05.08.2021	6.600	(20)	(8)	0,00
GSC	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,367	05.08.2021	6.000	(20)	(17)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,023	07.09.2021	7.100	(44)	(26)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,102	07.09.2021	1.000	(7)	(4)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,023	07.09.2021	7.100	(31)	(39)	(0,01)
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,102	07.09.2021	1.000	(5)	(5)	0,00
JPM	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	12.08.2021	6.100	(19)	(10)	0,00
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	3.900	(13)	(7)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	4.600	(29)	(7)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	4.600	(29)	(9)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	\$ 102,234	05.08.2021	11.800	\$ (37)	\$ (16)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	5.000	(15)	(12)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,375	07.07.2021	3.000	(13)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,609	07.07.2021	5.100	(21)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,375	07.07.2021	3.000	(8)	(3)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,547	07.07.2021	3.000	(7)	(2)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,645	07.07.2021	8.200	(27)	(3)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,188	05.08.2021	2.500	(8)	(4)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,406	05.08.2021	4.800	(21)	(9)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,688	05.08.2021	4.500	(14)	(10)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,188	05.08.2021	2.500	(4)	(9)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,406	05.08.2021	4.800	(11)	(13)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,703	05.08.2021	2.700	(5)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,801	05.08.2021	7.000	(31)	(7)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,586	05.08.2021	3.000	(11)	(6)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,609	05.08.2021	8.900	(28)	(17)	0,00
					\$ (501)	\$ (255)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.12.2021	\$ 100	\$ (4)	\$ 4	\$ 0	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	100	(6)	7	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(2)	1	(1)	0,00
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(3)	4	1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.000	4	(4)	0	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	400	(6)	3	(3)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2023	2.700	(11)	31	20	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.600	(24)	33	9	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	15.500	(686)	598	(88)	0,00
HUS	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(37)	16	(21)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(6)	7	1	0,00
JPM	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.700	(50)	50	0	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(12)	12	0	0,00
MYC	California State General Obligation Bonds, Series 2003	1,000	20.09.2024	2.900	23	52	75	0,00
					\$ (820)	\$ 814	\$ (6)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 800	\$ (24)	\$ 32	\$ 8	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	11.000	(379)	493	114	0,01
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	10.900	(378)	491	113	0,00
					\$ (781)	\$ 1.016	\$ 235	0,01

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Bond Fund (Forts.)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	07.2021	MXN	19.086	\$	966	\$	9	0,00		
	07.2021	\$	7.205	AUD	9.568		0	0,00		
	08.2021	AUD	9.568	\$	7.206		(22)	0,00		
	08.2021	\$	807	RUB	60.703		21	0,00		
	09.2021		9	PLN	33		18	0,00		
BPS	09.2021		1.599	RUB	116.642		0	0,00		
	07.2021	AUD	37.864	\$	29.426		999	0,03		
	07.2021	DKK	1.985		317		1	0,00		
	07.2021	€	13.098		15.772		239	0,01		
	07.2021	£	4.559		6.417		119	0,00		
	07.2021	¥	245.260		2.242		33	0,00		
	07.2021	\$	1.127	£	811		0	0,00		
	08.2021	PEN	1.584	\$	429		14	0,00		
	11.2021	MXN	153.214		7.590		22	0,00		
	BRC	07.2021	€	5.510		6.712		177	0,01	
07.2021		\$	2.503	€	2.055		0	0,00		
CBK	09.2021		6	PLN	22		0	0,00		
	07.2021	BRL	20.051	\$	3.980		0	0,00		
	07.2021	DKK	1.781		282		0	0,00		
	07.2021	MXN	18.255		883		0	0,00		
	07.2021	PEN	23.224		6.339		271	0,01		
	07.2021	\$	600	RUB	46.330		33	0,00		
	08.2021	PEN	48.128	\$	12.830		249	0,01		
	08.2021	\$	736	RUB	55.340		16	0,00		
	09.2021	PEN	21.486	\$	5.723		98	0,00		
	09.2021	\$	4.689	CLP	3.356.347		0	0,00		
GLM	09.2021	ZAR	558.823	\$	40.633		1.867	0,05		
	02.2022	PEN	14.136		3.719		25	0,00		
	06.2022	ILS	44.396		13.707		5	0,00		
	07.2021	£	142.113		200.909		5	0,00		
	07.2021	\$	1.203	RUB	92.871		65	0,00		
	08.2021		1.032		77.306		19	0,00		
	09.2021	HKD	7.300	\$	941		1	0,00		
	09.2021	TWD	5.215		190		2	0,00		
	09.2021	\$	9	PLN	35		0	0,00		
	09.2021	ZAR	270.798	\$	19.673		886	0,02		
HUS	07.2021	€	27.372		32.683		223	0,01		
	07.2021	\$	205.500	£	148.475		0	0,00		
	08.2021	£	148.475	\$	205.517		388	0,01		
	08.2021	\$	1.659	RUB	124.881		39	0,00		
	09.2021	CNH	484.765	\$	75.431		773	0,02		
	09.2021	KRW	360.142		323		5	0,00		
	09.2021	\$	10	PLN	40		0	0,00		
	09.2021		839	RUB	61.414		0	0,00		
	10.2021	PEN	16.230	\$	4.392		144	0,00		
	12.2021		16.803		4.564		169	0,01		
IND	09.2021	\$	5.222	CLP	3.770.655		0	0,00		
	07.2021	ILS	485	\$	149		0	0,00		
JPM	08.2021	\$	18.722	COP	68.383.709		0	0,00		
	11.2021	CLP	7.141.845	\$	9.871		101	0,00		
	11.2021	ILS	20.206		6.241		26	0,00		
	07.2021	BRL	109.479		21.709		0	0,00		
	07.2021	€	2.375		2.832		16	0,00		
MYI	07.2021	£	1.639		2.275		11	0,00		
	07.2021	\$	5.357	AUD	7.083		0	0,00		
	07.2021		1.325	£	958		0	0,00		
	07.2021		36	NOK	312		0	0,00		
	07.2021		595	RUB	45.594		27	0,00		
	08.2021	AUD	7.083	\$	5.358		40	0,00		
	08.2021	\$	21.640	BRL	109.479		106	0,00		
	09.2021		3.274	ZAR	46.940		0	0,00		
	07.2021	£	397	\$	560		11	0,00		
	07.2021	€	377.836		462.227		14.150	0,37		
SCX	07.2021	£	1.644		2.324		53	0,00		
	07.2021	PEN	8.507		2.261		40	0,00		
	07.2021	\$	3.279	PEN	13.051		130	0,00		
	09.2021	PEN	13.051	\$	3.282		0	0,00		
	12.2021	\$	1.189	INR	89.266		0	0,00		
SOG	07.2021		681	RUB	52.920		41	0,00		
	08.2021		920		69.400		23	0,00		
	07.2021		24.268	BRL	129.530		1.545	0,04		
TOR	07.2021	CAD	14.492	\$	11.995		292	0,01		
UAG	07.2021	AUD	13.120		10.170		320	0,01		
	07.2021	\$	26.043	AUD	34.333		0	0,00		
	07.2021		1.955	RUB	149.918		92	0,00		
	08.2021	AUD	34.333	\$	26.047		267	0,01		
	09.2021	\$	827	RUB	60.675		0	0,00		
				\$	28.808	\$	(1.768)	\$	27.040	0,72

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	AUD 12.018	\$ 9.050	\$ 27	\$ 0	\$ 27	0,00
	07.2021	\$ 9.203	AUD 11.914	0	(259)	(259)	(0,01)
	08.2021	9.051	12.018	0	(27)	(27)	0,00
BPS	07.2021	6.823	8.780	0	(232)	(232)	(0,01)
BRC	07.2021	48	63	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2021	53	69	0	(2)	(2)	0,00
GLM	07.2021	42	55	0	(1)	(1)	0,00
HUS	07.2021	AUD 21	\$ 16	1	0	1	0,00
MYI	07.2021	5.156	3.900	29	0	29	0,00
	07.2021	\$ 84	AUD 111	0	(1)	(1)	0,00
RBC	08.2021	3.856	5.096	0	(29)	(29)	0,00
	07.2021	AUD 32	\$ 25	1	0	1	0,00
SCX	07.2021	49	37	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 298	AUD 385	0	(9)	(9)	0,00
SSB	07.2021	AUD 171	\$ 132	4	0	4	0,00
TOR	07.2021	\$ 2.335	AUD 3.017	0	(70)	(70)	0,00
UAG	07.2021	AUD 8.068	\$ 6.120	63	0	63	0,01
	07.2021	\$ 9.172	AUD 11.833	0	(289)	(289)	(0,01)
	08.2021	6.121	8.068	0	(63)	(63)	0,00
				\$ 126	\$ (983)	\$ (857)	(0,02)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	CAD 5.678	\$ 4.586	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	08.2021	\$ 4.586	CAD 5.678	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07.2021	4.746	5.734	0	(116)	(116)	(0,01)
CBK	07.2021	CAD 5.704	\$ 4.638	32	0	32	0,00
	08.2021	\$ 4.638	CAD 5.704	0	(32)	(32)	0,00
HUS	07.2021	3.019	3.650	0	(72)	(72)	0,00
JPM	07.2021	4.708	5.700	0	(105)	(105)	0,00
SCX	07.2021	1.657	2.003	0	(39)	(39)	0,00
				\$ 33	\$ (365)	\$ (332)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 35.485	CHF 31.832	\$ 0	\$ (1.047)	\$ (1.047)	(0,03)
BPS	07.2021	1.089	1.000	0	(7)	(7)	0,00
BRC	07.2021	159	143	0	(4)	(4)	0,00
CBK	07.2021	CHF 32.125	\$ 34.895	141	0	141	0,00
	07.2021	\$ 35.560	CHF 31.884	0	(1.067)	(1.067)	(0,03)
	08.2021	34.924	32.125	0	(141)	(141)	0,00
GLM	07.2021	CHF 20	\$ 22	1	0	1	0,00
MYI	07.2021	\$ 34.940	CHF 31.480	0	(884)	(884)	(0,02)
UAG	07.2021	CHF 14	\$ 16	0	0	0	0,00
				\$ 142	\$ (3.150)	\$ (3.008)	(0,08)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und G Retail EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 1.053	€ 868	\$ 0	\$ (24)	\$ (24)	0,00
BPS	07.2021	€ 9.449	\$ 11.322	116	0	116	0,00
	07.2021	\$ 290.852	€ 237.910	0	(8.714)	(8.714)	(0,23)
BRC	07.2021	€ 3.140	\$ 3.825	101	0	101	0,00
GLM	07.2021	\$ 893	€ 737	0	(19)	(19)	0,00
HUS	07.2021	€ 3.226	\$ 3.902	76	0	76	0,00
	07.2021	\$ 24.477	€ 20.437	0	(241)	(241)	(0,01)
MYI	07.2021	2.589	2.174	0	(10)	(10)	0,00
SCX	07.2021	329.426	269.280	0	(10.088)	(10.088)	(0,27)
	07.2021	329.163	269.064	0	(10.081)	(10.081)	(0,26)
				\$ 293	\$ (29.177)	\$ (28.884)	(0,77)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	\$ 4.601	£ 3.280	\$ 0	\$ (70)	\$ (70)	0,00
BRC	07.2021	3.342	2.375	0	(60)	(60)	0,00
GLM	07.2021	546.501	386.568	0	(12.477)	(12.477)	(0,33)
HUS	07.2021	£ 427.726	\$ 592.005	1.122	0	1.122	0,03
	07.2021	\$ 8.354	£ 5.895	0	(210)	(210)	(0,01)
	08.2021	592.052	427.726	0	(1.118)	(1.118)	(0,03)
MYI	07.2021	3.813	2.734	0	(36)	(36)	0,00
RYL	07.2021	68.700	48.740	0	(1.368)	(1.368)	(0,04)
SCX	07.2021	885	626	0	(20)	(20)	0,00
SSB	07.2021	£ 427.726	\$ 591.086	203	0	203	0,01
	07.2021	\$ 542.969	£ 383.189	0	(13.611)	(13.611)	(0,36)
	08.2021	591.133	427.726	0	(198)	(198)	(0,01)
UAG	07.2021	547.716	386.568	0	(13.691)	(13.691)	(0,36)
				\$ 1.325	\$ (42.859)	\$ (41.534)	(1,10)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	NOK 48.763	\$ 5.688	\$ 21	\$ 0	\$ 21	0,00
	08.2021	\$ 5.689	NOK 48.763	0	(21)	(21)	0,00
CBK	07.2021	5.556	46.408	0	(163)	(163)	0,00
HUS	07.2021	NOK 8	\$ 1	0	0	0	0,00
MYI	07.2021	48	6	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 5.603	NOK 46.724	0	(173)	(173)	(0,01)
SCX	07.2021	0	-1	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	5.469	45.678	0	(161)	(161)	0,00
				\$ 21	\$ (518)	\$ (497)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SEK 171	\$ 20	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2021	33	4	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 22.118	SEK 183.358	0	(678)	(678)	(0,02)
BRC	07.2021	25.727	213.275	0	(789)	(789)	(0,02)
GLM	07.2021	SEK 144	\$ 17	1	0	1	0,00
HUS	07.2021	11	1	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 1	SEK 5	0	0	0	0,00
RBC	07.2021	25.727	213.275	0	(788)	(788)	(0,02)
SCX	07.2021	SEK 35	\$ 4	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	33	4	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 1	SEK 9	0	0	0	0,00
	08.2021	15	128	0	0	0	0,00
				\$ 1	\$ (2.255)	\$ (2.254)	(0,06)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (50.198) (1,33)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 35.400	\$ (35.677)	(0,94)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (35.677)	(0,94)
Summe Anlagen		\$ 3.614.032	95,59
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 166.773	4,41
Nettovermögen		\$ 3.780.805	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
 (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
 (e) Nullkuponwertpapier.
 (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
 (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
 (i) Mit dem Fonds verbunden.
 (j) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (k) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	0,898 %	28.05.2024	25.05.2021	\$ 1.900	\$ 1.892	0,05
Deutsche Bank AG	3,035	28.05.2032	25.05.2021	800	815	0,02
Sunac China Holdings Ltd.	5,950	30.12.2021	11.01.2021	6.299	6.304	0,17
				\$ 8.999	\$ 9.011	0,24

- (l) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 4.861 als Sicherheiten verpfändet.
 (m) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.300 und Barmittel in Höhe von USD 46.033 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 48.838 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.861.768	\$ 6.633	\$ 2.868.401
Investmentfonds	238.056	134.882	0	372.938
Pensionsgeschäfte	0	498.300	0	498.300
Finanzderivate ⁽³⁾	1.462	(91.392)	0	(89.930)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(35.677)	0	(35.677)
Summen	\$ 239.518	\$ 3.367.881	\$ 6.633	\$ 3.614.032

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.984.607	\$ 54	\$ 3.984.661
Investmentfonds	175.302	135.066	0	310.368
Pensionsgeschäfte	0	49.813	0	49.813
Finanzderivate ⁽³⁾	3.048	(10.139)	(9)	(7.100)
Summen	\$ 178.350	\$ 4.159.347	\$ 45	\$ 4.337.742

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	(1,400) %	28.04.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (666)	\$ (788)	(0,02)
	(1,400)	05.05.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.980)	(2.343)	(0,06)
	(1,250)	22.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.383)	(1.636)	(0,05)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (4.767)	(0,13)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (1.356)	\$ 1.200	\$ (156)
BPS	(8.280)	7.280	(1.000)
BRC	(679)	570	(109)
CBK	1.163	(1.810)	(647)
DUB	(20)	(40)	(60)
FAR	(17)	0	(17)
FBF	(31)	0	(31)
GLM	(6.951)	5.946	(1.005)
GSC	(91)	0	(91)
GST	(98)	150	52
HUS	904	(1.300)	(396)
IND	(53)	0	(53)
JPM	(472)	350	(122)
MYC	490	(1.359)	(869)
MYI	(1.073)	660	(413)
RBC	(787)	540	(247)
RYL	(1.357)	1.251	(106)
SAL	(86)	290	204
SCX	4.071	(3.600)	471
SOG	64	0	64
SSB	(12.218)	10.404	(1.814)
TOR	(9.859)	8.640	(1.219)
UAG	(13.462)	12.052	(1.410)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	43,79	50,67
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	29,37	71,04
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,71	2,62
Investmentfonds	9,86	9,68
Pensionsgeschäfte	13,18	1,55
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,18)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,87)	(1,59)
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,33)	1,28
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,94)	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,13)	(6,42)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,59	1,45
Unternehmensanleihen und Wechsel	28,34	29,52
Wandelanleihen & Wechsel	0,48	0,55
Kommunalanleihen und Wechsel	0,32	0,37
US-Regierungsbehörden	2,26	34,50
US-Schatzobligationen	12,19	23,64
Non-Agency-MBS	6,50	8,10
Forderungsbesicherte Wertpapiere	14,92	16,88
Staatsemissionen	7,96	8,67
Stammaktien	0,02	0,03
Vorzugswertpapiere	0,26	0,29
Kurzfristige Instrumente	1,03	0,33
Investmentfonds	9,86	9,68
Pensionsgeschäfte	13,18	1,55
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,18)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,10)	(0,33)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,77)	(1,26)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,03	0,03
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,03)	(0,01)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,01
Devisenterminkontrakte	0,72	(0,44)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,05)	1,70
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,94)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	4,41	(35,35)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				BANKEN UND FINANZEN			
ABN AMRO Bank NV 0,000 % fällig am 03.12.2021	€ 5.200	€ 5.212	0,07	RCI Banque S.A. 0,125 % fällig am 14.03.2022	€ 1.200	€ 1.204	0,02	Canada Square Funding PLC 1,149 % fällig am 17.10.2051	€ 3.548	€ 4.155	0,06
Ally Financial, Inc. 4,125 % fällig am 13.02.2022	\$ 100	86	0,00	0,750 % fällig am 12.01.2022	4.000	4.012	0,05	Citigroup Mortgage Loan Trust 3,234 % fällig am 25.09.2037 ^	\$ 74	62	0,00
Atrium European Real Estate Ltd. 3,625 % fällig am 17.10.2022	€ 3.500	3.622	0,05	Realcredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.01.2022	DKK30.000	4.064	0,06	Countrywide Alternative Loan Trust 0,252 % fällig am 25.02.2047	79	62	0,00
Banco Santander S.A. 1,375 % fällig am 09.02.2022	900	910	0,01	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,750 % fällig am 14.01.2025	€ 200	210	0,00	0,692 % fällig am 25.08.2035	881	715	0,01
Bank of America Corp. 0,161 % fällig am 25.04.2024	4.500	4.530	0,06	Societe Generale S.A. 0,000 % fällig am 27.05.2022 (c)	5.000	5.022	0,07	0,733 % fällig am 20.12.2035	131	105	0,00
Barclays PLC 1,500 % fällig am 03.09.2023	7.000	7.259	0,10	Stichting AK Rabobank Certificaten 2,188 % (e)	1.051	1.417	0,02	3,288 % fällig am 25.06.2037 ^	939	729	0,01
7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(g)	\$ 600	557	0,01	UBS AG 7,625 % fällig am 17.08.2022 (g)	\$ 250	227	0,00	6,000 % fällig am 25.01.2037	312	212	0,00
7,875 % fällig am 15.03.2022 (e)(g)	200	176	0,00	UBS Group AG 0,157 % fällig am 20.09.2022	€ 800	801	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2037	118	68	0,00
7,875 % fällig am 15.09.2022 (e)(g)	€ 200	250	0,00	Vesteda Finance BV 2,500 % fällig am 27.10.2022	100	103	0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates 0,572 % fällig am 25.04.2036 ^	397	309	0,00
Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 1,400 % fällig am 06.07.2022	€ 3.800	3.842	0,05	Volkswagen Bank GmbH 0,154 % fällig am 08.12.2021	900	902	0,01	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0,672 % fällig am 25.04.2035	2.278	1.824	0,02
CaixaBank S.A. 6,000 % fällig am 18.07.2022 (e)(g)	200	209	0,00	0,934 % fällig am 01.08.2022	400	405	0,01	0,692 % fällig am 25.05.2035	190	136	0,00
ajamar Caja Rural SCC 0,875 % fällig am 18.06.2023	1.700	1.740	0,02	Volkswagen Financial Services AG 0,625 % fällig am 01.04.2022	1.000	1.007	0,01	3,093 % fällig am 25.11.2037	102	85	0,00
Castellum AB 2,125 % fällig am 20.11.2023	2.600	2.728	0,04	Volkswagen Leasing GmbH 0,000 % fällig am 06.07.2021	2.100	2.100	0,03	6,000 % fällig am 25.07.2036	85	54	0,00
Commerzbank AG 0,125 % fällig am 09.01.2024	5.500	5.580	0,08	0,000 % fällig am 12.07.2023 (c)	9.000	9.015	0,12	6,500 % fällig am 25.12.2037	100	53	0,00
Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	\$ 200	187	0,00	INDUSTRIEWERTE				Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 4,767 % fällig am 25.01.2034 ^	770	652	0,01
Credit Suisse Group AG 7,500 % fällig am 17.07.2023 (e)(g)	200	184	0,00	Apple, Inc. 0,510 % fällig am 11.05.2022	\$ 7.000	5.919	0,08	Dilosk RMBS DAC 0,213 % fällig am 20.10.2057	€ 407	408	0,01
Dexia Credit Local S.A. 0,250 % fällig am 01.06.2023	€ 8.100	8.214	0,11	Bayer Capital Corp. BV 0,012 % fällig am 26.06.2022	€ 5.000	5.018	0,07	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 0,283 % fällig am 19.10.2036	\$ 112	85	0,00
Digital Dutch Finco BV 0,125 % fällig am 15.10.2022	100	100	0,00	BMW Finance NV 0,250 % fällig am 14.01.2022	800	803	0,01	FWD Securitization Trust 2,240 % fällig am 25.01.2050	312	267	0,00
Digital Euro Finco LLC 2,500 % fällig am 16.01.2026	900	990	0,01	0,625 % fällig am 06.10.2023	900	918	0,01	GreenPoint Mortgage Funding Trust 0,332 % fällig am 25.10.2045	1.391	1.175	0,02
DNB Boligkredit A/S 0,375 % fällig am 14.11.2023	3.800	3.874	0,05	Expedia Group, Inc. 6,250 % fällig am 01.05.2025	\$ 200	196	0,00	GSMPS Mortgage Loan Trust 0,442 % fällig am 25.03.2035	2.605	2.059	0,03
Fastighets AB Balder 1,125 % fällig am 14.03.2022	200	201	0,00	Herens Holdco SARL 4,750 % fällig am 15.05.2028	700	588	0,01	HarborView Mortgage Loan Trust 0,298 % fällig am 19.12.2036	625	496	0,01
First Abu Dhabi Bank PJSC 1,134 % fällig am 16.04.2022	\$ 5.000	4.236	0,06	Hyundai Capital America 0,800 % fällig am 03.04.2023	10.800	9.109	0,12	2,116 % fällig am 19.10.2035	99	59	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 01.12.2021	€ 100	100	0,00	Medtronic Global Holdings S.C.A. 0,375 % fällig am 07.03.2023	€ 300	304	0,00	Impac CMB Trust 0,732 % fällig am 25.03.2035	82	68	0,00
0,000 % fällig am 07.12.2022	800	796	0,01	Origin Energy Finance Ltd. 3,500 % fällig am 04.10.2021	1.500	1.515	0,02	IndyMac Mortgage Loan Trust 0,272 % fällig am 25.02.2037 ^	103	86	0,00
General Motors Financial Co., Inc. 0,012 % fällig am 26.03.2022	400	401	0,01	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875 % fällig am 15.01.2026	500	554	0,01	0,672 % fällig am 25.01.2036	618	420	0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 0,084 % fällig am 09.09.2022	4.500	4.504	0,06	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				3,083 % fällig am 25.06.2036	2.295	1.793	0,02
IMMOFINANZ AG 2,625 % fällig am 27.01.2023	1.700	1.754	0,02	Contemporary Ruiding Development Ltd. 1,875 % fällig am 17.09.2025	\$ 4.800	4.068	0,06	3,166 % fällig am 25.08.2037	3.295	2.214	0,03
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,500 % fällig am 15.09.2027	10.000	10.480	0,14	IE2 Holdco S.A.U. 2,375 % fällig am 27.11.2023	€ 300	315	0,00	Lehman XS Trust 0,342 % fällig am 25.08.2037	3.098	2.540	0,03
LeasePlan Corp. NV 0,125 % fällig am 13.09.2023	300	302	0,01	Optus Finance Pty. Ltd. 1,000 % fällig am 20.06.2029	700	726	0,01	Mortgage Equity Conversion Asset Trust 0,580 % fällig am 25.05.2042	154	125	0,00
1,000 % fällig am 02.05.2023	3.300	3.373	0,05	Sprint Communications, Inc. 6,000 % fällig am 15.11.2022	\$ 100	89	0,00	New Residential Mortgage Loan Trust 4,500 % fällig am 25.05.2058	619	567	0,01
Logicor Financing SARL 1,500 % fällig am 14.11.2022	2.800	2.852	0,04	SUMME UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Residential Accredit Loans, Inc. Trust 1,023 % fällig am 25.10.2037	437	356	0,01
Merlin Properties Socimi S.A. 2,375 % fällig am 23.05.2022	300	305	0,01					6,500 % fällig am 25.07.2036	125	103	0,00
Nasdaq, Inc. 3,850 % fällig am 30.06.2026	\$ 100	94	0,00	NON-AGENCY-MBS				Towd Point Mortgage Funding PLC 0,949 % fällig am 20.07.2045	€ 4.313	5.042	0,07
Natwest Group PLC 2,000 % fällig am 04.03.2025	€ 7.000	7.363	0,10	Adjustable Rate Mortgage Trust 2,706 % fällig am 25.04.2035	43	37	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,892 % fällig am 25.06.2044	\$ 471	392	0,01
2,500 % fällig am 22.03.2023	3.000	3.136	0,04	American Home Mortgage Assets Trust 6,750 % fällig am 25.11.2046	80	65	0,00	1,843 % fällig am 25.08.2046	10.018	8.287	0,11
NatWest Markets PLC 0,362 % fällig am 27.09.2021	2.900	2.906	0,04	BCAP LLC Trust 1,392 % fällig am 25.09.2047	236	197	0,00	3,143 % fällig am 25.02.2037 ^	59	50	0,00
Nykredit Realkredit A/S 0,026 % fällig am 02.06.2022	2.800	2.811	0,04	4,824 % fällig am 26.03.2037	594	505	0,01	Accredited Mortgage Loan Trust 0,672 % fällig am 25.09.2035	2.800	2.327	0,03
PKO Bank Hipoteczny S.A. 0,250 % fällig am 23.11.2021	800	802	0,01	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,293 % fällig am 25.07.2036 ^	555	441	0,01	Accunia European CLO DAC 0,930 % fällig am 15.10.2030	€ 1.100	1.099	0,02
QNB Finance Ltd. 1,176 % fällig am 02.05.2022	\$ 5.000	4.237	0,06	Bear Stearns ALT-A Trust 1,817 % fällig am 25.07.2034	840	749	0,01	0,950 % fällig am 15.07.2030	1.400	1.401	0,02
				3,105 % fällig am 25.09.2047 ^	6.192	3.505	0,05	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,242 % fällig am 25.07.2036	\$ 249	101	0,00
								0,392 % fällig am 25.04.2036	438	364	0,01
								Adagio CLO DAC 0,720 % fällig am 15.10.2031	€ 2.500	2.497	0,03
								ALME Loan Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2031	595	594	0,01
								Aqueduct European CLO DAC 0,640 % fällig am 20.07.2030	3.900	3.906	0,05
								Ares European CLO DAC 0,660 % fällig am 15.10.2030	3.000	2.998	0,04
								0,780 % fällig am 15.10.2031	6.400	6.400	0,09

Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Armada Euro CLO DAC 0,720 % fällig am 15.07.2031	€ 6.300	€ 6.288	0,09	FCT Titrisocram 0,000 % fällig am 25.07.2036	€ 102	€ 102	0,00	Segovia European CLO DAC 0,880 % fällig am 20.07.2032 (a)	€ 4.100	€ 4.100	0,06
Asset-Backed European Securitisation Transaction 0,000 % fällig am 21.12.2028	778	780	0,01	First Franklin Mortgage Loan Trust 0,797 % fällig am 25.11.2036	\$ 10.000	8.305	0,11	Silver Arrow S.A. 0,000 % fällig am 16.03.2026	275	275	0,00
Aurium CLO DAC 0,670 % fällig am 16.04.2030 0,680 % fällig am 13.10.2029	600 445	600 445	0,01 0,01	Fremont Home Loan Trust 0,232 % fällig am 25.01.2037	472	266	0,00	0,149 % fällig am 15.09.2027	880	887	0,01
Babson Euro CLO BV 0,281 % fällig am 25.10.2029	199	199	0,00	Griffith Park CLO DAC 0,720 % fällig am 21.11.2031	€ 16.100	16.040	0,22	Soundview Home Loan Trust 0,242 % fällig am 25.03.2037	\$ 87	71	0,00
Bain Capital Euro DAC 0,740 % fällig am 20.01.2032	2.900	2.897	0,04	Grosvenor Place CLO BV 0,720 % fällig am 30.10.2029	458	459	0,01	0,262 % fällig am 25.07.2037 0,262 % fällig am 25.08.2037	998 1.076	784 843	0,01 0,01
Barings Euro CLO BV 0,680 % fällig am 27.07.2030	379	379	0,01	GSAA Home Equity Trust 0,192 % fällig am 25.12.2046 5,985 % fällig am 25.06.2036	\$ 1.248 1.259	661 449	0,01 0,01	0,342 % fällig am 25.10.2036 0,992 % fällig am 25.10.2037	200 2.442	164 1.818	0,00 0,02
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 1,142 % fällig am 25.08.2037	\$ 210	168	0,00	Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029 0,640 % fällig am 15.10.2031	€ 287 4.400	287 4.397	0,00 0,06	St Paul's CLO DAC 0,850 % fällig am 25.04.2030	€ 700	701	0,01
Black Diamond CLO DAC 0,650 % fällig am 03.10.2029 0,860 % fällig am 15.01.2032	€ 470 2.000	470 2.001	0,01 0,03	Invesco Euro CLO DAC 0,650 % fällig am 15.07.2031	500	498	0,01	Tikehau CLO BV 0,600 % fällig am 04.08.2028 0,880 % fällig am 07.12.2029	192 1.189	192 1.190	0,00 0,02
Blackrock European CLO DAC 0,620 % fällig am 15.10.2031	5.000	4.978	0,07	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,302 % fällig am 25.10.2036 0,392 % fällig am 25.03.2037	\$ 224 16.300	186 13.284	0,00 0,18	Toro European CLO DAC 0,650 % fällig am 15.04.2030 0,900 % fällig am 15.10.2030	1.600 4.895	1.600 4.902	0,02 0,07
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 0,650 % fällig am 15.07.2030 0,720 % fällig am 15.01.2031 0,910 % fällig am 15.01.2033 1,050 % fällig am 15.01.2031	2.100 3.100 1.000 400	2.105 3.096 994 400	0,03 0,04 0,01 0,01	Jubilee CLO BV 0,252 % fällig am 15.12.2029 0,295 % fällig am 12.07.2028 0,600 % fällig am 15.04.2030 0,610 % fällig am 15.04.2030 0,650 % fällig am 15.04.2031	€ 690 474 1.400 3.800 4.300	688 474 1.397 3.799 4.291	0,01 0,01 0,02 0,05 0,06	Tymon Park CLO DAC 0,590 % fällig am 21.01.2029	133	134	0,00
BNPP AM Euro CLO BV 0,600 % fällig am 15.04.2031 0,650 % fällig am 15.10.2031	300 250	300 249	0,00 0,00	Man GLG Euro CLO DAC 0,680 % fällig am 15.10.2030 0,690 % fällig am 15.12.2031 0,870 % fällig am 15.01.2030	2.300 4.400 999	2.304 4.408 999	0,03 0,06 0,01	VCL Multi-Compartment S.A. 0,000 % fällig am 21.01.2025	152	152	0,00
Cairn CLO BV 0,600 % fällig am 30.04.2031 0,650 % fällig am 20.10.2028 0,670 % fällig am 31.01.2030 0,780 % fällig am 15.10.2031 0,790 % fällig am 25.07.2029	3.700 327 700 3.700 3.471	3.691 328 700 3.700 3.475	0,05 0,00 0,01 0,05 0,05	Marlay Park CLO DAC 0,740 % fällig am 15.10.2030	1.000	996	0,01	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 1,142 % fällig am 25.10.2034	\$ 160	135	0,00
Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC 0,680 % fällig am 16.09.2025	£ 1.926	2.250	0,03	MASTR Asset-Backed Securities Trust 0,872 % fällig am 25.02.2034	\$ 1.590	1.321	0,02				
Carlyle Euro CLO DAC 0,630 % fällig am 15.08.2030 0,700 % fällig am 15.01.2031	€ 200 5.000	200 5.000	0,00 0,07	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,342 % fällig am 25.07.2036 0,392 % fällig am 25.07.2036	174 288	131 125	0,00 0,00	STAATSEMISSIONEN			
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,750 % fällig am 15.11.2031	3.650	3.634	0,05	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 0,192 % fällig am 25.04.2037	122	68	0,00	Cyprus Government International Bond 3,750 % fällig am 26.07.2023 3,875 % fällig am 06.05.2022	€ 1.400 7.300	1.523 7.568	0,02 0,10
Carrington Mortgage Loan Trust 0,492 % fällig am 25.01.2036	\$ 13.500	11.168	0,15	North Westerly CLO BV 0,910 % fällig am 20.04.2031	€ 1.300	1.301	0,02	France Government International Bond 3,250 % fällig am 25.10.2021	25.000	25.310	0,34
CIT Mortgage Loan Trust 1,592 % fällig am 25.10.2037	400	343	0,00	NovaStar Mortgage Funding Trust 0,292 % fällig am 25.09.2037	\$ 215	178	0,00	Iceland Government International Bond 0,500 % fällig am 20.12.2022	2.500	2.525	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust 4,372 % fällig am 25.10.2037 7,250 % fällig am 25.05.2036	984 133	823 80	0,01 0,00	OAK Hill European Credit Partners DAC 0,720 % fällig am 21.02.2030 0,730 % fällig am 20.01.2032 0,740 % fällig am 20.10.2031	€ 1.773 900 8.200	1.776 901 8.189	0,02 0,01 0,11	Indonesia Government International Bond 3,750 % fällig am 14.06.2028	5.400	6.433	0,09
Contego CLO BV 0,369 % fällig am 15.11.2026 0,770 % fällig am 15.10.2030	€ 123 1.000	123 1.000	0,00 0,01	Option One Mortgage Loan Trust 0,232 % fällig am 25.03.2037 0,312 % fällig am 25.04.2037 0,312 % fällig am 25.05.2037	\$ 229 607 436	181 414 273	0,00 0,01 0,00	Israel Government International Bond 0,020 % fällig am 30.11.2021 0,750 % fällig am 31.07.2022 5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS 35.200 30.200 5.800	9.109 7.877 1.550	0,12 0,11 0,02
Contego CLO DAC 0,640 % fällig am 23.01.2030	2.300	2.296	0,03	Pepper Iberia Unsecured DAC 0,000 % fällig am 07.04.2028	360	361	0,01	Stockholms Lans Landsting 0,750 % fällig am 26.02.2025	€ 7.000	7.247	0,10
Countrywide Asset-Backed Certificates 0,232 % fällig am 25.08.2037 0,282 % fällig am 25.11.2037 0,312 % fällig am 25.09.2037 ^ 0,342 % fällig am 25.02.2036 0,962 % fällig am 25.04.2034	\$ 5.244 453 89 150 399	4.380 380 75 123 337	0,06 0,01 0,00 0,00 0,00	Renaissance Home Equity Loan Trust 5,285 % fällig am 25.01.2037 5,545 % fällig am 25.01.2037	\$ 229 336	93 144	0,00 0,00				
CVC Cordatus Loan Fund DAC 0,630 % fällig am 15.09.2031 0,650 % fällig am 21.07.2030 0,650 % fällig am 15.10.2031	€ 2.700 5.000 8.700	2.690 5.003 8.719	0,04 0,07 0,12	Residential Asset Securities Corp. Trust 0,432 % fällig am 25.05.2037	3.000	2.507	0,03				
Driver Espana Five 0,000 % fällig am 21.12.2028	290	291	0,00	Saxon Asset Securities Trust 0,382 % fällig am 25.09.2036	7.500	6.089	0,08	AKTIEN			
Driver Multi-Compartment S.A. 0,000 % fällig am 21.08.2026	877	880	0,01	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 0,737 % fällig am 25.10.2035	1.023	863	0,01	STAMMAKTIE			
Dryden Euro CLO BV 0,660 % fällig am 15.04.2033 0,860 % fällig am 15.05.2034 (a)	5.000 5.900	4.982 5.900	0,07 0,08					KOMMUNIKATIONS-DIENSTE			
Dryden Senior Loan Fund 1,084 % fällig am 15.10.2027	\$ 662	558	0,01					Alphabet, Inc. 'C' (b)	5.550	11.730	0,16
Ellington Loan Acquisition Trust 1,192 % fällig am 25.05.2037	124	105	0,00					Baidu, Inc. SP – ADR (b)	314.800	54.126	0,73
Euro-Galaxy CLO DAC 0,620 % fällig am 24.04.2034	€ 3.700	3.695	0,05					Bilibili, Inc. ADR (b)	181.300	18.627	0,25

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS		
Trip.com Group Ltd. (b)	745.300	22.285	0,30	PowerCell Sweden AB (b)	469.863	10.472	0,14	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	4.080.809	74.115	1,00		
		269.699	3,63	Schneider Electric SE	117.000	15.555	0,21	Teradyne, Inc.	219.500	24.795	0,33		
				Secom Co. Ltd.	61.960	3.986	0,05	Tokyo Electron Ltd.	140.470	51.264	0,69		
				Siemens Gamesa Renewable Energy S.A.	485.200	13.681	0,18	Trimble, Inc. (b)	137.700	9.502	0,13		
GESUNDHEITSWESEN				SITC International Holdings Co. Ltd.	3.787.016	13.342	0,18	United Microelectronics Corp.	23.056.819	36.869	0,50		
3SBio, Inc. (b)	6.142.000	6.403	0,09	SMC Corp.	22.400	11.185	0,15	Velodyne Lidar, Inc. (b)	2.219.100	19.910	0,27		
AbbVie, Inc.	76.300	7.247	0,10	Valmet Oyj	1.169.000	43.052	0,58	Win Semiconductors Corp. (b)	1.115.106	12.658	0,17		
Alexion Pharmaceuticals, Inc. (b)	6.401	992	0,01	Vestas Wind Systems A/S	943.900	31.102	0,42	Xinyi Solar Holdings Ltd.	16.749.790	30.395	0,41		
Alibaba Health Information Technology Ltd. (b)	14.636.200	27.333	0,37	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd. 'H'	18.962.000	24.978	0,34	Zebra Technologies Corp. 'A' (b)	25.000	11.162	0,15		
Amgen, Inc.	36.500	7.502	0,10			465.841	6,27			1.291.701	17,38		
Anthem, Inc.	81.630	26.281	0,35	INFORMATIONSTECHNOLOGIE				BAUSTOFFE					
BeiGene Ltd. (b)	457.400	10.266	0,14	Advantech Co. Ltd.	688.383	7.182	0,10	Barrick Gold Corp.	1.481.300	25.831	0,35		
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	5.866.988	7.145	0,10	Advantest Corp.	378.000	28.646	0,38	Canfor Corp. (b)	962.000	18.578	0,25		
Exelixis, Inc. (b)	391.600	6.017	0,08	Ambarella, Inc. (b)	360.300	32.396	0,44	Freeport-McMoRan, Inc.	1.220.900	38.205	0,52		
Genscript Biotech Corp.	6.344.400	23.331	0,31	ams AG	1.694.600	28.735	0,39	Holmen AB 'B'	930.700	35.474	0,48		
Gilead Sciences, Inc.	130.600	7.583	0,10	ANSYS, Inc. (b)	31.100	9.102	0,12	LG Chem Ltd.	47.100	29.990	0,40		
Halozyme Therapeutics, Inc. (b)	201.800	7.727	0,10	Applied Materials, Inc.	283.500	34.042	0,46	Lundin Mining Corp.	1.198.300	9.123	0,12		
Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd. 'H'	819.400	16.191	0,22	Arista Networks, Inc. (b)	98.000	29.940	0,40	Mondi PLC	2.118.852	46.978	0,63		
Hologic, Inc. (b)	200.000	11.252	0,15	ASML Holding NV	67.600	39.355	0,53	Newmont Corp.	346.700	18.529	0,25		
Humana, Inc.	85.970	32.094	0,43	Automatic Data Processing, Inc.	97.500	16.330	0,22	Nitto Denko Corp.	390.700	24.558	0,33		
Incyte Corp. (b)	213.100	15.118	0,20	Chipbond Technology Corp. (b)	6.930.908	15.126	0,20	Nucor Corp.	85.700	6.932	0,09		
Innovet Biologics, Inc. (b)	804.500	7.912	0,11	Cirrus Logic, Inc. (b)	175.200	12.575	0,17	Reliance Steel & Aluminum Co.	47.700	6.070	0,08		
Legend Biotech Corp. (b)	1.075	37	0,00	Cisco Systems, Inc.	597.810	26.717	0,36	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	258.060	36.432	0,49		
Luye Pharma Group Ltd.	10.210.100	5.657	0,08	Daqo New Energy Corp. (b)	560.300	30.720	0,41	Stora Enso Oyj 'R'	4.354.000	67.053	0,90		
Moderna, Inc. (b)	41.000	8.124	0,11	Delta Electronics, Inc.	1.900.612	17.411	0,23	United States Steel Corp.	306.000	6.193	0,08		
Neurocrine Biosciences, Inc. (b)	86.800	7.123	0,10	Elan Microelectronics Corp. (b)	3.247.109	19.105	0,26	UPM-Kymmene Oyj	2.161.400	69.008	0,93		
New Horizon Health Ltd. (b)	2.700.560	23.208	0,31	Enphase Energy, Inc. (b)	164.800	25.518	0,34	Vale S.A.	425.400	8.182	0,11		
Otsuka Holdings Co. Ltd.	192.700	6.753	0,09	First Solar, Inc. (b)	630.600	48.128	0,65	West Fraser Timber Co. Ltd.	507.500	30.754	0,41		
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (b)	95.600	45.026	0,61	Flat Glass Group Co. Ltd. 'H'	4.721.142	16.392	0,22	Worthington Industries, Inc.	108.400	5.592	0,08		
Seagen, Inc. (b)	56.500	7.522	0,10	Fujitsu Ltd.	96.000	15.160	0,20			483.482	6,50		
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd. 'H'	5.292.500	10.408	0,14	Globalwafers Co. Ltd.	799.309	22.222	0,30	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN					
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co. Ltd. 'H'	1.585.700	10.790	0,15	Hamamatsu Photonics KK	448.500	22.804	0,31	Fortum Oyj	1.135.200	26.411	0,35		
Shionogi & Co. Ltd.	391.250	17.210	0,23	Infinion Technologies AG	606.200	20.564	0,28	Xinyi Energy Holdings Ltd.	30.670.700	15.417	0,21		
United Therapeutics Corp. (b)	49.800	7.534	0,10	Intel Corp.	609.800	28.868	0,39			41.828	0,56		
Vertex Pharmaceuticals, Inc. (b)	170.200	28.938	0,39	JinkoSolar Holding Co. Ltd. (b)	1.087.412	51.368	0,69			3.151.748	42,40		
WuXi AppTec Co. Ltd. 'H'	697.488	13.726	0,18	Lam Research Corp.	62.470	34.277	0,46	REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS					
Wuxi Biologics Cayman, Inc. (b)	909.800	14.045	0,19	Lotes Co. Ltd. (b)	845.004	14.925	0,20	Weyerhaeuser Co.	532.600	15.458	0,21		
		426.495	5,74	Marvell Technology, Inc.	371.000	18.248	0,25						
INDUSTRIEWERTE				MediaTek, Inc.	515.008	14.977	0,20	PARI (000S)					
51job, Inc. (b)	30.616	2.008	0,03	Nanya Technology Corp.	8.240.907	19.859	0,27	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE					
Aker Carbon Capture A/S (b)	10.770.418	20.975	0,28	NetApp, Inc.	408.300	28.170	0,38	KURZFRISTIGE SCHULDTITEL					
AP Moller - Maersk A/S 'B'	16.600	40.303	0,54	Novatek Microelectronics Corp.	899.804	13.561	0,18	Credit Suisse Group Guernsey Ltd.	3.000 % fällig am 12.11.2021	CHF	2.200	2.249	0,03
COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. 'H' (b)	13.858.106	29.359	0,39	Nuance Communications, Inc. (b)	417.800	19.180	0,26	AUSTRALIA TREASURY BILLS					
Daifuku Co. Ltd. (b)	144.600	11.073	0,15	NVIDIA Corp.	18.660	12.589	0,17	(0,010) % fällig am 24.09.2021 (c)(d)	AUD	169.400	107.241	1,44	
Desktop Metal, Inc. 'A' (b)	508.600	4.932	0,07	NXP Semiconductors NV	138.700	24.060	0,32	0,005 % fällig am 24.09.2021 (c)(d)		53.000	33.552	0,45	
Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd. (b)	14.188.312	84.508	1,14	Otsuka Corp.	135.500	5.995	0,08			140.793	1,89		
Generac Holdings, Inc. (b)	48.200	16.874	0,23	Power Integrations, Inc.	191.800	13.272	0,18						
Hitachi Zosen Corp.	3.981.300	21.681	0,29	Realtek Semiconductor Corp. (b)	1.136.407	17.359	0,23						
Kajima Corp.	1.051.100	11.258	0,15	Rohm Co. Ltd.	289.100	22.456	0,30						
Makita Corp.	481.500	19.136	0,26	Samsung Electronics Co. Ltd.	1.078.000	65.073	0,87						
Mitsubishi Electric Corp.	1.657.470	20.309	0,27	Skyworks Solutions, Inc.	168.200	27.197	0,37						
NEL ASA (b)	8.158.100	16.072	0,22	SMA Solar Technology AG	284.023	13.747	0,18						
				SolarEdge Technologies, Inc. (b)	200.400	46.703	0,63						
				Synopsys, Inc. (b)	47.200	10.977	0,15						

Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
FRANCE TREASURY BILLS											
(0,688) % fällig am 20.10.2021 (c)(d)	€ 18.400	€ 18.438	0,25	(0,673) % fällig am 27.10.2021 (c)(d)(h)	€ 26.520	€ 26.577	0,36	(0,104) % fällig am 10.08.2021 (c)(d)	¥13.700.000	€ 104.097	1,40
(0,684) % fällig am 15.09.2021 (c)(d)	25.000	25.033	0,34	(0,658) % fällig am 29.09.2021 (c)(d)	1.660	1.663	0,02	(0,102) % fällig am 13.09.2021 (c)(d)	13.690.000	104.030	1,40
(0,683) % fällig am 15.09.2021 (c)(d)	25.000	25.033	0,34	(0,652) % fällig am 28.07.2021 (c)(d)	25.190	25.202	0,34	(0,102) % fällig am 21.09.2021 (c)(d)	6.000.000	45.595	0,61
(0,675) % fällig am 20.10.2021 (c)(d)	36.000	36.075	0,48	(0,651) % fällig am 28.07.2021 (c)(d)	92.120	92.164	1,24	(0,100) % fällig am 16.08.2021 (c)(d)	13.700.000	104.098	1,40
(0,674) % fällig am 20.10.2021 (c)(d)	27.000	27.056	0,36	(0,651) % fällig am 28.07.2021 (c)(d)	203.130	203.226	2,73	(0,099) % fällig am 26.07.2021 (c)(d)	4.000.000	30.392	0,41
(0,668) % fällig am 20.10.2021 (c)(d)	72.650	72.801	0,98	(0,649) % fällig am 29.09.2021 (c)(d)	41.190	41.257	0,55	(0,098) % fällig am 27.09.2021 (c)(d)	6.000.000	45.596	0,61
(0,667) % fällig am 20.10.2021 (c)(d)	127.190	127.455	1,71	(0,649) % fällig am 29.09.2021 (c)(d)	30.540	30.590	0,41	(0,095) % fällig am 19.07.2021 (c)(d)	11.240.000	85.400	1,15
(0,657) % fällig am 15.09.2021 (c)(d)	25.000	25.033	0,34	(0,647) % fällig am 27.10.2021 (c)(d)(h)	47.130	47.231	0,64	(0,094) % fällig am 12.07.2021 (c)(d)	4.340.000	32.974	0,45
(0,647) % fällig am 21.07.2021 (c)(d)	5.270	5.272	0,07	(0,647) % fällig am 29.09.2021 (c)(d)	42.820	42.890	0,58			658.334	8,86
(0,641) % fällig am 07.07.2021 (c)(d)	25.210	25.212	0,34	(0,646) % fällig am 28.07.2021 (c)(d)	36.930	36.947	0,50	Summe kurzfristige Instrumente		2.896.837	38,97
(0,638) % fällig am 21.07.2021 (c)(d)	84.000	84.029	1,13	(0,644) % fällig am 29.09.2021 (c)(d)	5.250	5.259	0,07	Summe Übertragbare Wertpapiere	€	6.591.005	88,67
(0,637) % fällig am 04.08.2021 (c)(d)	41.250	41.275	0,55	(0,251) % fällig am 29.09.2021 (c)(d)	83.520	83.656	1,13	AKTIEN			
(0,636) % fällig am 04.08.2021 (c)(d)	30.650	30.669	0,41			822.643	11,07	INVESTMENTFONDS			
(0,635) % fällig am 04.08.2021 (c)(d)	47.210	47.238	0,64	ISRAEL TREASURY BILLS				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
(0,633) % fällig am 04.08.2021 (c)(d)	42.500	42.526	0,57	(0,031) % fällig am 02.02.2022 (c)(d)	ILS 26.800	6.935	0,09	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – Income Fund (f)	1.375.302	20.620	0,28
(0,631) % fällig am 07.07.2021 (c)(d)	92.150	92.159	1,24	(0,028) % fällig am 30.11.2021 (c)(d)	42.300	10.948	0,15	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – PIMCO Capital Securities Fund (f)	2.963.774	32.289	0,43
(0,628) % fällig am 07.07.2021 (c)(d)	208.670	208.689	2,81	(0,020) % fällig am 02.02.2022 (c)(d)	20.200	5.227	0,07			52.909	0,71
(0,628) % fällig am 25.08.2021 (c)(d)	106.180	106.283	1,43	0,000 % fällig am 06.04.2022 (c)(d)	110.400	28.567	0,38	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
(0,619) % fällig am 28.07.2021 (c)(d)	167.900	167.979	2,26	0,006 % fällig am 08.06.2022 (c)(d)	33.000	8.539	0,12	PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	3.415.400	339.935	4,58
		1.208.255	16,25	0,011 % fällig am 06.04.2022 (c)(d)	9.700	2.510	0,03	PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (f)	1.532.400	16.554	0,22
GERMANY TREASURY BILLS				0,023 % fällig am 28.02.2022 (c)(d)	7.100	1.837	0,03			356.489	4,80
(0,682) % fällig am 27.10.2021 (c)(d)(h)	35.700	35.777	0,48			64.563	0,87	Summe Investmentfonds	€	409.398	5,51
(0,677) % fällig am 27.10.2021 (c)(d)(h)	18.370	18.410	0,25	JAPAN TREASURY BILLS							
(0,676) % fällig am 27.10.2021 (c)(d)(h)	72.610	72.766	0,98	(0,105) % fällig am 23.08.2021 (c)(d)	¥13.970.000	106.152	1,43				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrech-nungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettover-mögens
BRC	(1,100) %	30.06.2021	01.07.2021	€ 46.900	France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ (47.484)	€ 46.900	€ 46.899	0,62
	(0,480)	30.06.2021	01.07.2021	11.000	BPCE 0,000 % fällig am 17.08.2021	(5.004)	11.000	11.000	0,15
					Standard Chartered Bank 0,000 % fällig am 05.07.2021	(4.000)			
					Svenska Handelsbanken AB 0,000 % fällig am 11.10.2021	(2.004)			
FICC	0,000	30.06.2021	01.07.2021	\$ 21.846	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022	(18.790)	18.421	18.421	0,25
IND	(0,700)	30.06.2021	01.07.2021	€ 35.500	European Stability Mechanism 0,875 % fällig am 18.07.2042	(2.438)	35.500	35.499	0,48
					SNCF Reseau 4,250 % fällig am 07.10.2026	(1.600)			
					State of North Rhine-Westphalia 1,950 % fällig am 26.09.2078	(10.050)			
					UNEDIC 0,625 % – 2,375 % fällig am 25.05.2024 – 17.02.2025	(21.095)			
Summe Pensionsgeschäfte						€ (112.465)	€ 111.821	€ 111.819	1,50

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	5.460	€ (1.582)	(0,02)
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	799	954	0,01
E-mini NASDAQ 100 Index September Futures	Long	09.2021	790	5.570	0,08
Euro STOXX 50 September Futures	Short	09.2021	5.310	3.978	0,05
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	880	1.346	0,02
Mini MSCI Emerging Markets Index September Futures	Short	09.2021	2.488	290	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	1.546	(896)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	466	494	0,01
				€ 10.154	0,14

OPTIONSKAUF

OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Markt- wert	% des Nettver- mögens
Call – OSE Nikkei 225 Index	€ 29.250,000	09.07.2021	2.004	€ 6.800	€ 1.111	0,01

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettver- mögens
Call – OSE Nikkei 225 Index	€ 30.500,000	09.07.2021	2.004	€ (1.718)	€ (40)	0,00

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

€ 11.225 0,15

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettver- mögens
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000 %	20.12.2025	\$ 16.500	€ 204	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	113.000	919	0,01
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	60.800	112	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	345.300	813	0,01
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 7.500	39	0,00
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	9.500	13	0,00
				€ 2.100	0,03

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000 %	16.06.2026	CAD 195.729	€ 16	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	5.692	7	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	10.835	7	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,250	16.06.2031	82.272	712	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025	5.150	14	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	3.072	9	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,290	03.03.2025	1.536	5	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	102.600	6	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	150.600	(5.219)	(0,07)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	181	(5)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2029	123.500	(2.135)	(0,03)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,200	19.06.2029	¥ 22.320.000	(171)	0,00
					€ (6.754)	(0,09)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

€ (4.654) (0,06)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIOMEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BOA	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000 %	20.10.2021	3.400	€ (13)	€ (8)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	17.500	(14)	(3)	0,00
BPS	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	14.900	(13)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	3.600	(19)	(1)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	15.300	(15)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	7.800	(9)	(2)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	17.400	(18)	(14)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	15.500	(14)	(1)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	15.600	(14)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	63.200	(73)	(15)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	31.100	(29)	(6)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	15.300	(14)	(2)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	15.200	(14)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	17.000	(19)	(6)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	15.900	(13)	(9)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	62.200	(54)	(32)	0,00
CBK	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	4.600	(17)	(11)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	16.900	(15)	(2)	0,00
DUB	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	18.000	(14)	(3)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	51.700	(43)	(11)	0,00
DUB	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	15.600	(15)	(3)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	15.000	(13)	(2)	0,00
DUB	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	15.400	(17)	(5)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	17.700	(17)	(14)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	15.09.2021	3.600	(17)	(7)	0,00
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	20.10.2021	5.500	(27)	(20)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	15.700	(13)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	17.500	(14)	(2)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	15.700	(13)	(4)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	34.200	(30)	(7)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	18.200	(15)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	17.400	(19)	(1)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	17.300	(14)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	18.200	(15)	(2)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	32.200	(28)	(18)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	30.400	(26)	(14)	0,00
JPM	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	14.600	(16)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	15.300	(13)	(1)	0,00
JPM	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	8.700	(10)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	17.800	(18)	(10)	0,00
MYC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	17.100	(17)	(9)	0,00
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	3.500	(7)	(1)	0,00
						€ (808)	€ (258)	0,00

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BPS	China Government International Bond	(1,000) %	20.12.2023	\$ 17.130	€ (303)	€ (4)	€ (307)	(0,01)
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.12.2023	16.800	(309)	7	(302)	0,00
					€ (612)	€ 3	€ (609)	(0,01)

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Rückkehrungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BRC	Erhalt	SXIE Index	452.409	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	€ 130.144	21.07.2021	€ 0	€ 3.966	€ 3.966	0,05
HUS	Erhalt	SXIE Index	149.173	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	42.913	09.07.2021	0	1.321	1.321	0,02
							€ 0	€ 5.287	€ 5.287	0,07

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	11.2021	\$ 10.523	€ 8.628	€ 0	€ (216)	€ (216)	0,00
BOA	07.2021	CAD 11.574	€ 7.852	0	(30)	(30)	0,00
	07.2021	€ 1.384	AUD 2.178	0	(6)	(6)	0,00
	07.2021	6.600	SEK 66.780	0	(16)	(16)	0,00
	07.2021	2.498	\$ 2.979	14	0	14	0,00
	07.2021	£ 1.018	€ 1.184	0	(2)	(2)	0,00
	07.2021	¥ 3.758.441	€ 28.186	0	(369)	(369)	(0,01)
	09.2021	HKD 1.932.178	\$ 249.053	166	0	166	0,00
	09.2021	PLN 83.249	€ 21.931	50	0	50	0,00
BPS	07.2021	AUD 9.462	€ 5.989	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	€ 4.996	AUD 7.901	6	0	6	0,00
	07.2021	€ 7.720	CAD 11.378	29	0	29	0,00
	07.2021	20.330	¥ 2.691.100	115	0	115	0,00
	07.2021	25.829	\$ 30.992	304	0	304	0,00
	07.2021	£ 70.693	€ 82.231	0	(120)	(120)	0,00
	07.2021	\$ 26.810	€ 22.446	0	(162)	(162)	0,00
	08.2021	AUD 7.901	€ 4.994	0	(6)	(6)	0,00
	09.2021	HKD 51.804	\$ 6.675	2	0	2	0,00
	09.2021	¥ 19.690.000	€ 147.896	0	(1.560)	(1.560)	(0,02)
	09.2021	\$ 55.708	KRW 62.079.038	0	(659)	(659)	(0,01)
	11.2021	ILS 106.719	\$ 32.575	0	(198)	(198)	0,00
BRC	11.2021	\$ 42.163	MXN 851.131	0	(103)	(103)	0,00
	07.2021	¥ 4.340.000	€ 33.397	429	0	429	0,01
	07.2021	\$ 22.588	€ 18.654	0	(393)	(393)	(0,01)
	08.2021	¥ 13.700.000	€ 103.975	0	(60)	(60)	0,00
CBK	09.2021	PLN 54.689	\$ 14.373	4	0	4	0,00
	07.2021	AUD 19.110	€ 12.129	31	0	31	0,00
	07.2021	CHF 33.968	€ 31.013	26	0	26	0,00
	07.2021	£ 69.758	€ 81.140	0	(121)	(121)	0,00
	07.2021	NOK 324.755	€ 31.818	0	(5)	(5)	0,00
	08.2021	HUF 32.411.726	\$ 107.785	0	(1.389)	(1.389)	(0,02)
	08.2021	PEN 213.287	€ 58.631	2.366	0	2.366	0,03
	09.2021	50.000	€ 13.443	298	0	298	0,00
	09.2021	\$ 45.641	CLP 32.762.323	0	(614)	(614)	(0,01)
	09.2021	25.150	HKD 195.247	0	(2)	(2)	0,00
	10.2021	PEN 15.859	\$ 4.123	0	(23)	(23)	0,00
	11.2021	ILS 64.012	€ 19.698	30	(20)	10	0,00
	12.2021	PEN 16.000	€ 4.281	81	0	81	0,00
	02.2022	ILS 54.111	€ 16.614	29	(69)	(40)	0,00
	02.2022	PEN 25.309	€ 6.590	0	(20)	(20)	0,00
	04.2022	ILS 120.099	€ 36.701	0	(269)	(269)	0,00
	06.2022	33.042	€ 10.200	2	0	2	0,00
	08.2022	30.641	€ 9.393	0	(61)	(61)	0,00
DUB	11.2021	\$ 58.371	CLP 41.784.557	0	(1.015)	(1.015)	(0,01)
GLM	07.2021	DKK 187.910	€ 25.265	0	(5)	(5)	0,00
	07.2021	€ 8.161	AUD 12.883	14	(19)	(5)	0,00
	07.2021	8.467	DKK 62.975	1	0	1	0,00
	07.2021	20.975	\$ 25.025	128	0	128	0,00
	07.2021	£ 131	€ 153	0	0	0	0,00
	07.2021	¥ 23.227.062	€ 173.598	0	(2.869)	(2.869)	(0,04)
	07.2021	\$ 460	BRL 2.315	1	0	1	0,00
	08.2021	BRL 2.315	\$ 458	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	HKD 75.953	€ 9.786	3	0	3	0,00
	09.2021	PLN 87.543	€ 23.041	34	0	34	0,00
	09.2021	TWD 602.953	€ 21.868	107	0	107	0,00
	09.2021	\$ 8.997	HKD 69.823	0	(4)	(4)	0,00
	09.2021	3.211	TWD 87.981	0	(33)	(33)	0,00
HUS	11.2021	PEN 73.668	\$ 19.654	318	0	318	0,00
	07.2021	€ 1.056	AUD 1.661	0	(5)	(5)	0,00
	07.2021	2.612	CAD 3.843	5	0	5	0,00
	07.2021	10.965	DKK 81.545	1	0	1	0,00
	07.2021	117.739	NZD 198.042	0	(1.049)	(1.049)	(0,01)
	07.2021	6.806	\$ 8.295	189	0	189	0,00
	07.2021	ILS 34.275	€ 10.556	31	0	31	0,00
	09.2021	PEN 78.205	€ 21.165	580	0	580	0,01
	09.2021	PLN 99.813	€ 26.061	0	(137)	(137)	0,00
	11.2021	ILS 144.565	€ 44.566	100	0	100	0,00
	11.2021	\$ 900	€ 742	0	(15)	(15)	0,00
	01.2022	ILS 6.121	\$ 1.896	10	0	10	0,00
IND	02.2022	\$ 8.280	€ 6.877	0	(71)	(71)	0,00
	07.2021	£ 15.192	€ 17.678	0	(20)	(20)	0,00
	04.2022	\$ 33.713	€ 28.123	0	(134)	(134)	0,00
JPM	07.2021	€ 30.995	CHF 33.968	0	(8)	(8)	0,00
	07.2021	¥ 11.483.272	€ 85.776	0	(1.467)	(1.467)	(0,02)
	07.2021	SEK 4.080	€ 403	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 25.675	€ 20.976	0	(674)	(674)	(0,01)
	07.2021	671	TRY 9.923	1	0	1	0,00
	08.2021	CHF 33.968	€ 31.001	8	0	8	0,00
	08.2021	\$ 41.952	COP 153.229.351	0	(840)	(840)	(0,01)
	09.2021	6.075	KRW 6.768.476	0	(73)	(73)	0,00
	11.2021	ILS 13.504	\$ 4.171	15	0	15	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
MYI	08.2022	\$ 2.854	€ 2.374	€ 0	€ (12)	€ (12)	0,00
	07.2021	BRL 2.315	\$ 432	0	(24)	(24)	0,00
	07.2021	DKK 382.810	€ 51.463	0	(16)	(16)	0,00
	07.2021	€ 3.688	DKK 27.430	0	0	0	0,00
	07.2021	9	SGD 14	0	0	0	0,00
	07.2021	327.622	\$ 391.206	2.258	0	2.258	0,03
	07.2021	£ 1.397	€ 1.625	0	(2)	(2)	0,00
	07.2021	\$ 6.161	€ 5.069	0	(127)	(127)	0,00
	08.2021	CAD 114.163	77.474	0	(219)	(219)	0,00
	09.2021	\$ 70.196	CLP 50.495.706	0	(816)	(816)	(0,01)
RBC	07.2021	¥ 9.143.783	€ 68.246	0	(1.224)	(1.224)	(0,02)
	08.2021	27.670.000	208.217	0	(1.882)	(1.882)	(0,03)
RYL	11.2021	\$ 12.446	10.361	0	(99)	(99)	0,00
	01.2022	1.896	1.553	0	(38)	(38)	0,00
SCX	02.2022	8.334	6.828	0	(167)	(167)	0,00
	07.2021	DKK 53.160	7.146	0	(3)	(3)	0,00
	07.2021	€ 943	AUD 1.483	0	(4)	(4)	0,00
	07.2021	7.298	DKK 54.265	0	0	0	0,00
	07.2021	18.435	£ 15.844	21	0	21	0,00
	07.2021	888	¥ 117.400	4	0	4	0,00
	07.2021	¥ 22.782.123	€ 173.176	1.132	(1.014)	118	0,00
	07.2021	SEK 317.590	31.374	59	0	59	0,00
	07.2021	\$ 2.193.378	1.792.902	0	(56.642)	(56.642)	(0,76)
	08.2021	£ 15.853	18.435	0	(21)	(21)	0,00
SOG	01.2022	DKK 30.000	4.033	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	€ 16.047	NOK 163.426	0	(33)	(33)	0,00
	07.2021	SEK 178.905	€ 17.699	59	0	59	0,00
SSB	08.2021	NOK 163.426	16.039	33	0	33	0,00
	07.2021	CAD 118.248	79.954	0	(568)	(568)	(0,01)
UAG	07.2021	€ 1.562	AUD 2.466	0	0	0	0,00
	09.2021	AUD 222.400	€ 140.853	250	0	250	0,00
	09.2021	¥ 6.000.000	45.185	0	(356)	(356)	0,00
	07.2021	€ 20.731	¥ 2.723.835	0	(37)	(37)	0,00
UAG	07.2021	¥ 6.489.549	€ 48.439	0	(865)	(865)	(0,01)
	08.2021	2.723.835	20.724	38	0	38	0,00
	09.2021	\$ 8.688	HKD 67.466	1	0	1	0,00
				€ 9.384	€ (79.103)	€ (69.719)	(0,94)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen fur die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) Income II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2021	€ 1	AUD 1	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
CBK	07.2021	69	109	0	0	0	0,00
GLM	07.2021	AUD 2	€ 2	0	0	0	0,00
	07.2021	€ 70	AUD 110	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	2	3	0	0	0	0,00
JPM	07.2021	70	110	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	AUD 3	€ 2	0	0	0	0,00
	07.2021	€ 4	AUD 6	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	AUD 4	€ 2	0	0	0	0,00
	07.2021	€ 1	AUD 2	0	0	0	0,00
				€ 0	€ 0	€ 0	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen fur die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
CBK	07.2021	€ 1.504	CHF 1.647	€ 0	€ (1)	€ (1)	0,00
GLM	07.2021	914	1.000	0	(1)	(1)	0,00
HUS	07.2021	1.505	1.648	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07.2021	CHF 2.034	€ 1.856	0	0	0	0,00
	08.2021	€ 1.856	CHF 2.034	0	(1)	(1)	0,00
SOG	07.2021	31	33	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	1.495	1.639	0	0	0	0,00
				€ 0	€ (5)	€ (5)	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€ 1.620	£ 1.392	€ 1	€ 0	€ 1	0,00
BPS	07.2021	115.617	99.371	155	(14)	141	0,00
BRC	07.2021	41.451	35.747	191	0	191	0,01
CBK	07.2021	70.546	60.650	105	0	105	0,00
HUS	07.2021	£ 439	€ 510	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07.2021	€ 1.101	£ 941	0	(5)	(5)	0,00
SCX	07.2021	108.142	93.518	799	(3)	796	0,01
	07.2021	£ 88.498	€ 102.971	0	(121)	(121)	0,00
	08.2021	€ 102.971	£ 88.548	119	0	119	0,00
SSB	07.2021	1.041	896	3	0	3	0,00
	07.2021	£ 2.155	€ 2.503	0	(8)	(8)	0,00
				€ 1.373	€ (152)	€ 1.221	0,02

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklasse M Retail SGD (Hedged) Income II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 3	€ 2	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
BRC	07.2021	75	47	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2021	€ 186	SGD 301	3	0	3	0,00
	07.2021	SGD 48	€ 30	0	0	0	0,00
GLM	07.2021	€ 406	SGD 654	4	0	4	0,00
	07.2021	SGD 71	€ 44	0	(1)	(1)	0,00
HUS	07.2021	€ 192	SGD 310	3	0	3	0,00
SCX	07.2021	SGD 10	€ 6	0	0	0	0,00
SOG	08.2021	14	9	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	€ 412	SGD 659	2	0	2	0,00
	07.2021	SGD 3	€ 2	0	0	0	0,00
				€ 12	€ (2)	€ 10	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional USD (Hedged) thesaurierend, Institutional USD (Hedged) Income II ausschüttend, Investor USD (Hedged) thesaurierend, E Class USD (Hedged) thesaurierend, E Class USD (Hedged) ausschüttend, H Institutional USD (Hedged) thesaurierend und M Retail USD (Hedged) Income II ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€ 57.506	\$ 70.332	€ 1.801	€ 0	€ 1.801	0,03
BPS	07.2021	179.251	219.117	5.517	0	5.517	0,07
	07.2021	\$ 311	€ 261	0	(1)	(1)	0,00
BRC	07.2021	€ 193.416	\$ 236.616	6.108	0	6.108	0,08
GLM	07.2021	\$ 3.546	€ 2.915	0	(75)	(75)	0,00
HUS	07.2021	€ 3.722	\$ 4.508	79	0	79	0,00
	07.2021	\$ 672	€ 552	0	(15)	(15)	0,00
MYI	07.2021	€ 18.565	\$ 22.599	491	0	491	0,01
	07.2021	\$ 1.203	€ 1.011	0	(4)	(4)	0,00
RBC	07.2021	€ 193.705	\$ 236.966	6.116	0	6.116	0,08
	07.2021	\$ 509	€ 418	0	(11)	(11)	0,00
SCX	07.2021	€ 16.466	\$ 19.907	321	0	321	0,00
	07.2021	\$ 5.935	€ 4.970	0	(34)	(34)	0,00
				€ 20.433	€ (140)	€ 20.293	0,27

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ (43.780) (0,59)

Summe Anlagen

€ 7.075.015 95,18

Sonstige Aktiva und Passiva

€ 358.265 4,82

Nettovermögen

€ 7.433.280 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

(h) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 209 und Barmittel in Höhe von EUR 58.920 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 79.479 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 1.273.887	€ 5.314.869	€ 2.249	€ 6.591.005
Investmentfonds	392.844	16.554	0	409.398
Pensionsgeschäfte	0	111.821	0	111.821
Finanzderivate ⁽³⁾	10.555	(47.764)	0	(37.209)
Summen	€ 1.677.286	€ 5.395.480	€ 2.249	€ 7.075.015

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 1.135.612	€ 2.906.510	€ 0	€ 4.042.122
Investmentfonds	476.267	211.868	0	688.135
Pensionsgeschäfte	0	271.399	0	271.399
Finanzderivate ⁽³⁾	(3.448)	45.512	0	42.064
Summen	€ 1.608.431	€ 3.435.289	€ 0	€ 5.043.720

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
AZD	€ (216)	€ 0	€ (216)
BOA	1.597	(1.080)	517
BPS	2.978	(2.530)	448
BRC	9.868	(7.690)	2.178
CBK	361	(1.180)	(819)
DUB	(1.050)	0	(1.050)
FBF	(42)	0	(42)
GLM	(2.398)	2.420	22
GST	(40)	0	(40)
HUS	1.024	(410)	614
IND	(154)	0	(154)
JPM	(3.069)	3.380	311
MYC	(1)	0	(1)
MYI	1.541	209	1.750
RBC	4.876	(3.870)	1.006
RYL	(2.186)	2.220	34
SCX	(55.388)	48.600	(6.788)
SOG	59	0	59
SSB	(677)	10	(667)
UAG	(863)	820	(43)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	61,28	67,29
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	25,19	11,07
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,20	0,45
Investmentfonds	5,51	13,42
Pensionsgeschäfte	1,50	5,29
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,15	(0,07)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,06)	0,07
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,59)	0,82

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	2,17	4,42
US-Schatzobligationen	k. A.	5,95
Non-Agency-MBS	0,56	0,84
Forderungsbesicherte Wertpapiere	3,43	2,38
Staatsemissionen	0,93	0,54
Stammaktien	42,40	45,70
Real Estate Investment Trusts	0,21	k. A.
Kurzfristige Instrumente	38,97	18,98
Investmentfonds	5,51	13,42
Pensionsgeschäfte	1,50	5,29
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,14	(0,07)
Optionskauf		
Optionen auf Indizes	0,01	k. A.
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Indizes	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,03	0,00
Zinsswaps	(0,09)	0,08
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,01)	(0,02)
Total Return Swaps auf Indizes	0,07	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,94)	0,96
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,29	(0,12)
Sonstige Aktiva und Passiva	4,82	1,66
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS			
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE														
ARGENTINIEN														
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL														
YPF S.A.				Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)				3,280 % fällig am 03.12.2027	CNY	712.400	111.835	4,04		
40,115 % fällig am 24.07.2021	ARS	16.367	98	01.12.2026 ^ (b)	\$	487	0,01	3,810 % fällig am 14.09.2050		110.200	17.493	0,63		
								Summe China			333.406	12,04		
								KOLUMBIEN						
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
				Poinsettia Finance Ltd.				Empresas Publicas de Medellin ESP						
				6,625 % fällig am 17.06.2031		7.800	7,560	0,27	7,625 % fällig am 10.09.2024	COP	7.839.000	2,121	0,08	
				QNB Finance Ltd.				0,40	8,375 % fällig am 08.11.2027		15.883.000	4,058	0,14	
				6,800 % fällig am 04.03.2030	IDR	162.000.000	11,200					6,179	0,22	
				S.A. Global Sukuk Ltd.				0,23	STAATSEMISSIONEN					
				0,946 % fällig am 17.06.2024	\$	6.500	6,499		Colombia Government International Bond					
				1,602 % fällig am 17.06.2026				0,29	9,850 % fällig am 28.06.2027					
				Seazen Group Ltd.				0,02	25.455.000				8,133	0,29
				4,450 % fällig am 13.07.2025		500	496		Colombian TES					
				SPARC EM SPC Panama Metro Line SP				0,10	5,750 % fällig am 03.11.2027					
				0,000 % fällig am 05.12.2022 (d)(j)		2.924	2,861		47.626.800				12,229	0,44
				Sunac China Holdings Ltd.				0,11	6,250 % fällig am 26.11.2025					
				6,500 % fällig am 26.01.2026		3.300	3,189		124.373.000				33,932	1,23
				Summe Cayman Inseln				1,98	35.885.300				8,411	0,31
								1,97	7,000 % fällig am 30.06.2032					
								0,26	27.729.600				7,280	0,26
								0,15	7,250 % fällig am 26.10.2050					
								0,62	16.745.900				4,123	0,15
								0,53	7,750 % fällig am 18.09.2030					
								0,04	61.030.100				17,112	0,62
								0,04	10,000 % fällig am 24.07.2024					
								0,03	48.151.500				14,729	0,53
								0,03	Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter					
								0,03	7,875 % fällig am 12.08.2024					
								0,76	3.384.000				931	0,03
								0,09	Republic of Colombia					
								0,15	1,000 % fällig am 26.11.2025					
								0,26	77.000.000				20,940	0,76
								0,25	1,000 % fällig am 26.08.2026					
								0,34	8.879.000				2,514	0,09
								0,08	1,000 % fällig am 30.06.2032					
								0,12	59.000.000				15,446	0,56
								0,25	145.780				5,27	0,25
								0,08	Summe Kolumbien					
								1,09	151.959				5,49	0,25
								1,13	TSCHECHISCHE REPUBLIK					
								0,08	STAATSEMISSIONEN					
								0,08	Czech Republic Government International Bond					
								1,09	0,250 % fällig am 10.02.2027 (j)					
								1,22	CZK					
								1,22	0,950 % fällig am 15.05.2030 (j)					
								0,26	778.540				33,774	1,22
								0,37	1,000 % fällig am 26.06.2026 (j)					
								0,01	158.300				7,132	0,26
								0,18	1,200 % fällig am 13.03.2031 (j)					
								0,01	235.000				10,346	0,37
								0,18	2,000 % fällig am 13.10.2033 (j)					
								0,36	6.100				289	0,01
								1,47	4,200 % fällig am 04.12.2036 (j)					
								1,47	164.900				10,010	0,36
								0,53	Summe Tschechische Republik					
								0,10	79.792				2,88	0,53
								0,18	DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
								0,00	STAATSEMISSIONEN					
								0,18	Dominican Republic Government International Bond					
								0,18	8,900 % fällig am 15.02.2023					
								0,18	DOP					
								0,18	9,750 % fällig am 05.06.2026					
								0,18	1.657.200				32,983	1,19
								0,47	Summe Dominikanische Republik					
								0,09	50.617				1,83	0,47
								0,09	ÄGYPTEN					
								0,09	STAATSEMISSIONEN					
								0,09	Egypt Government International Bond					
								0,09	4,750 % fällig am 16.04.2026					
								0,09	€					
								0,09	3.700				4,587	0,17

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
6,125 % fällig am 31.01.2022	\$	2.000	0,07	INDONESIEN				JAPAN			
13,765 % fällig am 05.01.2024	EGP	370.700	0,85	STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
14,313 % fällig am 13.10.2023		49.400	0,11	Indonesia Government International Bond				Nomura International Funding Pte. Ltd.			
14,369 % fällig am 20.10.2025		243.100	0,56	6,500 % fällig am 15.02.2031	IDR	29.266.000	0,07	6,625 % fällig am 18.05.2033	IDR	133.000.000	0,33
16,300 % fällig am 09.04.2024		80.000	0,19	7,500 % fällig am 15.05.2038		38.356.000	0,10	KASACHSTAN			
Summe Ägypten		54.056	1,95	8,250 % fällig am 15.05.2029		39.486.000	0,11	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
FRANKREICH				8,250 % fällig am 15.05.2036		11.427.000	0,03	Development Bank of Kazakhstan JSC			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				8,375 % fällig am 15.03.2034		81.791.000	0,22	4,125 % fällig am 10.12.2022	\$	500	0,02
BNP Paribas S.A.				8,375 % fällig am 15.04.2039		39.139.000	0,11	8,950 % fällig am 04.05.2023	KZT	2.290.000	0,19
6,240 % fällig am 06.02.2025	IDR	396.200.000	1,00	Summe Indonesien		17.855	0,64	Summe Kasachstan		5.813	0,21
Societe Generale S.A.				IRLAND				LUXEMBURG			
7,375 % fällig am 13.09.2021 (f)(h)	\$	600	0,02	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
7,375 % fällig am 04.10.2023 (f)(h)		900	0,04	Black Diamond CLO DAC				Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK)			
7,875 % fällig am 18.12.2023 (f)(h)		200	0,01	0,860 % fällig am 20.01.2032	€	600	0,03	10,000 % fällig am 09.11.2024 *(b)	\$	851	0,01
Summe Frankreich		29.599	1,07	Black Diamond CLO Ltd.				Petrorio Luxembourg SARL			
DEUTSCHLAND				0,860 % fällig am 20.01.2032		300	0,01	6,125 % fällig am 09.06.2026		5.200	0,19
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Carllyle Euro CLO DAC		4.600	0,20	Summe Luxemburg		5.528	0,20
Deutsche Bank AG				15.01.2031				MALAYSIA			
6,680 % fällig am 23.01.2025	IDR	672.100.000	1,70	Carllyle Global Market Strategies Euro CLO DAC		1.900	0,08	STAATSEMISSIONEN			
GHANA				15.11.2031		2.244	0,08	Malaysia Government International Bond			
STAATSEMISSIONEN				Dryden Euro CLO BV		7.400	0,32	2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	65.500	0,54
Ghana Government International Bond				0,860 % fällig am 15.05.2034 (a)		3.050	0,13	3,478 % fällig am 14.06.2024		200	0,00
16,500 % fällig am 06.02.2023	GHS	18.800	0,12	Harvest CLO DAC		3.050	0,13	3,480 % fällig am 15.03.2023		0	0,00
18,850 % fällig am 28.09.2023		35.400	0,22	0,650 % fällig am 26.06.2030		1.500	0,06	3,502 % fällig am 31.05.2027		35.500	0,32
19,250 % fällig am 18.12.2023		25.100	0,16	Oak Hill European Credit Partners Ltd.		1.500	0,06	3,733 % fällig am 15.06.2028		38.800	0,35
20,750 % fällig am 16.01.2023		36.000	0,23	0,900 % fällig am 22.07.2030		22.937	0,83	3,757 % fällig am 20.04.2023		1.500	0,01
Summe Ghana		20.332	0,73	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,757 % fällig am 22.05.2040		19.700	0,16
HONGKONG				Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				3,828 % fällig am 05.07.2034		7.690	0,07
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				9,350 % fällig am 06.08.2022	RUB	794.000	0,40	3,885 % fällig am 15.08.2029		33.300	0,31
Fortune Star BVI Ltd.				Summe Irland		34.097	1,23	3,899 % fällig am 16.11.2027		28.900	0,27
5,950 % fällig am 27.01.2027	\$	6.200	0,23	ISRAEL				3,906 % fällig am 15.07.2026		1.200	0,01
UNGARN				STAATSEMISSIONEN				4,127 % fällig am 15.04.2032		13.100	0,12
STAATSEMISSIONEN				Israel Government International Bond				4,181 % fällig am 15.07.2024		25.300	0,23
Hungary Government International Bond				0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS	49.200	0,55	4,642 % fällig am 07.11.2033		1.420	0,01
1,500 % fällig am 24.08.2022 (j)	HUF	3.405.400	0,42	0,750 % fällig am 31.07.2022		170.600	1,91	4,935 % fällig am 30.09.2043		3.220	0,03
2,000 % fällig am 23.05.2029 (j)		1.990.500	0,24	5,500 % fällig am 31.01.2022		35.400	0,40	Malaysia Government Investment Issue			
2,500 % fällig am 24.10.2024 (j)		10.754.000	1,35	Summe Israel		79.088	2,86	3,151 % fällig am 15.05.2023		43.200	0,38
2,750 % fällig am 22.12.2026 (j)		4.880.200	0,61	ITALIEN				3,422 % fällig am 30.09.2027		33.000	0,30
3,000 % fällig am 26.06.2024 (j)		3.628.800	0,46	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,447 % fällig am 15.07.2036		21.300	0,17
3,000 % fällig am 27.10.2038 (j)		1.134.400	0,13	Banca Carige SpA				3,655 % fällig am 15.10.2024		31.100	0,28
3,250 % fällig am 22.10.2031 (j)		1.802.000	0,23	0,957 % fällig am 25.05.2022	€	4.600	0,20	3,726 % fällig am 31.03.2026		24.000	0,22
4,000 % fällig am 28.04.2051		924.000	0,13	UniCredit SpA		1.600	0,07	3,899 % fällig am 15.06.2027		1.330	0,01
Summe Ungarn		98.870	3,57	6,750 % fällig am 10.09.2021 (f)(h)		800	0,03	4,119 % fällig am 30.11.2034		26.200	0,23
INDIEN				9,250 % fällig am 03.06.2022 (f)(h)		8.419	0,30	4,130 % fällig am 09.07.2029		20.100	0,19
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Italien				4,258 % fällig am 26.07.2027		900	0,01
Periama Holdings LLC				ELFENBEINKÜSTE				4,369 % fällig am 31.10.2028 (j)		65.900	0,62
5,950 % fällig am 19.04.2026	\$	5.500	0,21	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG							
Shriram Transport Finance Co. Ltd.				Republik Elfenbeinküste							
4,400 % fällig am 13.03.2024		6.300	0,23	TBD % fällig am 19.03.2027		7.900	0,34				
5,700 % fällig am 27.02.2022		1.300	0,05								
Summe Indien		13.625	0,49								

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	
4,417 % fällig am 30.09.2041 (j) MYR	32.070	7.883	0,29	PERU				4,500 % fällig am 17.06.2024 RON	212.500	54.178	1,96	
4,582 % fällig am 30.08.2033	13.700	3.538	0,13	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,750 % fällig am 11.10.2034	18.200	4.702	0,17	
4,638 % fällig am 15.11.2049	29.100	7.190	0,26	Alicorp SAA				5,000 % fällig am 12.02.2029	12.600	3.402	0,12	
4,724 % fällig am 15.06.2033	60.363	15.772	0,57	6,875 % fällig am 17.04.2027	PEN	20.200	5.816	0,21	Summe Rumänien	79.988	2,89	
Summe Malaysia		168.468	6,09	Banco de Credito del Peru				RUSSLAND				
MAURITIUS				4,650 % fällig am 17.09.2024		24.100	6.509	0,23	STAATSEMISSIONEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Peru				Russia Government International Bond				
MTN Mauritius Investments Ltd.								5,300 % fällig am 04.10.2023 RUB	340.100	4.517	0,16	
5,373 % fällig am 13.02.2022 \$	2.312	2.366	0,09	STAATSEMISSIONEN				5,700 % fällig am 17.05.2028	1.794.100	22.904	0,83	
MEXIKO				Fondo MIVIENDA S.A.				7,050 % fällig am 19.01.2028	998.500	13.764	0,50	
STAMMAKTIEN				7,000 % fällig am 14.02.2024		39.000	10.998	0,40	7,100 % fällig am 16.10.2024	1.006.300	13.902	0,50
AKTIEN				Peru Government International Bond				7,600 % fällig am 20.07.2022	114.200	1.586	0,06	
Hipotecaria Su Casita S.A. (c)	212.074	0	0,00	5,400 % fällig am 12.08.2034		36.600	9.032	0,33	7,650 % fällig am 10.04.2030	2.171.400	30.953	1,12
				5,940 % fällig am 12.02.2029 (j)		96.200	27.502	0,99	7,700 % fällig am 23.03.2033	1.638.800	23.531	0,85
				6,150 % fällig am 12.08.2032		62.953	17.044	0,62	7,750 % fällig am 16.09.2026	357.100	5.070	0,18
				6,350 % fällig am 12.08.2028 (j)		39.300	11.486	0,42	7,950 % fällig am 07.10.2026	2.896.800	41.464	1,50
America Movil S.A.B. de C.V.				6,900 % fällig am 12.08.2037		34.300	9.468	0,34	8,500 % fällig am 17.09.2031	1.747.100	26.393	0,95
8,460 % fällig am 18.12.2036 MXN	1.800	91	0,00	6,950 % fällig am 12.08.2031		2.200	645	0,02	Summe Russland	184.084	6,65	
Corp. GEO S.A.B. de C.V.				8,200 % fällig am 12.08.2026		23.328	7.572	0,27	SERBIEN			
8,875 % fällig am 25.09.2014 \$	250	0	0,00	Summe Peru				STAATSEMISSIONEN				
9,250 % fällig am 30.06.2020	700	0	0,00					Serbia Government International Bond				
Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.								4,500 % fällig am 20.08.2032 RSD	493.700	5.527	0,20	
9,620 % fällig am 28.06.2018 MXN	22.130	35	0,00	PHILIPPINEN				5,875 % fällig am 08.02.2028	308.500	3.761	0,14	
Petroleos Mexicanos				STAATSEMISSIONEN				Summe Serbien	9.288	0,34		
7,650 % fällig am 24.11.2021	20.000	1.004	0,04	Philippines Government International Bond				SINGAPUR				
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.				3,900 % fällig am 26.11.2022 PHP	943.000	19.508	0,70	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
8,790 % fällig am 09.12.2014 \$	29.700	0	0,00	6,250 % fällig am 14.01.2036		42.000	1.031	0,04	TML Holdings Pte. Ltd.			
		1.130	0,04	Summe Philippinen				5,500 % fällig am 03.06.2024 \$	6.975	7.272	0,26	
STAATSEMISSIONEN								STAATSEMISSIONEN				
Mexico Government International Bond				POLEN				Singapore Government International Bond				
7,750 % fällig am 29.05.2031 (j)	145.000	7.682	0,28	STAATSEMISSIONEN				1,625 % fällig am 01.07.2031 (a) SGD	3.250	2.428	0,09	
7,750 % fällig am 13.11.2042	279.300	14.388	0,52	Poland Government International Bond				3,375 % fällig am 01.09.2033	21.100	18.469	0,67	
8,000 % fällig am 07.11.2047 (j)	322.900	17.050	0,62	1,250 % fällig am 25.10.2030 (j) PLN	93.200	23.724	0,86	Summe Singapur	28.169	1,02		
8,500 % fällig am 31.05.2029 (j)	16.000	886	0,03	2,250 % fällig am 25.10.2024 (j)	42.200	11.636	0,42	SUDAFRIKA				
8,500 % fällig am 18.11.2038 (j)	360.400	19.924	0,72	2,500 % fällig am 25.07.2026 (j)	34.900	9.731	0,35	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
10,000 % fällig am 20.11.2036 (j)	75.000	4.732	0,17	2,750 % fällig am 25.10.2029 (j)	77.900	22.417	0,81	Eskom Holdings SOC Ltd.				
		64.662	2,34	Summe Polen				0,000 % fällig am 18.08.2027 (d) ZAR	100.100	3.305	0,12	
Summe Mexiko		65.792	2,38					0,000 % fällig am 31.12.2032 (d)	254.000	3.671	0,13	
NIEDERLANDE				KATAR				7,850 % fällig am 02.04.2026	177.000	12.140	0,44	
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Transnet SOC Ltd.				
BNPP AM Euro CLO BV				Nakilat, Inc.				4,000 % fällig am 26.07.2022 \$	3.100	3.165	0,11	
0,600 % fällig am 15.04.2031 €	500	593	0,02	6,067 % fällig am 31.12.2033	\$	175	216	0,01	10,000 % fällig am 30.03.2029 ZAR	40.000	2.889	0,11
Cairn CLO BV				QNB Finance Ltd.				Summe Südafrika	292.941	10,58		
0,780 % fällig am 15.10.2031	3.700	4.388	0,16	6,800 % fällig am 04.03.2030	IDR	951.700.000	65.795	2,38				
		4.981	0,18	6,900 % fällig am 23.01.2025		276.200.000	19.349	0,70				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,900 % fällig am 05.07.2024 (i)		178.300.000	12.812	0,46				
ING Groep NV				Summe Katar				8,500 % fällig am 31.01.2037 (j)	697.900	42.032	1,52	
6,875 % fällig am 16.04.2022 (f)(h) \$	400	417	0,02					8,750 % fällig am 31.01.2044 (j)	68.700	4.076	0,15	
Republic of Angola Via Avenir BV				RUMANIEN				8,875 % fällig am 28.02.2035 (j)	644.200	40.970	1,48	
4,665 % fällig am 07.12.2023	7.050	6.951	0,25	STAATSEMISSIONEN				9,000 % fällig am 31.01.2040	152.100	9.365	0,34	
7,660 % fällig am 01.07.2023	883	885	0,03	Romania Government International Bond				10,500 % fällig am 21.12.2026 (j)	1.244.632	99.066	3,58	
		8.253	0,30	3,650 % fällig am 28.07.2025	RON	21.700	5.424	0,19				
Summe Niederlande		13.234	0,48	3,700 % fällig am 25.11.2024		29.500	7.385	0,27				
NIGERIA				4,150 % fällig am 26.01.2028		19.100	4.897	0,18				
STAATSEMISSIONEN												
Nigeria Government International Bond												
5,625 % fällig am 27.06.2022	5.152	5.335	0,19									

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
SÜDKOREA				TÜRKEI				USA						
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE						
Export-Import Bank of Korea				Turkey Government International Bond				ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust						
7,250 % fällig am 17.06.2036				10,600 % fällig am 11.02.2026	TRY	37.000	3,338	0,12	1,112 % fällig am 25.04.2035	\$	2.382	2,388	0,09	
3,600 % fällig am 17.06.2067				11,000 % fällig am 24.02.2027		214.200	19,059	0,69	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
8,000 % fällig am 07.12.2024	IDR	4.100.000	\$	12,600 % fällig am 01.10.2025		101.400	9,964	0,36	1,067 % fällig am 25.07.2035		1.500	1,499	0,05	
8,000 % fällig am 15.05.2024		2.800.000		16,200 % fällig am 14.06.2023		146.600	16,481	0,59	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust		1	1	0,00	
				Summe Türkei			48,842	1,76	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust		2,396	2,390	0,09	
Summe Südkorea		506	0,02						CIT Mortgage Loan Trust		463	468	0,02	
SPANIEN				UGANDA				USA						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE						
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				Republic of Uganda Government International Bond				0,232 % fällig am 25.12.2036						
5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h)	€	200	256	0,01	14,250 % fällig am 22.06.2034	UGX	23.372.700	6,519	0,24	0,252 % fällig am 25.12.2036		1,562	1,055	0,04
Banco Santander S.A.				16,000 % fällig am 14.11.2030		10.694.900	3,296	0,12	0,392 % fällig am 25.10.2036		521	384	0,01	
6,250 % fällig am 11.09.2021 (f)(h)		100	120	0,00	17,000 % fällig am 03.04.2031		7.022.900	2,279	0,08	Countrywide Asset-Backed Certificates		7,700	7,528	0,27
6,750 % fällig am 25.04.2022 (f)(h)		200	248	0,01	Summe Uganda			12,094	0,44	0,677 % fällig am 25.06.2036 ^		1,990	1,991	0,07
CaixaBank S.A.										GSAMP Trust		531	343	0,01
6,000 % fällig am 18.07.2022 (f)(h)		200	248	0,01						0,142 % fällig am 25.12.2046		1,040	757	0,03
			872	0,03						0,182 % fällig am 25.01.2037				
STAATSEMISSIONEN				UKRAINE				USA						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE						
Autonomous Community of Catalonia				Ukraine Government International Bond						JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.		697	695	0,03
4,900 % fällig am 15.09.2021		2.050	2.457	0,09	7,750 % fällig am 01.09.2021	\$	5,727	5,784	0,21	0,677 % fällig am 25.05.2035				
Summe Spanien			3,329	0,12	7,750 % fällig am 01.09.2022		4,657	4,902	0,18	Lehman XS Trust		1,990	1,991	0,07
SUPRANATIONAL				VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				USA						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE						
Asian Development Bank				ADCB Finance Cayman Ltd.						MASTR Asset-Backed Securities Trust		809	778	0,03
4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN	68.600	3,451	0,12	7,500 % fällig am 15.10.2029	IDR	29.000.000	2,103	0,08	1,242 % fällig am 25.08.2037				
Corp. Andina de Fomento					8,160 % fällig am 29.04.2029		323.000.000	24,073	0,87	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust		8,419	6,243	0,23
6,500 % fällig am 16.03.2023	IDR	125.900.000	8,750	0,32	Summe Vereinigte Arabische Emirate			26,176	0,95	0,322 % fällig am 25.11.2036		206	187	0,01
6,770 % fällig am 24.05.2028	COP	27.500.000	7,300	0,26						0,392 % fällig am 25.06.2036		1,732	1,704	0,06
International Finance Corp.										1,247 % fällig am 25.01.2035				
8,000 % fällig am 09.10.2023	IDR	6.900.000	507	0,02						NovaStar Mortgage Funding Trust		1,907	847	0,03
Summe übernational			20,008	0,72						0,262 % fällig am 25.01.2037				
SCHWEIZ				GROSSBRITANNIEN				USA						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE						
Credit Suisse Group AG				Barclays PLC						Option One Mortgage Loan Trust		592	482	0,02
7,125 % fällig am 29.07.2022 (f)(h)	\$	700	731	0,03	7,250 % fällig am 15.03.2023 (f)(h)	£	800	1,195	0,04	0,312 % fällig am 25.04.2037				
7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h)		1.300	1,417	0,05	7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(h)	\$	1.300	1,432	0,05	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		100	101	0,00
7,500 % fällig am 11.12.2023 (f)(h)		1.900	2,112	0,08	7,875 % fällig am 15.03.2022 (f)(h)		800	835	0,03	0,827 % fällig am 25.08.2035		2,206	2,202	0,08
UBS Group AG					7,875 % fällig am 15.09.2022 (f)(h)	£	600	890	0,03	1,262 % fällig am 25.03.2035				
7,125 % fällig am 10.08.2021 (f)(h)		600	604	0,02	HSBC Holdings PLC					Residential Asset Securities Corp. Trust		2,345	2,350	0,08
Summe Schweiz			4,864	0,18	5,250 % fällig am 16.09.2022 (f)(h)	€	200	249	0,01	1,742 % fällig am 25.07.2035				
THAILAND				GROSSBRITANNIEN				USA						
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE						
Thailand Government International Bond				BOC Aviation USA Corp.						Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust		5,956	4,476	0,16
1,585 % fällig am 17.12.2035	THB	156.100	4,521	0,16	1,625 % fällig am 29.04.2024		4,900	4,942	0,18	0,312 % fällig am 25.10.2037				
1,600 % fällig am 17.12.2029		1.261.800	39,512	1,43	DAE Funding LLC					Delta Air Lines, Inc.		1,000	1,014	0,04
1,875 % fällig am 17.06.2049		94.300	2,476	0,09	1,625 % fällig am 15.02.2024		7,400	7,520	0,27	Ford Motor Credit Co. LLC		1,900	1,953	0,07
2,000 % fällig am 17.12.2031		36.600	1,167	0,04	Delta Air Lines, Inc.					3,625 % fällig am 15.03.2022		400	593	0,02
2,875 % fällig am 17.12.2028		679.600	23,484	0,85	Delta Air Lines, Inc.					3,550 % fällig am 07.10.2022				
2,875 % fällig am 17.06.2046		73.500	2,389	0,09	Delta Air Lines, Inc.					4,535 % fällig am 06.03.2025	£			
3,300 % fällig am 17.06.2038		1.029.050	36,185	1,31	Natwest Group PLC					JPMorgan Chase Bank N.A.		199,258,000	14,210	0,51
					8,625 % fällig am 15.08.2021 (f)(h)	\$	200	202	0,01	7,500 % fällig am 19.06.2035	IDR	42,195,000	3,243	0,12
					Santander UK Group Holdings PLC					8,250 % fällig am 18.05.2029		95,934,000	7,331	0,26
					7,375 % fällig am 24.06.2022 (f)(h)	£	400	584	0,02	8,375 % fällig am 19.04.2039				

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
JPMorgan Structured Products BV				0,732 % fällig am 25.03.2035	140	137	0,00	0,006 % fällig am 08.06.2022			
3,650 % fällig am 14.10.2024 (i)	\$ 5.143	\$ 5.149	0,19	IndyMac Mortgage Loan Trust				(d)(e)	102.300	31.393	1,13
11,750 % fällig am 17.06.2022 (i)	UAH 189.000	6.973	0,25	0,262 % fällig am 25.11.2036		7.632	0,28	0,010 % fällig am 02.03.2022			
12,000 % fällig am 28.08.2026 (i)	ZMW 61.760	1.376	0,05	0,272 % fällig am 25.02.2037	7.606	502	0,02	(d)(e)	34.400	10.556	0,38
12,000 % fällig am 04.01.2027 (i)	52.875	1.151	0,04	2,790 % fällig am 25.11.2037	496	262	0,01	0,011 % fällig am 06.04.2022			
14,000 % fällig am 28.05.2031 (i)	159.400	3.263	0,12	JPMorgan Resecuritization Trust				(d)(e)	79.600	24.426	0,88
14,000 % fällig am 09.12.2031 (i)	59.100	1.246	0,05	2,500 % fällig am 25.03.2056	321	322	0,01			85.094	3,07
14,910 % fällig am 14.10.2022 (i)	UAH 34.000	1.309	0,05	Lehman XS Trust				MALAYSIA TREASURY BILLS			
16,060 % fällig am 05.08.2022 (i)	188.000	7.296	0,26	0,282 % fällig am 25.09.2046	2.065	2.092	0,08	1,798 % fällig am 24.12.2021			
Rio Oil Finance Trust				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				(d)(e)	MYR 7.140	1.706	0,06
8,200 % fällig am 06.04.2028	\$ 3.456	4.002	0,14	2,043 % fällig am 25.06.2036	1	1	0,00	1,818 % fällig am 24.12.2021			
9,250 % fällig am 06.07.2024	1.968	2.185	0,08	Residential Accredit Loans, Inc. Trust				(d)(e)	156.260	37.332	1,35
9,750 % fällig am 06.01.2027	762	902	0,03	1,023 % fällig am 25.10.2037	1.916	1.848	0,07	1,824 % fällig am 24.12.2021			
		75.658	2,73	5,500 % fällig am 25.03.2037 ^	421	409	0,01	(d)(e)	81.800	19.543	0,71
				Sequoia Mortgage Trust						58.581	2,12
				3,027 % fällig am 20.01.2038 ^	374	345	0,01	Summe kurzfristige Instrumente		164.888	5,96
NON-AGENCY-MBS				Structured Asset Mortgage Investments Trust							
American Home Mortgage Investment Trust				0,392 % fällig am 25.02.2037	854	831	0,03	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 3.083.095	111,37
1,671 % fällig am 25.09.2045	1	1	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
Banc of America Mortgage Trust				0,462 % fällig am 25.05.2034		139	0,01				
2,787 % fällig am 25.02.2036 ^	1	1	0,00	3,031 % fällig am 25.02.2037 ^		29	0,00				
BCAP LLC Trust				Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust							
2,648 % fällig am 26.05.2037	4.388	4.383	0,16	2,940 % fällig am 25.10.2036	390	386	0,01				
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust						39.304	1,42				
2,756 % fällig am 25.01.2035	1	1	0,00	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN							
2,855 % fällig am 25.03.2035	11	11	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security							
3,156 % fällig am 25.05.2047 ^	18	18	0,00	2,479 % fällig am 01.07.2035	13	14	0,00				
Bear Stearns ALT-A Trust				Summe USA		153.974	5,56				
2,555 % fällig am 25.10.2035 ^	398	380	0,01	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE							
2,936 % fällig am 25.04.2037	7.820	6.682	0,24	COMMERCIAL PAPER							
Citigroup Mortgage Loan Trust				Sunac China Holdings Ltd.							
2,376 % fällig am 25.03.2034	2	2	0,00	5,950 % fällig am 30.12.2021 (i)	9.800	9.807	0,35				
3,234 % fällig am 25.09.2037 ^	4.029	3.988	0,14	KURZFRISTIGE SCHULDITITEL							
Countrywide Alternative Loan Trust				JPMorgan Structured Products BV							
0,452 % fällig am 25.04.2046	143	141	0,01	3,550 % fällig am 29.12.2021 (i)	€ 6.500	7.709	0,28				
0,733 % fällig am 20.12.2035	572	547	0,02	17,250 % fällig am 07.01.2022 (i)	UAH 92.000	3.531	0,13				
6,000 % fällig am 25.06.2036	4.822	3.715	0,13			11.240	0,41				
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				ARGENTINA TREASURY BILLS							
0,892 % fällig am 25.03.2035	54	53	0,00	38,001 % fällig am							
3,093 % fällig am 25.11.2037	437	434	0,02	30.07.2021 (d)(e)	ARS 28.875	166	0,01				
FWD Securitization Trust				ISRAEL TREASURY BILLS							
2,240 % fällig am 25.01.2050	1.436	1.458	0,05	0,020 % fällig am							
GSMPs Mortgage Loan Trust				02.02.2022 (d)(e)	ILS 17.800	5.463	0,20				
0,442 % fällig am 25.01.2036	167	140	0,01	0,000 % fällig am							
GSR Mortgage Loan Trust				06.04.2022 (d)(e)	ILS 43.200	\$ 13.256	0,48				
2,927 % fällig am 25.01.2036 ^	6	6	0,00								
HarborView Mortgage Loan Trust											
0,298 % fällig am 19.12.2036	\$ 2.561	2.408	0,09								
Impac CMB Trust											

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 1.100	\$ 1	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI		2,700 %	03.01.2022	BRL 400.600	\$ (179)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,840	03.01.2022	911.700	422	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,848	03.01.2022	11.000	5	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,859	03.01.2022	55.200	25	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,865	03.01.2022	20.100	9	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,870	03.01.2022	86.200	40	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,880	03.01.2022	1.799.700	896	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,883	03.01.2022	331.900	152	0,01

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,884 %	03.01.2022	BRL 70.600	\$ 32	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,886	03.01.2022	102.500	47	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		3,055	03.01.2022	142.400	54	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,100	03.01.2022	1.308.600	(528)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,125	03.01.2022	122.800	(49)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,130	03.01.2022	752.000	(301)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		3,150	03.01.2022	365.100	132	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI		3,170	03.01.2022	281.100	111	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,345	03.01.2022	104.300	(44)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,350	03.01.2022	1.463.200	(612)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,390	03.01.2022	34.200	(14)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,700	03.01.2022	1.382.808	(555)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		3,990	03.01.2022	80.600	17	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		4,000	03.01.2022	477.200	99	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		4,020	02.01.2023	370.400	(250)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		4,030	02.01.2023	184.300	(48)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		4,038	02.01.2023	45.000	(12)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		4,040	03.01.2022	151.592	(57)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		4,045	02.01.2023	545.400	114	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		4,070	02.01.2023	161.500	(41)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		4,100	02.01.2023	394.900	(94)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		4,500	03.01.2022	230.200	(27)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		4,605	02.01.2023	166.600	25	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		4,640	03.01.2022	1.479.400	511	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI		4,640	02.01.2023	227.500	33	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		4,720	02.01.2024	235.200	(214)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		4,870	02.01.2024	326.700	106	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,000	02.01.2023	94.400	5	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		5,100	02.01.2024	50.600	(42)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		5,150	02.01.2023	550.700	(45)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		5,160	02.01.2024	348.300	(291)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,250	02.01.2023	273.300	27	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		5,350	02.01.2023	52.700	(7)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		5,360	02.01.2023	4.900	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,440	02.01.2023	19.900	4	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,650	03.01.2022	135.000	19	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,660	02.01.2025	242.500	389	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,680	02.01.2024	669.800	721	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,710	02.01.2025	66.100	119	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,745	02.01.2023	66.700	17	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,780	02.01.2023	9.800	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,920	02.01.2023	2.600	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,010	02.01.2025	34.000	65	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,020	04.01.2027	36.800	(104)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,030	02.01.2025	76.700	149	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,050	02.01.2025	102.500	(197)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,140	04.01.2027	528.200	1.238	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,180	04.01.2027	79.900	(236)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,230	02.01.2023	141.800	58	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,245	04.01.2027	10.400	(30)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,250	04.01.2027	27.100	(81)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,260	03.01.2022	88.100	25	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,375	02.01.2023	48.800	22	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,410	02.01.2023	615.300	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,410	04.01.2027	80.000	247	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,450	04.01.2027	21.800	(67)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,500	04.01.2027	62.500	(189)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,510	04.01.2027	66.800	(206)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,520	04.01.2027	93.600	(293)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,675	02.01.2023	157.400	83	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,710	02.01.2025	13.900	30	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,745	02.01.2025	231.100	(509)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,810	02.01.2025	147.200	(327)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,910	02.01.2023	80.000	12	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,950	04.01.2027	800	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,990	04.01.2027	59.200	197	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		7,115	04.01.2027	82.200	278	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		7,160	02.01.2025	9.100	18	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		7,170	02.01.2025	11.900	23	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		7,170	04.01.2027	108.700	(371)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		7,195	02.01.2023	319.800	(150)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		7,260	02.01.2023	424.800	(278)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		7,305	04.01.2027	37.400	129	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		7,310	02.01.2024	46.400	(46)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		7,420	03.01.2022	194.600	111	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		7,480	02.01.2025	119.400	294	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI		7,770	04.01.2027	166.100	(539)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		7,775	02.01.2024	117.500	66	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		7,800	04.01.2027	27.000	99	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		8,355	04.01.2027	54.900	20	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		8,450	04.01.2027	102.700	79	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		8,635	04.01.2027	65.500	(261)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,640 %	04.01.2027	BRL	105.900	\$ 422	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,675	04.01.2027		19.900	(80)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,750	04.01.2027		208.600	(739)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,020	02.01.2023		98.600	142	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,490	04.01.2027		104.000	452	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,600	04.01.2027		48.900	(220)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,750	02.01.2025		17.400	60	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,760	02.01.2025		51.200	177	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,135	01.07.2021		70.500	138	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,240	04.01.2027		67.300	(312)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,300	02.01.2025		50.300	184	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,300	04.01.2027		77.600	(361)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,860	02.01.2023		115.200	244	0,01
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	1,955	16.09.2025	CNY	41.200	(9)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,620	16.12.2025		13.600	(5)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,625	16.12.2025		60.400	(20)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,735	16.12.2025		43.500	15	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,787	17.03.2025		80.200	21	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,148	25.09.2022	COP	70.412.700	24	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,215	04.05.2022		43.977.000	(28)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,240	04.05.2022		43.977.300	(28)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,720	04.05.2022		126.179.400	82	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,740	24.07.2024		7.014.700	(19)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,090	26.11.2025		76.500.000	158	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,125	15.01.2026		3.301.000	5	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,130	17.07.2025		34.734.600	84	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,240	15.10.2025		77.435.000	(168)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,255	11.12.2025		57.933.000	130	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,620	26.11.2025		69.048.400	(154)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,680	03.11.2027		17.350.000	8	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,900	24.07.2024		70.339.300	203	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,975	23.06.2027		11.832.300	33	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,005	20.08.2028		53.353.700	(80)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,060	26.11.2025		66.789.000	154	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,075	26.11.2025		21.848.700	50	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,090	26.11.2025		56.359.000	130	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,115	01.02.2031		14.558.000	(52)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,120	01.02.2031		10.388.000	(37)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,155	15.01.2031		5.060.000	(19)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,820	26.11.2025		63.629.600	(57)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,175	28.05.2027		32.437.000	(32)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,675	18.06.2031		10.000.000	32	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,105	02.12.2025	ZAR	512.400	(12)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,255	09.07.2025		319.400	19	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,601	09.06.2026		101.900	(109)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,680	08.06.2026		122.400	(122)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,700	21.04.2026		229.400	43	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,757	14.04.2026		630.100	135	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,200	08.03.2026		245.200	16	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,375	29.01.2023		367.100	31	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,410	11.02.2023		435.400	(66)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,670	13.12.2022		98.200	32	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,845	18.03.2026		230.000	38	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,855	11.02.2026		691.900	(29)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,120	26.05.2030		88.500	91	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	19.09.2023		142.300	(66)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,460	06.03.2030		110.400	(97)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,490	06.03.2030		53.400	(47)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	15.03.2022		75.000	(19)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	9,500	16.09.2026		53.400	16	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,020	01.03.2025	CLP	6.193.000	180	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,025	01.03.2025		6.451.000	188	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,030	01.03.2025		8.262.000	240	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,070	10.12.2023		3.700.000	(113)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,080	10.12.2023		3.700.000	(113)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,150	24.07.2025		290.500	(9)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,165	14.07.2025		6.564.000	(199)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,170	14.07.2025		6.564.000	(199)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month CLP-CHILIBOR	1,220	03.12.2022		6.483.000	(79)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,220	14.07.2025		13.854.000	(420)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month CLP-CHILIBOR	1,265	03.12.2022		5.015.000	(61)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,470	01.03.2025		12.050.000	(362)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,582	02.02.2026		9.746.000	(308)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,684	04.06.2027		18.963.600	(783)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,715	04.06.2027		3.782.600	(157)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,740	09.12.2025		7.836.000	(325)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,780	17.02.2026		7.036.000	225	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,785	17.02.2026		3.197.000	102	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,790	17.02.2026		12.255.000	392	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,840	13.03.2025		457.000	14	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,910	01.03.2023		3.500.000	64	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,935	10.03.2025		9.206.000	284	0,01

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		1,940 %	10.03.2025	CLP 4.602.900	\$ 142	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		1,947	23.11.2027	9.776.000	443	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		1,950	05.05.2026	5.894.100	(187)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		1,965	24.11.2027	8.553.000	388	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,005	01.03.2023	3.465.090	63	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,080	01.06.2030	3.688.000	(166)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,110	01.03.2023	4.250.000	78	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,110	01.06.2030	1.385.000	(63)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,120	01.03.2023	5.320.000	98	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,120	14.07.2030	7.000.000	243	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,170	14.07.2030	7.199.000	250	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,245	10.12.2027	1.305.000	(64)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,255	10.12.2027	6.892.000	(338)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,260	10.09.2027	7.948.100	274	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,300	05.09.2026	4.789.900	160	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,305	10.03.2026	2.958.700	98	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,325	10.03.2026	1.972.500	66	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,335	03.09.2026	2.007.400	68	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,340	08.10.2027	2.970.700	103	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,393	05.02.2025	4.113.000	(133)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,410	31.01.2025	8.900.000	(287)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,510	14.01.2025	23.898.900	(780)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,565	27.11.2030	2.740.000	(143)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,580	05.02.2026	5.159.000	(177)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,585	04.12.2024	7.470.000	357	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,585	27.11.2030	2.730.000	(143)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,590	04.12.2024	7.578.000	363	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,635	04.12.2024	5.987.000	289	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,640	01.03.2026	10.523.000	359	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,650	04.12.2024	6.135.000	297	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,740	10.12.2030	5.395.000	(296)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,770	12.02.2031	2.650.000	(102)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		3,000	07.01.2030	4.970.000	(194)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		3,060	08.01.2030	4.500.000	(177)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		3,120	05.02.2030	1.679.000	(66)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		3,215	14.01.2030	9.767.400	392	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		3,420	01.09.2030	3.448.000	141	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		3,470	15.06.2028	17.495.300	594	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		3,520	14.06.2028	2.761.600	81	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		3,640	30.04.2031	4.264.000	184	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		0,650	31.03.2030	CZK 31.300	(5)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		0,690	31.03.2025	557.600	31	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		0,765	07.04.2026	51.100	3	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		0,800	11.05.2030	468.900	(73)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		0,915	01.09.2025	131.000	22	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		0,929	13.03.2030	266.700	(43)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		1,050	23.12.2025	349.100	44	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		1,477	04.02.2030	358.600	65	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		1,733	08.03.2031	66.300	17	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		1,781	04.02.2024	341.600	15	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		1,890	15.01.2030	353.500	77	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		2,250	19.12.2023	1.015.800	327	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		2,255	15.01.2023	1.107.800	(206)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		2,465	19.12.2023	37.200	(13)	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR		0,710	31.03.2025	HUF 3.731.900	65	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR		0,800	14.06.2022	14.350.000	71	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR		0,840	18.08.2022	16.882.300	125	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR		0,960	05.03.2023	3.207.000	(38)	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR		0,980	23.07.2024	7.862.700	1	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR		1,100	03.04.2025	5.436.300	96	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR		1,243	08.09.2025	3.267.500	17	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR		1,330	08.02.2026	3.842.400	(52)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR		1,500	19.06.2024	8.026.600	(183)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR		1,770	24.02.2026	3.824.100	(51)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR		2,680	29.06.2031	610.600	(2)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,250	28.01.2023	PLN 105.800	67	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,565	14.08.2025	45.900	150	0,01
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,585	22.09.2025	33.700	110	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		0,655	21.05.2025	16.600	(35)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,925	16.10.2030	1.500	11	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		1,097	25.02.2027	136.300	487	0,02
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		1,163	03.12.2030	32.800	235	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		1,280	08.02.2031	23.500	(155)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		1,460	28.05.2026	44.900	37	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		1,490	29.08.2029	57.400	(428)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		1,833	05.02.2022	145.900	195	0,01
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		1,835	31.01.2022	28.400	40	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		1,942	20.03.2024	44.900	73	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		2,250	20.03.2024	41.200	(70)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		2,250	19.06.2024	40.000	23	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		2,500	16.03.2026	23.600	(76)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month SGD-SOR		1,750	15.09.2031	SGD 29.700	(53)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽³⁾		28-Day MXN-TIIE	4,290 %	16.02.2023	MXN 403.700	\$ (113)	0,00
Zahlung ⁽³⁾		28-Day MXN-TIIE	4,300	16.02.2023	3.047.700	(853)	(0,03)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,335	21.02.2023	469.700	(189)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾		28-Day MXN-TIIE	4,350	15.02.2023	1.696.700	(476)	(0,02)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,380	04.01.2024	2.095.000	(972)	(0,03)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,470	27.02.2023	53.100	(22)	0,00
Zahlung ⁽³⁾		28-Day MXN-TIIE	4,515	17.08.2022	263.100	(75)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,520	27.02.2023	106.300	(44)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,530	15.11.2022	242.500	(90)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,535	15.11.2022	2.738.200	(187)	(0,01)
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,540	21.02.2024	290.500	137	0,01
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,550	27.02.2023	622.500	(257)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,560	27.02.2023	53.100	(22)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,565	27.02.2023	53.100	(22)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,570	21.02.2024	2.278.800	1.082	0,04
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,590	20.02.2024	200.400	(95)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,610	27.06.2024	496.500	(233)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,670	22.12.2025	434.600	(172)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,680	16.03.2023	159.000	(67)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,695	25.06.2024	488.500	(238)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾		28-Day MXN-TIIE	4,700	25.08.2022	932.700	(269)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,715	24.06.2024	296.900	(145)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,720	06.02.2026	166.200	(65)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,730	06.02.2026	465.100	(181)	(0,01)
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,770	06.01.2026	252.800	105	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,775	26.06.2025	162.100	(68)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,830	22.07.2025	735.900	325	0,01
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,835	24.07.2025	83.500	35	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,840	19.02.2025	244.900	110	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,850	19.02.2025	332.300	150	0,01
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,870	17.06.2024	996.000	(484)	(0,02)
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,870	12.11.2024	127.800	62	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,915	10.04.2023	1.300.000	570	0,02
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,917	11.08.2025	233.500	(100)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,920	10.04.2023	1.157.700	508	0,02
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,943	12.02.2026	83.500	33	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,950	11.02.2026	497.900	199	0,01
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,950	12.02.2026	130.800	52	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	4,970	09.05.2023	894.900	403	0,01
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,970	08.08.2025	12.300	(5)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	4,980	12.08.2025	167.600	(73)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,000	22.02.2023	206.320	(89)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,040	02.05.2023	600.000	285	0,01
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,080	16.06.2025	102.900	(46)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,120	29.09.2025	268.400	115	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,130	14.05.2025	552.400	249	0,01
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,282	29.03.2023	978.700	452	0,02
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,325	09.06.2023	1.888.400	1.213	0,04
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,405	26.12.2030	740.000	(108)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,445	05.12.2030	199.200	(1.083)	(0,04)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,500	22.02.2023	240.700	(108)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,540	31.12.2030	143.700	17	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,590	03.07.2030	172.600	(13)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,605	26.03.2024	260.100	(138)	(0,01)
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,610	03.07.2030	393.000	(29)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,800	06.04.2026	1.005.800	(425)	(0,02)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,810	06.04.2026	1.130.000	(478)	(0,02)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,860	29.03.2023	636.000	(313)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,865	13.06.2030	226.900	8	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,870	12.06.2030	116.800	4	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,880	13.06.2030	140.000	5	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,890	09.03.2023	641.800	(287)	(0,01)
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,893	05.06.2025	940.400	896	0,03
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,893	05.06.2030	282.900	(13)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,918	07.12.2023	608.000	(332)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,925	05.05.2026	785.700	(333)	(0,01)
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,940	23.05.2030	82.600	(5)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,980	12.02.2031	111.200	15	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	5,990	12.02.2031	264.600	36	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	6,000	22.02.2023	160.800	(76)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	6,040	02.05.2030	87.300	(3)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	6,040	12.02.2031	951.600	128	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	6,060	16.05.2030	102.300	(1)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	6,095	29.05.2030	18.700	(1)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	6,210	19.03.2026	122.000	66	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	6,260	07.06.2040	139.400	(152)	(0,01)
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	6,288	25.04.2030	230.700	(9)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	6,300	09.06.2022	125.000	(37)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	6,340	09.12.2021	154.000	(24)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	6,360	22.03.2023	1.252.100	621	0,02
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	6,380	25.02.2025	89.900	(49)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	6,380	05.06.2040	146.300	(148)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,430 %	04.06.2040	MXN 88.600	\$ (90)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,435	18.05.2040	61.000	(65)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,463	18.05.2040	76.000	(81)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,465	26.09.2040	94.900	(97)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,480	28.05.2040	342.800	(357)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,510	09.12.2021	400.000	(67)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,510	24.02.2025	692.800	(377)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,535	09.12.2021	53.600	(9)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,540	09.12.2021	452.900	(179)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,540	31.05.2040	240.300	(247)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,545	30.05.2040	75.100	(78)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,550	04.04.2031	160.200	(22)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,590	15.03.2023	661.000	319	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,600	13.01.2025	341.200	(175)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,600	26.02.2030	418.100	35	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,618	18.01.2030	257.400	15	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,620	02.01.2025	1.144.800	(649)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,623	17.05.2040	132.400	(141)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,630	31.03.2031	272.600	(39)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,635	15.01.2025	800.900	417	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,635	31.03.2031	330.000	(47)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,650	22.09.2021	1.122.100	175	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,658	09.06.2022	148.900	45	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,670	19.06.2026	184.200	(34)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,678	29.05.2031	445.400	(502)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,705	04.12.2029	200.000	(19)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,715	30.05.2031	473.100	(469)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,720	19.06.2026	180.400	(53)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,740	09.12.2021	154.800	28	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,755	29.04.2031	226.900	(33)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,765	20.09.2021	286.200	44	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,830	27.12.2029	35.500	4	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,845	02.11.2029	149.300	19	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,855	20.03.2025	884.200	573	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,065	26.12.2039	142.800	(149)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,127	10.08.2039	204.800	208	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,180	27.06.2024	1.133.700	613	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,180	31.10.2039	118.500	(123)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,200	31.10.2039	102.500	(106)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,210	28.02.2030	306.000	(8)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,210	28.10.2039	49.700	(52)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,220	28.02.2030	298.800	(8)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,253	28.10.2039	99.600	(104)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,625	12.07.2039	163.200	164	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,640	13.07.2039	117.200	117	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,650	24.02.2023	842.300	(460)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,675	04.06.2029	516.000	297	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,675	09.06.2039	438.200	446	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,720	24.03.2023	1.797.500	1.009	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,730	23.03.2023	6.500	5	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,830	15.12.2022	395.300	(177)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,856	15.12.2022	381.800	(171)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,865	13.05.2024	550.800	337	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,875	16.12.2022	55.900	(25)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,880	27.12.2022	505.000	(259)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,885	27.05.2039	470.900	444	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,895	21.02.2040	200.000	207	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,910	07.12.2023	546.000	358	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,920	28.12.2023	144.400	(111)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,977	17.03.2028	942.600	(358)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,990	16.03.2028	3.000	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,990	17.02.2040	15.800	17	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		8,103	04.01.2038	6.300	(5)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		8,110	03.05.2029	400.300	85	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,135	07.05.2029	326.100	(76)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,155	19.04.2029	95.700	(28)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,300	17.02.2040	123.300	129	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,320	07.01.2032	195.200	32	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,390	31.05.2029	559.600	(122)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,818	16.11.2023	1.191.500	(687)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,910	15.11.2023	602.400	(454)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,980	23.11.2023	1.096.000	(686)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		9,100	09.11.2028	722.200	202	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		9,210	08.11.2028	477.700	225	0,01
						\$ (1.201)	(0,04)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (1.200)	(0,04)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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,

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund (Forts.)

(ii) oder 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettover-mögens
BOA	Call – OTC USD versus INR	INR 92,600	16.06.2025	2.200	\$ 132	\$ 88	0,00
	Put – OTC USD versus INR	92,600	16.06.2025	2.200	132	173	0,01
GLM	Put – OTC USD versus BRL	BRL 5,000	10.12.2021	23.281	588	673	0,02
	Call – OTC USD versus BRL	5,800	15.02.2022	29.832	1.503	562	0,02
	Put – OTC USD versus RUB	RUB 71,800	10.09.2021	60.259	868	487	0,02
JPM	Put – OTC USD versus CNH	CNH 6,250	18.02.2022	63.170	66	28	0,00
MYI	Put – OTC EUR versus HUF	HUF 350,000	21.09.2021	23.416	169	238	0,01
	Put – OTC USD versus BRL	BRL 5,400	22.07.2021	30.614	784	2.310	0,08
	Call – OTC USD versus MXN	MXN 20,500	27.07.2021	52.800	267	232	0,01
	Put – OTC USD versus MXN	19,700	10.06.2022	60.259	1.299	903	0,03
					\$ 5.808	\$ 5.694	0,20

VERKAUFSOPTIONEN

DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettover-mögens
BOA	Call – OTC USD versus INR	INR 81,000	27.04.2022	3.367	\$ (55)	\$ (33)	0,00
GLM	Put – OTC USD versus BRL	BRL 4,825	10.12.2021	23.281	(315)	(364)	(0,01)
	Put – OTC USD versus BRL	5,000	15.02.2022	29.832	(764)	(950)	(0,03)
	Call – OTC USD versus BRL	6,300	15.02.2022	29.832	(866)	(273)	(0,01)
	Put – OTC USD versus RUB	RUB 70,000	10.09.2021	60.259	(346)	(156)	(0,01)
JPM	Call – OTC USD versus INR	INR 80,000	27.01.2022	1.407	(19)	(9)	0,00
MYI	Put – OTC EUR versus HUF	HUF 343,000	21.09.2021	46.832	(103)	(156)	(0,01)
	Put – OTC USD versus BRL	BRL 5,300	22.07.2021	61.228	(1.098)	(3.483)	(0,13)
	Put – OTC USD versus MXN	MXN 19,100	10.06.2022	60.259	(724)	(479)	(0,02)
UAG	Call – OTC USD versus INR	INR 81,000	02.05.2022	3.234	(49)	(33)	0,00
	Call – OTC USD versus TRY	TRY 12,000	27.10.2021	5.300	(238)	(39)	0,00
					\$ (4.577)	\$ (5.975)	(0,22)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettover-mögens
BPS	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.12.2024	\$ 21.400	\$ (34)	\$ 175	\$ 141	0,01
BRC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2025	6.900	358	(270)	88	0,00
					\$ 324	\$ (95)	\$ 229	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettover-mögens
BRC	Eskom Holdings SOC Ltd.	1,000 %	20.12.2021	\$ 6.900	\$ (149)	\$ 107	\$ (42)	0,00
	Nigeria Government International Bond	5,000	20.12.2021	3.800	204	(123)	81	0,00
CBK	Trust Fibra Uno	1,000	20.06.2022	1.800	(12)	(6)	(18)	0,00
DUB	Egypt Government International Bond	5,000	20.06.2022	5.300	182	3	185	0,01
FBF	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2021	6.900	(589)	581	(8)	0,00
JPM	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	5.500	(24)	70	46	0,00
MYC	Eskom Holdings SOC Ltd.	1,000	20.06.2022	2.300	(44)	9	(35)	0,00
					\$ (432)	\$ 641	\$ 209	0,01

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

(2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR zzgl. 0,223 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	16.04.2024	TRY 11.800	\$ 2.042	\$ 14	\$ (544)	\$ (530)	(0,02)
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,330 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	28.05.2024	\$ 1.900	ARS 85.633	0	1.445	1.445	0,05
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,333 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	30.05.2024	4.820	214.249	(15)	3.694	3.679	0,14
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	2.090	93.789	(3)	1.665	1.662	0,06
						\$ (4)	\$ 6.260	\$ 6.256	0,23

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,295 %	08.09.2025	ILS 89.000	\$ 0	\$ 144	\$ 144	0,01
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,680	08.09.2030	44.500	0	(456)	(456)	(0,02)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,800	24.04.2028	153.200	0	48	48	0,00
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,963	16.02.2028	21.300	(2)	538	536	0,02
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	13.700	0	330	330	0,01
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,197	18.03.2025	KRW 96.335.000	0	1.098	1.098	0,04
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	16.06.2031	MYR 96.440	39	84	123	0,00
BPS	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,420	23.01.2022	KRW 250.108.300	0	(1.014)	(1.014)	(0,04)
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,450	23.01.2025	101.061.200	0	(158)	(158)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	16.06.2031	MYR 15.900	30	(10)	20	0,00
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,588	16.12.2022	THB 1.342.900	0	(116)	(116)	0,00
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,771	16.12.2025	528.000	0	95	95	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,408	18.03.2030	80.100	0	10	10	0,00
BRC	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,795	20.06.2028	ILS 32.000	0	38	38	0,00
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	34.500	0	796	796	0,03
BSH	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,300	21.06.2029	CLP 3.450.000	0	237	237	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,750	22.03.2026	8.000.000	0	296	296	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,790	14.03.2026	3.885.000	7	151	158	0,01
CBK	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,155	05.07.2022	COP 81.320.800	0	(386)	(386)	(0,01)
	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,960	10.05.2029	27.236.900	0	(205)	(205)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,485	09.08.2024	ILS 68.500	0	(188)	(188)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,950	23.05.2024	122.500	0	(737)	(737)	(0,03)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,041	15.05.2024	101.800	0	700	700	0,03
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	16.06.2031	MYR 3.610	2	3	5	0,00
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,763	24.05.2029	CLP 1.841.700	10	(42)	(32)	0,00
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,770	19.03.2026	64.800	0	3	3	0,00
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,195	17.03.2031	THB 451.700	0	332	332	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,625	27.07.2025	97.500	0	246	246	0,01
CKL	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	ILS 14.000	(46)	413	367	0,01
DUB	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,690	27.09.2027	20.100	0	(6)	(6)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,580	19.10.2025	THB 76.700	0	182	182	0,01
FBF	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,780	23.09.2025	20.740	0	56	56	0,00
GLM	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,235	15.01.2023	ILS 198.900	0	133	133	0,01
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,520	12.08.2024	93.500	0	(295)	(295)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,540	11.05.2027	11.600	0	(32)	(32)	0,00
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,720	20.06.2028	8.800	0	24	24	0,00
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,820	15.01.2030	43.800	0	205	205	0,01
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,950	23.05.2024	75.700	0	(455)	(455)	(0,02)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,960	24.05.2024	70.700	0	(431)	(431)	(0,02)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,048	27.02.2024	132.400	0	977	977	0,04
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,883	21.03.2028	28.100	0	647	647	0,02
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,898	17.12.2025	57.400	0	1.256	1.256	0,05
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	43.600	(3)	1.108	1.105	0,04
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	28.300	0	682	682	0,03
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,193	18.03.2022	KRW 219.935.000	0	448	448	0,02
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	16.06.2031	MYR 340	0	0	0	0,00
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,990	01.08.2029	CLP 2.813.100	0	(245)	(245)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettover- mögens	
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,015 %	20.06.2026	CLP	5.555.000	\$ 0	\$ 153	153	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,265	14.06.2029		4.122.200	0	(291)	(291)	(0,01)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,455	02.06.2022		8.596.000	0	227	227	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,535	14.11.2022		3.595.100	0	122	122	0,00
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,830	22.05.2029		7.729.900	0	(81)	(81)	0,00
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,095	01.06.2027		12.230.000	0	437	437	0,02
	Zahlung ⁽¹⁾	6-Month CLP-CHILIBOR	4,319	22.05.2029		19.808.000	0	(479)	(479)	(0,02)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,868	18.03.2025	THB	3.183.000	0	373	373	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,833	19.06.2026		565.300	535	212	747	0,03
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,990	08.06.2023		827.500	673	76	749	0,03
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,110	26.01.2022		1.232.500	711	(21)	690	0,03
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,175	19.06.2029		4.900	0	10	10	0,00
HUS	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,186	19.06.2029		52.400	0	108	108	0,00
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,018	11.03.2024	ILS	82.600	0	583	583	0,02
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,018	15.05.2024		91.500	0	610	610	0,02
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028		14.900	1	358	359	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,990	08.06.2023	THB	957.400	0	867	867	0,03
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,110	26.01.2022		101.200	0	56	56	0,00
JPM	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,475	09.08.2024	ILS	71.500	0	(188)	(188)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,813	20.06.2028		18.100	0	15	15	0,00
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,027	19.03.2024		37.000	0	263	263	0,01
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,095	10.05.2024		19.800	0	147	147	0,01
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,078	20.06.2028		12.600	0	325	325	0,01
MYC	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,540	04.06.2029	CLP	4.115.000	0	170	170	0,01
	Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,800	04.01.2027	BRL	12.200	17	72	89	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	16.06.2031	MYR	13.150	31	(14)	17	0,00
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,715	16.09.2022	THB	1.354.800	0	(224)	(224)	(0,01)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,816	18.03.2022		3.309.900	0	(498)	(498)	(0,02)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,963	16.09.2025		327.500	0	(57)	(57)	0,00
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,970	16.09.2030		392.300	0	476	476	0,02
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,110	24.01.2022		4.380.500	0	1.085	1.085	0,04
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,130	16.06.2026		415.500	88	15	103	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,190	17.03.2031		77.000	0	(58)	(58)	0,00
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,265	24.01.2025		1.788.600	0	(1.172)	(1.172)	(0,04)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,600	16.06.2031		205.000	9	56	65	0,00
MYI	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,340	18.09.2029	MYR	1.700	0	12	12	0,00
SCX	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,209	15.01.2025	THB	1.752.900	0	(1.028)	(1.028)	(0,04)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,585	17.03.2031		252.900	0	107	107	0,00
							\$ 2.102	\$ 9.328	\$ 11.430	0,41

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt Volatilität	Referenzeinheit	Volatilität Ausübungs- kurs	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettover- mögens	
BOA	Zahlung	USD versus MXN 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	14,400	24.11.2021	\$ 47	\$ 0	\$ 145	\$ 145	0,01	
CBK	Zahlung	USD versus MXN 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	15,100	05.11.2021	36	0	136	136	0,00	
	Zahlung	USD versus TWD 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	5,400	03.05.2022	49	0	(8)	(8)	0,00	
	Zahlung	USD versus ZAR 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	16,600	05.11.2021	36	0	93	93	0,00	
DUB	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	6,425	05.11.2021	72	0	166	166	0,01	
GLM	Zahlung	USD versus BRL 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	18,300	05.11.2021	36	0	26	26	0,00	
	Zahlung	USD versus BRL 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	18,825	23.11.2021	47	0	69	69	0,00	
	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	6,275	12.01.2022	61	0	113	113	0,00	
JPM	Erhalt	EUR versus USD 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	6,550	03.05.2022	41	0	(21)	(21)	0,00	
	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	6,350	24.11.2021	93	0	216	216	0,01	
	Zahlung	USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	6,850	22.10.2021	55	0	102	102	0,00	
	Zahlung	USD versus RUB 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	15,700	03.11.2021	36	0	149	149	0,01	
	Zahlung	USD versus TWD 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	5,300	22.04.2022	50	0	(10)	(10)	0,00	
MYI	Zahlung	USD versus RUB 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	15,500	23.11.2021	47	0	183	183	0,01	
	Zahlung	USD versus ZAR 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	16,000	24.11.2021	47	0	100	100	0,00	
							\$ 0	\$ 1.459	\$ 1.459	0,05

⁽¹⁾ Varianz-Swap

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens	
AZD	09.2021	PHP	475.651	\$ 9.777	\$ 93	\$ 0	93	0,00
BOA	07.2021	MXN	367.593	18.469	84	(50)	34	0,00
	07.2021	RUB	310.214	4.253	18	0	18	0,00
	07.2021	\$	112.957	BRL 598.310	6.279	0	6.279	0,23
	07.2021		15.722	MXN 312.276	0	(61)	(61)	0,00
	07.2021		10.437	PEN 40.463	130	0	130	0,00
	07.2021		4.956	RUB 359.026	0	(54)	(54)	0,00
	07.2021		65.550	THB 2.052.887	0	(1.499)	(1.499)	(0,05)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	08.2021	€ 54.043	\$ 65.649	\$ 1.499	0	\$ 1.499	0,05
	08.2021	\$ 14.905	CAD 17.983	0	(383)	(383)	(0,01)
	08.2021	1.328	CHF 1.198	0	(30)	(30)	0,00
	08.2021	51.100	CZK 1.063.781	0	(1.658)	(1.658)	(0,06)
	08.2021	14.560	HUF 4.367.945	187	0	187	0,01
	08.2021	1.619	RUB 121.747	36	0	36	0,00
	09.2021	IDR 107.027.151	\$ 7.426	130	0	130	0,00
	09.2021	MYR 56.117	13.437	0	(32)	(32)	0,00
	09.2021	PHP 241.627	4.959	39	0	39	0,00
	09.2021	\$ 5.637	CNY 36.255	0	(54)	(54)	0,00
	09.2021	9.270	INR 682.478	0	(170)	(170)	(0,01)
	09.2021	1.981	KZT 863.716	14	0	14	0,00
	09.2021	6.758	MYR 28.176	5	0	5	0,00
	09.2021	11.803	PLN 43.415	0	(396)	(396)	(0,01)
	09.2021	3.006	RUB 219.340	0	(37)	(37)	0,00
	09.2021	2.870	THB 89.633	0	(74)	(74)	0,00
	09.2021	99.749	ZAR 1.421.684	0	(1.116)	(1.116)	(0,04)
	09.2021	ZAR 54.323	\$ 3.933	165	0	165	0,01
	11.2021	\$ 16.968	CLP 12.248.505	0	(212)	(212)	(0,01)
	11.2021	7.860	RON 32.125	0	(171)	(171)	(0,01)
	02.2022	49.954	ZAR 729.874	116	(506)	(390)	(0,01)
	02.2022	ZAR 848.488	\$ 56.898	199	(939)	(740)	(0,03)
BPS	07.2021	BRL 13.516	2.630	0	(64)	(64)	0,00
	07.2021	£ 403	561	5	0	5	0,00
	07.2021	¥ 5.349	49	1	0	1	0,00
	07.2021	THB 214.994	6.908	199	0	199	0,01
	07.2021	TRY 89.421	10.106	0	(37)	(37)	0,00
	07.2021	\$ 4.011	BRL 20.053	0	(15)	(15)	0,00
	07.2021	126	€ 105	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	15.384	MXN 305.147	0	(81)	(81)	0,00
	07.2021	4.304	RUB 321.082	79	0	79	0,00
	08.2021	HUF 5.162.849	\$ 17.306	0	(125)	(125)	0,00
	08.2021	MXN 24.352	1.142	0	(76)	(76)	0,00
	08.2021	\$ 14.912	AUD 19.098	0	(571)	(571)	(0,02)
	08.2021	42.142	HUF 12.205.302	230	(1.163)	(933)	(0,03)
	09.2021	IDR 41.247.612	\$ 2.814	2	0	2	0,00
	09.2021	KRW 8.825.333	7.791	0	(17)	(17)	0,00
	09.2021	THB 297.969	9.484	190	0	190	0,01
	09.2021	\$ 3.951	IDR 56.806.956	0	(78)	(78)	0,00
	09.2021	45.753	MYR 190.116	0	(121)	(121)	0,00
	09.2021	29.986	PLN 113.826	0	(80)	(80)	0,00
	09.2021	23.311	THB 731.865	0	(483)	(483)	(0,02)
	09.2021	6.411	ZAR 92.236	0	(12)	(12)	0,00
	09.2021	ZAR 210.618	\$ 14.771	159	0	159	0,01
	11.2021	ILS 7.358	2.246	0	(16)	(16)	0,00
	11.2021	\$ 62.958	MXN 1.270.926	0	(182)	(182)	(0,01)
	02.2022	3.540	VND 81.597.000	0	(18)	(18)	0,00
	02.2022	ZAR 900.620	\$ 59.395	0	(1.761)	(1.761)	(0,06)
	06.2022	\$ 2.556	MXN 52.641	0	(41)	(41)	0,00
BRC	07.2021	RUB 560.347	\$ 7.715	65	0	65	0,00
	07.2021	\$ 55.003	MXN 1.120.603	1.109	0	1.109	0,04
	08.2021	€ 635	\$ 760	6	0	6	0,00
	08.2021	HUF 495.688	1.709	35	0	35	0,00
	08.2021	\$ 27.950	€ 23.436	0	(131)	(131)	0,00
	08.2021	4.377	HUF 1.295.969	1	(3)	(2)	0,00
	08.2021	40.909	MXN 847.851	1.499	0	1.499	0,05
	09.2021	MYR 294.361	\$ 71.013	356	(7)	349	0,01
	09.2021	\$ 23.209	MYR 96.759	32	(13)	19	0,00
	09.2021	16.980	PLN 64.608	0	(5)	(5)	0,00
	02.2022	2.783	ZAR 40.754	0	(14)	(14)	0,00
BSS	07.2021	312	PEN 1.189	0	(2)	(2)	0,00
	09.2021	1.095	UYU 49.772	36	0	36	0,00
	11.2021	4.509	CLP 3.278.109	0	(25)	(25)	0,00
	01.2022	BRL 28.824	\$ 4.936	0	(663)	(663)	(0,02)
CBK	07.2021	359.915	73.273	1.546	0	1.546	0,06
	07.2021	MXN 1.057.960	52.142	150	(1.074)	(924)	(0,03)
	07.2021	PEN 96.889	26.469	1.194	(41)	1.153	0,04
	07.2021	RSD 1.512.081	€ 12.818	0	(43)	(43)	0,00
	07.2021	THB 739.042	\$ 23.692	633	0	633	0,02
	07.2021	\$ 2.896	PEN 10.974	0	(30)	(30)	0,00
	07.2021	726	RUB 56.094	40	0	40	0,00
	07.2021	14.661	THB 458.666	0	(351)	(351)	(0,01)
	08.2021	COP 140.333.902	\$ 37.860	352	0	352	0,01
	08.2021	\$ 73.045	BRL 359.915	0	(1.552)	(1.552)	(0,06)
	08.2021	18.712	COP 70.388.168	102	0	102	0,00
	08.2021	103.524	HUF 31.130.455	1.583	0	1.583	0,06
	08.2021	4.842	PEN 17.791	23	(209)	(186)	(0,01)
	08.2021	1.477	RUB 110.991	32	0	32	0,00
	08.2021	21.984	THB 686.490	0	(568)	(568)	(0,02)
	08.2021	891	UAH 25.239	23	0	23	0,00
	08.2021	7.806	UYU 344.246	47	(9)	38	0,00
	09.2021	CLP 1.467.929	\$ 2.023	11	0	11	0,00
	09.2021	IDR 128.102.950	8.894	161	0	161	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
	09.2021	INR	10.456	\$	140	\$	0	0,00	
	09.2021	PHP	1.023		21		0	0,00	
	09.2021	\$	37.409	MXN	771.659		1.051	0,04	
	09.2021		494	THB	15.785		(2)	0,00	
	09.2021		8.395	UYU	371.153		0	0,00	
	09.2021		32.373	ZAR	464.071		(181)	(0,01)	
	09.2021	ZAR	176.599	\$	12.807		555	0,02	
	10.2021	PEN	210.787		55.487		(70)	0,01	
	10.2021	\$	1.747	KES	192.563		(10)	0,00	
	11.2021	ILS	49.210	\$	15.231		0	0,00	
	11.2021	PEN	32.051		8.381		(6)	0,00	
	12.2021	\$	2.751	PEN	10.319		(52)	0,00	
	01.2022		240		875		(11)	0,00	
	02.2022	ILS	5.781	\$	1.760		(20)	0,00	
	02.2022	\$	39.570	ZAR	584.720		(831)	0,01	
	02.2022	ZAR	199.701	\$	12.470		(1.090)	(0,04)	
	03.2022	THB	48.367		1.534		0	0,00	
	04.2022	ILS	43.200		13.197		(120)	0,00	
	06.2022		102.295		31.523		(48)	0,00	
	06.2022	\$	4.042	VND	92.897.286		(48)	0,00	
	08.2022	ILS	173.057	\$	52.360		(1.106)	(0,04)	
DUB	08.2021	COP	20.627.717		5.493		(20)	0,00	
	09.2021	MYR	55.597		13.298		(47)	0,00	
	09.2021	\$	9.915	MYR	41.014		(71)	0,00	
	09.2021		5.517	RUB	401.831		(72)	0,00	
GLM	07.2021	BRL	23.658	\$	4.658		(57)	0,00	
	07.2021	DOP	772.894		13.351		(174)	(0,01)	
	07.2021	MXN	2.710.131		133.393		(2.444)	(0,09)	
	07.2021	PEN	112.356		30.763		0	0,05	
	07.2021	RUB	1.260.210		17.283		0	0,00	
	07.2021	\$	8.654	DOP	494.706		6	0,00	
	07.2021		26.180	MXN	522.729		(37)	0,00	
	07.2021		9.178	PEN	35.626		(15)	0,00	
	07.2021		5.903	RUB	435.385		(24)	0,00	
	08.2021	COP	6.848.756	\$	1.868		0	0,00	
	08.2021	DOP	128.132		2.169		(70)	0,00	
	08.2021	HUF	5.517.880		18.975		(16)	0,01	
	08.2021	\$	18.773	COP	69.930.335		(82)	0,00	
	08.2021		438	HUF	128.549		(4)	0,00	
	08.2021		98.118	MXN	2.011.534		0	0,08	
	08.2021		2.553	RUB	190.378		(3)	0,00	
	09.2021	DOP	1.088.489	\$	18.780		(135)	0,00	
	09.2021	MYR	37.835		9.152		69	0,00	
	09.2021	PHP	888.427		18.247		0	0,01	
	09.2021	PLN	16.482		4.324		(7)	0,00	
	09.2021	RUB	987.035		13.534		0	0,01	
	09.2021	THB	118.726		3.803		0	0,00	
	09.2021	\$	6.964	CNH	45.298		0	0,00	
	09.2021		1.990	DOP	114.667		0	0,00	
	09.2021		368	HKD	2.857		0	0,00	
	09.2021		12.914	KZT	5.623.041		0	0,00	
	09.2021		118.717	PLN	449.783		(544)	(0,02)	
	09.2021		4.380	RUB	320.965		(35)	0,00	
	09.2021		2.604	THB	83.489		(5)	0,00	
	09.2021		2.057	TWD	56.350		(25)	0,00	
	09.2021	ZAR	213.907	\$	15.508		668	0,02	
	10.2021	DOP	833.471		14.429		(16)	0,00	
	11.2021	RON	18.831		4.519		0	0,00	
	11.2021	\$	2.782	KZT	1.230.902		19	0,00	
	11.2021		2.893	PEN	10.843		(56)	0,00	
	12.2021	BRL	18.144	\$	3.496		(40)	0,00	
	12.2021	SGD	864		642		0	0,00	
	02.2022	\$	12.832	BRL	70.961		845	0,03	
	02.2022		47.904	ZAR	713.357		(113)	0,02	
	02.2022	ZAR	566.712	\$	36.240		(2.276)	(0,08)	
	03.2022	THB	59.091		1.850		8	0,00	
	04.2022	ILS	79.592		24.244		(292)	(0,01)	
HUS	07.2021	£	780		1.105		0	0,00	
	07.2021	\$	88.811	MXN	1.799.474		(27)	1.454	0,05
	07.2021		2.295	TRY	20.307		0	0,00	
	08.2021	COP	15.135.178	\$	4.030		(16)	0,00	
	08.2021	CZK	66.440		3.095		7	0,00	
	08.2021	€	27.144		33.161		941	0,03	
	08.2021	\$	2.773	PEN	10.599		0	0,00	
	08.2021		3.327	RUB	250.462		79	0,00	
	09.2021	CNH	524.001	\$	81.534		833	0,03	
	09.2021	CNY	75.564		11.719		84	0,00	
	09.2021	IDR	42.936.056		2.994		67	0,00	
	09.2021	MYR	37.233		8.942		5	0,00	
	09.2021	PLN	87.632		23.397		373	0,01	
	09.2021	\$	8.693	CNH	56.374		(11)	0,00	
	09.2021		3.878	IDR	56.401.904		(33)	0,00	
	09.2021		7.338	KRW	8.174.836		(105)	0,00	

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	09.2021	\$ 5.665	MYR 23.479	\$ 0	\$ (30)	\$ (30)	0,00
	09.2021	49.719	PLN 187.798	192	(570)	(378)	(0,01)
	09.2021	1.577	RUB 115.487	0	(13)	(13)	0,00
	09.2021	3.601	THB 114.717	0	(23)	(23)	0,00
	09.2021	ZAR 144.456	\$ 10.028	6	0	6	0,00
	10.2021	\$ 8.506	PEN 32.020	0	(125)	(125)	0,00
	11.2021	ILS 7.544	\$ 2.326	6	0	6	0,00
	12.2021	PEN 31.810	8.600	280	0	280	0,01
	01.2022	BRL 8.217	1.430	0	(166)	(166)	(0,01)
	01.2022	ILS 72.332	22.003	0	(267)	(267)	(0,01)
	02.2022	\$ 18.899	ZAR 289.535	780	0	780	0,03
	03.2022	THB 361.556	\$ 11.363	91	0	91	0,00
	07.2022	\$ 25.000	EGP 432.250	0	(33)	(33)	0,00
	07.2023	EGP 469.250	\$ 25.000	0	(53)	(53)	0,00
IND	08.2021	\$ 58.249	CZK 1.214.332	0	(1.809)	(1.809)	(0,07)
	09.2021	MYR 17.700	\$ 4.287	38	0	38	0,00
	09.2021	THB 164.705	5.228	90	0	90	0,00
	09.2021	\$ 7.169	MYR 29.879	4	0	4	0,00
	09.2021	1.419	THB 44.692	0	(25)	(25)	0,00
	09.2021	10.994	ZAR 156.738	0	(121)	(121)	0,00
	06.2022	TWD 191.965	\$ 7.214	122	0	122	0,00
JPM	06.2024	\$ 7.206	TWD 185.403	0	(86)	(86)	0,00
	07.2021	MXN 220.205	\$ 10.843	0	(200)	(200)	(0,01)
	07.2021	PEN 20.369	5.417	98	0	98	0,00
	07.2021	TRY 39.454	4.476	0	(3)	(3)	0,00
	07.2021	\$ 16.967	BRL 87.104	395	(3)	392	0,01
	07.2021	247	ILS 802	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	23.194	TRY 205.060	90	0	90	0,00
	08.2021	CAD 11.138	\$ 9.061	66	0	66	0,00
	08.2021	COP 32.522.054	8.811	138	(20)	118	0,00
	08.2021	€ 3.058	3.730	101	0	101	0,00
	08.2021	UAH 12.455	448	0	(3)	(3)	0,00
	08.2021	\$ 21.935	EGP 351.929	176	0	176	0,01
	09.2021	INR 411.308	\$ 5.489	5	0	5	0,00
	09.2021	TWD 210.748	7.641	42	0	42	0,00
	09.2021	\$ 8.017	RUB 584.560	0	(95)	(95)	0,00
	09.2021	12.251	ZAR 177.846	86	0	86	0,00
	10.2021	KES 65.649	\$ 554	0	(38)	(38)	0,00
	10.2021	\$ 1.757	KES 193.748	0	(11)	(11)	0,00
	12.2021	PHP 817.527	\$ 16.935	385	0	385	0,01
	01.2022	BRL 5.615	961	0	(130)	(130)	0,00
	02.2022	\$ 17.484	ZAR 259.057	124	0	124	0,00
	04.2022	TRY 251.392	\$ 25.613	687	0	687	0,02
	04.2022	UAH 107.665	3.463	0	(163)	(163)	(0,01)
	03.2030	IDR 252.540.875	12.118	162	0	162	0,01
MYI	03.2030	\$ 11.598	IDR 246.110.438	53	0	53	0,00
	07.2021	£ 198	\$ 275	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 6.851	BRL 34.309	0	(13)	(13)	0,00
	07.2021	571	ILS 1.864	1	0	1	0,00
	07.2021	33.524	PEN 122.314	0	(1.583)	(1.583)	(0,06)
	07.2021	880	RUB 67.380	40	0	40	0,00
	08.2021	EGP 438.333	\$ 27.209	0	(343)	(343)	(0,01)
	08.2021	€ 24.819	30.266	805	0	805	0,03
	08.2021	UAH 76.618	2.764	0	(11)	(11)	0,00
	08.2021	\$ 19.337	CZK 405.954	0	(470)	(470)	(0,02)
	09.2021	HUF 863.005	€ 2.431	0	(24)	(24)	0,00
	09.2021	PLN 54.652	\$ 14.329	0	(30)	(30)	0,00
	09.2021	THB 225.282	7.214	187	0	187	0,01
	09.2021	\$ 4.686	KZT 2.037.900	22	0	22	0,00
	09.2021	8.844	MYR 36.873	23	(15)	8	0,00
	09.2021	21.197	PLN 79.857	0	(216)	(216)	(0,01)
	09.2021	2.732	ZAR 38.978	0	(28)	(28)	0,00
	09.2021	ZAR 41.992	\$ 2.941	28	0	28	0,00
	10.2021	\$ 739	TRY 7.387	62	0	62	0,00
	11.2021	4.028	KZT 1.777.355	16	0	16	0,00
	11.2021	2.258	MXN 45.779	0	0	0	0,00
	12.2021	3.496	BRL 18.137	39	0	39	0,00
	01.2022	ILS 11.500	\$ 3.520	0	(21)	(21)	0,00
RYL	06.2022	MXN 185.932	9.039	154	0	154	0,01
	09.2021	KZT 2.429.100	5.476	0	(136)	(136)	(0,01)
	09.2021	\$ 2.718	KZT 1.182.330	13	0	13	0,00
	11.2021	1.175	519.644	7	0	7	0,00
SCX	07.2021	PEN 130.855	\$ 32.874	0	(1.298)	(1.298)	(0,05)
	07.2021	\$ 162	MXN 3.230	0	0	0	0,00
	07.2021	4.519	PEN 17.605	79	0	79	0,00
	07.2021	4.462	RUB 323.213	0	(49)	(49)	0,00
	08.2021	18.151	\$ 13.769	140	0	140	0,01
	08.2021	EGP 47.000	2.899	0	(69)	(69)	0,00
	08.2021	HUF 453.767	1.523	0	(9)	(9)	0,00
	08.2021	\$ 18.023	CZK 375.387	0	(576)	(576)	(0,02)
	08.2021	360	HUF 107.995	4	0	4	0,00
	08.2021	2.569	PEN 9.809	0	(2)	(2)	0,00
	09.2021	4.531	IDR 65.986.725	0	(33)	(33)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
	09.2021	\$	13.660	MYR 56.585	\$ 0	\$ (79)	0,00	
	09.2021		32.902	PEN 130.855	1.356	0	1,356	
	10.2021	KES	320.661	\$ 2.706	0	(186)	(0,01)	
	01.2022	BRL	34.263	5.863	0	(792)	(0,03)	
	02.2022	\$	1.981	ZAR 28.850	0	(20)	0,00	
	03.2022	THB	245.825	\$ 7.743	80	0	80	
	03.2030	IDR	239.680.000	10.700	0	(647)	(0,02)	
SOG	07.2021	\$	825	RUB 64.072	50	0	50	
	08.2021	CZK	31.426	\$ 1.498	37	0	37	
	08.2021	\$	1.845	RUB 139.188	47	0	47	
	09.2021	CNY	34.986	\$ 5.381	0	(6)	(0,00)	
	09.2021	IDR	79.212.550	5.407	7	0	7	
SSB	07.2021	BRL	586.548	117.404	1.590	(1.078)	512	
	07.2021	£	434	615	16	0	16	
	07.2021	MXN	64.074	3.101	0	(112)	(0,00)	
	07.2021	\$	47.447	BRL 251.320	2.638	0	2.638	
	07.2021		361	MXN 7.226	1	0	1	
	08.2021		99.581	BRL 493.226	0	(1.608)	(1.608)	
	09.2021	MYR	9.294	\$ 2.253	22	0	22	
	09.2021	\$	6.045	MYR 25.273	22	0	22	
	02.2022		7.501	ZAR 105.082	0	(366)	(366)	
TOR	07.2021	€	1.294	\$ 1.540	6	0	6	
	08.2021	HUF	563.455	1.877	0	(25)	(25)	
UAG	07.2021	BRL	63.313	12.467	0	(151)	(151)	
	07.2021	ILS	10.681	3.288	10	0	10	
	07.2021	\$	11.180	BRL 55.854	44	(93)	(49)	
	07.2021		487	MXN 9.732	1	0	1	
	07.2021		10.511	RUB 770.118	107	(104)	3	
	08.2021	AUD	19.188	\$ 14.707	299	0	299	
	08.2021	CAD	6.927	5.624	30	0	30	
	08.2021	CZK	195.040	9.284	219	0	219	
	08.2021	\$	108	CZK 2.318	0	0	0	
	09.2021		2.132	RUB 156.412	0	(15)	(15)	
	10.2021	TRY	7.387	\$ 748	0	(53)	(53)	
	02.2022	ZAR	49.072	3.292	0	(40)	(40)	
	06.2022	\$	6.483	MXN 133.362	0	(110)	(110)	
	01.2023		5.652	TWD 146.785	0	(151)	(151)	
					\$ 45.623	\$ (42.141)	\$ 3.482	0,13
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 22.784	0,82	
Summe Anlagen						\$ 3.253.796	117,54	
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (485.461)	(17,54)	
Nettovermögen						\$ 2.768.335	100,00	

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
JPMorgan Structured Products BV	3,550 %	29.12.2021	04.02.2021	\$ 7.786	\$ 7.709	0,28
JPMorgan Structured Products BV	3,650	14.10.2024	18.10.2019	5.143	5.149	0,19
JPMorgan Structured Products BV	11,750	17.06.2022	10.02.2021 - 11.02.2021	6.941	6.973	0,25
JPMorgan Structured Products BV	12,000	28.08.2026 - 04.01.2027	15.06.2021	2.751	2.527	0,09
JPMorgan Structured Products BV	14,000	28.05.2031 - 09.12.2031	24.05.2021	4.479	4.509	0,17
JPMorgan Structured Products BV	14,910	14.10.2022	11.01.2021	1.294	1.309	0,05
JPMorgan Structured Products BV	16,060	05.08.2022	05.03.2021	7.232	7.296	0,26
JPMorgan Structured Products BV	17,250	07.01.2022	12.01.2021	3.381	3.531	0,13
QNB Finance Ltd.	7,900	05.07.2024	26.06.2019	12.585	12.812	0,46
Sunac China Holdings Ltd.	5,950	30.12.2021	11.01.2021	9.799	9.807	0,35
				\$ 61.391	\$ 61.622	2,23

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 528.294 und Barmittel in Höhe von USD 7.870 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 14.082 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 12.278 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) ⁽³⁾	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.873.413	\$ 209.682	\$ 3.083.095
Investmentfonds	116.540	32.577	0	149.117
Finanzderivate ⁽⁴⁾	0	21.602	(18)	21.584
Summen	\$ 116.540	\$ 2.927.592	\$ 209.664	\$ 3.253.796

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.883.652	\$ 289.170	\$ 3.172.822
Investmentfonds	204.721	0	0	204.721
Finanzderivate ⁽⁴⁾	0	104.819	0	104.819
Summen	\$ 204.721	\$ 2.988.471	\$ 289.170	\$ 3.482.362

Es folgt eine Zusammenfassung wesentlicher nicht beobachtbarer Inputfaktoren, die bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva innerhalb von Stufe 3 der Bemessungshierarchie (Fair-Value-Hierarchie) angewandt werden:

Kategorie und Unterkategorie	Marktwert zum 31. Dez. 2020	Bewertungsmethode	Nicht beobachtbare Inputfaktoren	Input-Wert(e) (in % falls nicht anders angegeben)
Übertragbare Wertpapiere				
Unternehmensanleihen und Wechsel	\$ 46.644	Indikative Notierung	Broker-Preisfestsetzung	\$ 106,26
	0	Indirekte Preisbestimmung	Basispreis	0
	34	Indirekte Preisbestimmung	Basispreis	3,07
	6.122	Indirekte Preisbestimmung	Basispreis	113,30
	227.674	Referenzinstrument	Rendite	4,76-5,77
Kreditbeteiligungen und -abtretung	8.696	Indirekte Preisbestimmung	Basispreis	\$ 100,00
Summen	\$ 289.170			

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

⁽³⁾ Für den Berichtszeitraum bis 30. Juni 2021 sind keine Angaben enthalten, da der gesamte beizulegende Zeitwert der Wertpapiere der Stufe 3 unter 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds liegt.

⁽⁴⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Die folgende Tabelle zeigt die Sensitivität von Anlagen in Wertpapieren der Stufe 3 gegenüber realistisch möglichen Änderungen des Marktwerts. Angenommen werden hierbei Marktbewegungen nach oben oder unten von jeweils 10 % bei gleichbleibenden weiteren Variablen.

Kategorie und Unterkategorie	31. Dez. 2020	Sensitivität gegenüber Änderungen des Marktwerts von Anlagen Anstieg/Rückgang
Übertragbare Wertpapiere		
Stammaktien	\$ 0	
Unternehmensanleihen und Wechsel	28.047	
Aktien von Immobilienunternehmen	870	
Summen	\$ 28.917	

Roll Forward Stufe 3	31. Dez. 2020
Marktwert zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 80.396
Käufe während des Geschäftsjahrs	113.110
Verkäufe während des Geschäftsjahrs	(39.778)
Übertragungen eingehend	125.995
Übertragungen ausgehend	(345)
Realisierter Nettogewinn/-verlust	(469)
Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme)	10.261
Marktwert zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 289.170

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrech- nungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbind- lichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettover- mögens
BPS	0,500 %	07.09.2020	TBD ⁽¹⁾	CZK (148.891)	\$ (6.939)	(0,25)
	0,500	14.09.2020	TBD ⁽¹⁾	(108.045)	(5.035)	(0,18)
	0,500	29.09.2020	TBD ⁽¹⁾	(441.639)	(20.587)	(0,74)
	0,500	06.10.2020	TBD ⁽¹⁾	(121.730)	(5.672)	(0,20)
	0,500	17.06.2021	09.09.2022	(385.608)	(17.930)	(0,65)
	0,550	26.03.2021	TBD ⁽¹⁾	HUF (18.803.198)	(63.651)	(2,30)
	0,550	17.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(4.875.116)	(16.475)	(0,59)
	0,550	29.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(2.916.996)	(9.855)	(0,36)
	5,850	15.07.2020	TBD ⁽¹⁾	ZAR (166.594)	(12.145)	(0,44)
	5,850	17.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.415.046)	(99.288)	(3,59)
	5,850	22.06.2021	13.07.2021	(112.321)	(7.876)	(0,28)
	5,850	23.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(435.426)	(30.527)	(1,10)
	5,850	02.07.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.354.778)	(94.881)	(3,43)
DBL	(0,250)	16.06.2021	TBD ⁽¹⁾	PLN (37.669)	(9.894)	(0,36)
JML	0,300	09.06.2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (7.395)	(7.396)	(0,27)
	0,300	11.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(14.369)	(14.372)	(0,52)
	0,300	28.06.2021	TBD ⁽¹⁾	CZK (202.798)	(9.429)	(0,34)
	0,400	18.05.2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (11.206)	(11.211)	(0,40)
	0,400	22.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(10.249)	(10.254)	(0,37)
	4,400	05.28.2021	TBD ⁽¹⁾	MXN 709.190	(35.768)	(1,28)
	5,200	28.06.2021	TBD ⁽¹⁾	ZAR (721.159)	(50.528)	(1,83)
MEI	(0,200)	24.06.2021	TBD ⁽¹⁾	PLN (214.883)	(56.442)	(2,04)
SCX	0,320	25.03.2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (2.658)	(2.660)	(0,10)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (598.815)	(21,62)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 93	\$ 0	\$ 93
BOA	3.655	(4.730)	(1.075)
BPS	(5.099)	4.450	(649)
BRC	3.891	(4.410)	(519)
BSH	691	0	691
BSS	(654)	240	(414)
CBK	1.484	(3.726)	(2.242)
CKL	367	0	367
DUB	317	(610)	(293)
FBF	48	0	48
GLM	14.037	(14.700)	(663)
HUS	6.267	(6.860)	(593)
IND	(1.787)	1.590	(197)
JPM	3.174	(3.540)	(366)
MYC	(209)	76	(133)
MYI	(1.515)	2.370	855
RYL	(116)	0	(116)
SCX	(3.022)	3.178	156
SOG	135	0	135
SSB	1.125	(1.790)	(665)
TOR	(19)	10	(9)
UAG	(79)	60	(19)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	64,69	62,24
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	44,78	46,19
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,90	2,93
Investmentfonds	5,39	7,18
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,04)	1,74
Freiverkehrsfinanzderivate	0,82	1,94
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(21,62)	(16,51)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Argentinien	0,15	0,35
Österreich	0,02	0,02
Brasilien	5,28	5,62
Cayman Inseln	1,98	0,56
Chile	1,13	2,77
China	12,04	11,71
Kolumbien	5,49	6,75
Tschechische Republik	2,88	2,84
Dominikanische Republik	1,83	2,94
Ägypten	1,95	1,51
El Salvador	k. A.	0,00
Frankreich	1,07	1,09
Deutschland	1,70	1,74
Ghana	0,73	0,09
Hongkong	0,23	0,31
Ungarn	3,57	5,45
Indien	0,49	k. A.
Indonesien	0,64	0,93
Irland	1,23	0,73
Israel	2,86	k. A.
Italien	0,30	0,35
Elfenbeinküste	0,34	k. A.
Japan	0,33	0,34
Kasachstan	0,21	0,21
Luxemburg	0,20	0,01
Malaysia	6,09	6,23
Mauritius	0,09	k. A.
Mexiko	2,38	5,39
Niederlande	0,48	0,05
Nigeria	0,19	k. A.
Peru	3,83	5,67
Philippinen	0,74	0,59
Polen	2,44	4,99
Katar	3,55	3,76
Rumänien	2,89	2,42
Russland	6,65	6,83
Serbien	0,34	0,19
Singapur	1,02	k. A.
Südafrika	10,58	11,73
Südkorea	0,02	0,02
Spanien	0,12	0,13
Supranational	0,72	0,62
Schweiz	0,18	0,03
Thailand	6,60	5,72
Türkei	1,76	0,80
Uganda	0,44	k. A.
Ukraine	0,39	0,30
Vereinigte Arabische Emirate	0,95	1,02
Großbritannien	0,75	1,32
USA	5,56	5,96
Uruguay	k. A.	0,09
Kurzfristige Instrumente	5,96	1,18
Investmentfonds	5,39	7,18
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,04)	1,74
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,20	0,10
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Devisenoptionen	(0,22)	(0,06)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Cross-Currency Swaps	0,23	0,37
Zinsswaps	0,41	0,74
Volatilitätsswaps	0,05	0,01
Devisenterminkontrakte	0,13	0,76
Sonstige Aktiva und Passiva	(17,54)	(22,22)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
ANGOLA				7,625 % fällig am 29.06.2027							
STAATSEMISSIONEN				Summe Belarus				1,778 0,03			
Angolan Government International Bond				BERMUDAS				Geely Automobile Holdings Ltd.			
8,000 % fällig am 26.11.2029	15.800	16.254	0,31	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,000 % fällig am 09.12.2024 (f)			
8,250 % fällig am 09.05.2028	13.300	13.917	0,27					HPHT Finance Ltd.			
9,125 % fällig am 26.11.2049	11.000	11.294	0,22					2,000 % fällig am 19.03.2026			
9,375 % fällig am 08.05.2048	5.400	5.657	0,11					Interoceanica Finance Ltd.			
9,500 % fällig am 12.11.2025	16.800	18.437	0,36					0,000 % fällig am 15.05.2030 (d)			
Summe Angola		65.559	1,27	BRASILIEN				Kaisa Group Holdings Ltd.			
ARGENTINIEN								9,375 % fällig am 30.06.2024			
STAATSEMISSIONEN								9,750 % fällig am 28.09.2023			
Argentina Government International Bond								11,250 % fällig am 09.04.2022			
0,125 % fällig am 09.07.2030	42.900	15.487	0,30					11,500 % fällig am 30.01.2023			
0,125 % fällig am 09.07.2035	124.367	39.673	0,77					11,700 % fällig am 11.11.2025			
0,125 % fällig am 09.01.2038	32.856	12.419	0,24					11,950 % fällig am 12.11.2023			
0,125 % fällig am 09.07.2041	79.138	28.331	0,55					KSA Sukuk Ltd.			
1,000 % fällig am 09.07.2029	6.437	2.453	0,05					2,894 % fällig am 20.04.2022			
Provincia de Cordoba								4,303 % fällig am 19.01.2029			
5,000 % fällig am 10.12.2025 ^	2.290	1.779	0,03					Lima Metro Line Finance Ltd.			
Provincia de Entre Rios Argentina								4,350 % fällig am 05.04.2036			
4,625 % fällig am 08.08.2028 ^	2.642	1.843	0,03					5,875 % fällig am 05.07.2034			
Provincia de la Rioja								MAF Sukuk Ltd.			
9,750 % fällig am 24.02.2025 ^	5.950	3.748	0,07					4,638 % fällig am 14.05.2029			
Provincia de Neuquen								Meituan			
2,500 % fällig am 27.04.2030 ^	2.210	1.437	0,03					3,050 % fällig am 28.10.2030			
Summe Argentinien		107.170	2,07					3,050 % fällig am 28.10.2030 (j)			
ARMENIEN								Melco Resorts Finance Ltd.			
STAATSEMISSIONEN								5,250 % fällig am 26.04.2026			
Republic of Armenia Government International Bond								5,750 % fällig am 21.07.2028			
3,600 % fällig am 02.02.2031	10.700	10.145	0,20					MGM China Holdings Ltd.			
3,950 % fällig am 26.09.2029	2.600	2.575	0,05					4,750 % fällig am 01.02.2027			
Summe Armenien		12.720	0,25					5,875 % fällig am 15.05.2026			
ÖSTERREICH								New Metro Global Ltd.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								4,500 % fällig am 02.05.2026			
Sappi Papier Holding GmbH								Odebrecht Drilling Norbe Ltd.			
3,125 % fällig am 15.04.2026 (j)	€ 3.800	4.535	0,09					6,350 % fällig am 01.12.2021 ^			
ASERBAIDDSCHAN								Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								7,350 % fällig am 01.12.2026 ^ (b)			
Southern Gas Corridor CJSC								Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.			
6,875 % fällig am 24.03.2026	\$ 34.700	41.574	0,81					6,720 % fällig am 01.12.2022 ^			
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic								Poinsettia Finance Ltd.			
4,750 % fällig am 13.03.2023	1.000	1.062	0,02					6,625 % fällig am 17.06.2031			
Summe Aserbaidschan		42.636	0,83					S.A. Global Sukuk Ltd.			
STAATSEMISSIONEN								1,602 % fällig am 17.06.2026			
Azerbaijan Government International Bond								2,694 % fällig am 17.06.2031			
3,500 % fällig am 01.09.2032	3.000	3.118	0,06					Sands China Ltd.			
4,750 % fällig am 18.03.2024	4.400	4.783	0,09					5,400 % fällig am 08.08.2028			
Summe Aserbaidschan		7.901	0,15					Seazen Group Ltd.			
BAHAMAS								4,450 % fällig am 13.07.2025 (j)			
STAATSEMISSIONEN								SPARC EM SPC Panama Metro Line SP			
Bahamas Government International Bond								0,000 % fällig am 05.12.2022 (d)			
6,000 % fällig am 21.11.2028	13.300	13.533	0,26					Sunac China Holdings Ltd.			
Summe Bahamas		50.537	0,98					6,500 % fällig am 10.01.2025			
BAHRAIN								7,000 % fällig am 09.07.2025			
STAATSEMISSIONEN								Wynn Macau Ltd.			
Bahrain Government International Bond								5,500 % fällig am 15.01.2026			
4,250 % fällig am 25.01.2028	12.200	12.236	0,24					Zhongsheng Group Holdings Ltd.			
5,625 % fällig am 30.09.2031	10.800	10.975	0,21					3,000 % fällig am 13.01.2026			
6,125 % fällig am 05.07.2022	6.100	6.397	0,12					Summe Cayman Inseln			
Summe Bahrain		29.608	0,57					214.790 4,16			
WEISSRUSSLAND								CHILE			
STAATSEMISSIONEN								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Belarus Government International Bond								Banco del Estado de Chile			
5,875 % fällig am 24.02.2026	1.072	995	0,02					2,704 % fällig am 09.01.2025			
Summe Weisrussland								Banco Santander Chile			
CAYMAN INSELN								2,700 % fällig am 10.01.2025			
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE								Celulosa Arauco y Constitucion S.A.			
HALCYON LOAN ADVISORS FUNDING LTD.								4,500 % fällig am 01.08.2024			
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.								Corp. Nacional del Cobre de Chile			
1,108 % fällig am 20.04.2027	150	150	0,00					3,150 % fällig am 14.01.2030			
Summe Cayman Inseln								3,625 % fällig am 01.08.2027			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								3,700 % fällig am 30.01.2050			
21Vianet Group, Inc.								4,500 % fällig am 01.08.2047			
7,875 % fällig am 15.10.2021	2.000	2.005	0,04					4,875 % fällig am 04.11.2044			
AAC Technologies Holdings, Inc.								6,150 % fällig am 24.10.2036			
2,625 % fällig am 02.06.2026	4.600	4.665	0,09					Summe Chile			
Biocanico Sovereign Certificate Ltd.								214.790 4,16			
0,000 % fällig am 05.06.2034 (d)	14.089	10.451	0,20								
Dubai DOF Sukuk Ltd.											
2,763 % fällig am 09.09.2030	9.800	9.971	0,19								
Fab Sukuk Co. Ltd.											
3,625 % fällig am 05.03.2023	1.700	1.788	0,04								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Embotelladora Andina S.A. 3,950 % fällig am 21.01.2050	\$ 3.900	\$ 4.155	0,08	5,200 % fällig am 15.05.2049 (j)	\$ 10.200	\$ 11.197	0,22	14,605 % fällig am 08.09.2025	EGP 34.400	\$ 2.213	0,04
Empresa de los Ferrocarriles del Estado 3,068 % fällig am 18.08.2050	1.700	1.475	0,03	5,625 % fällig am 26.02.2044	4.500	5.111	0,10				
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A. 3,650 % fällig am 07.05.2030	1.600	1.729	0,03	6,125 % fällig am 18.01.2041	8.945	10.621	0,20				
Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A. 4,875 % fällig am 30.10.2024	10.200	10.896	0,21	7,375 % fällig am 18.09.2037	1.400	1.846	0,04				
GNL Quintero S.A. 4,634 % fällig am 31.07.2029	9.500	10.373	0,20	8,125 % fällig am 21.05.2024	500	594	0,01				
Sociedad Química y Minera de Chile S.A. 4,250 % fällig am 07.05.2029	8.600	9.647	0,19								
		78.885	1,53								
STAATSEMISSIONEN				Costa Rica Government International Bond				EL SALVADOR			
Chile Government International Bond 3,100 % fällig am 07.05.2041	9.900	9.930	0,19	4,375 % fällig am 30.04.2025	2.000	2.074	0,04	STAATSEMISSIONEN			
3,625 % fällig am 30.10.2042	2.000	2.132	0,04	5,625 % fällig am 30.04.2043	9.400	8.732	0,17	El Salvador Government International Bond			
		12.062	0,23	6,125 % fällig am 19.02.2031	2.900	3.083	0,06	6,375 % fällig am 18.01.2027	\$ 1.100	998	0,02
Summe Chile		90.947	1,76	7,158 % fällig am 12.03.2045	1.177	1.233	0,02	7,125 % fällig am 20.01.2050	9.707	8.300	0,16
CHINA				STAATSEMISSIONEN				7,625 % fällig am 21.09.2034	3.800	3.458	0,07
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				COSTA RICA				7,625 % fällig am 01.02.2041	530	472	0,01
China Huadian Overseas Development Ltd. 6,200 % fällig am 23.06.2025 (f)	6.200	6.378	0,12	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,650 % fällig am 15.06.2035	200	184	0,00
Contemporary Ruiding Development Ltd. 1,875 % fällig am 17.09.2025	7.400	7.437	0,14	Instituto Costarricense de Electricidad	2.200	1.941	0,04	8,250 % fällig am 10.04.2032	410	390	0,01
2,625 % fällig am 17.09.2030	3.600	3.598	0,07	6,375 % fällig am 15.05.2043				8,625 % fällig am 28.02.2029	185	181	0,00
Huaxin Cement International Finance Co. Ltd. 2,250 % fällig am 19.11.2025	6.000	5.967	0,11	STAATSEMISSIONEN				9,500 % fällig am 15.07.2052	1.400	1.382	0,03
Mimmetals Bounteous Finance BVI Ltd. 3,125 % fällig am 27.07.2021	2.400	2.403	0,05	Costa Rica Government International Bond				Summe El Salvador		15.365	0,30
4,200 % fällig am 27.07.2026	800	881	0,02	4,875 % fällig am 23.09.2032	9.500	9.809	0,19	ATHIOPIEN			
Rongshi International Finance Ltd. 3,625 % fällig am 04.05.2027	2.400	2.598	0,05	5,300 % fällig am 21.01.2041	17.500	17.500	0,34	STAATSEMISSIONEN			
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 2,150 % fällig am 13.05.2025	6.600	6.771	0,13	5,500 % fällig am 27.01.2025	13.100	14.415	0,28	Ethiopia Government International Bond			
2,700 % fällig am 13.05.2030	9.800	10.126	0,20	5,875 % fällig am 30.01.2060	16.100	16.084	0,31	6,625 % fällig am 11.12.2024	3.300	3.061	0,06
3,500 % fällig am 03.05.2026	2.000	2.189	0,04	5,950 % fällig am 25.01.2027	16.000	18.032	0,35	GABUN			
3,680 % fällig am 08.08.2049	4.200	4.514	0,09	6,000 % fällig am 19.07.2028	13.200	15.035	0,29	STAATSEMISSIONEN			
4,125 % fällig am 12.09.2025	1.700	1.883	0,04	6,400 % fällig am 05.06.2049	4.250	4.580	0,09	Gabon Government International Bond			
4,375 % fällig am 17.10.2023	4.700	5.068	0,10	6,500 % fällig am 15.02.2048	1.350	1.476	0,03	6,375 % fällig am 12.12.2024	784	837	0,02
4,375 % fällig am 10.04.2024	2.800	3.060	0,06	6,850 % fällig am 27.01.2045	900	1.020	0,02	DEUTSCHLAND			
SPIC MTN Co. Ltd. 1,625 % fällig am 27.07.2025	17.300	17.272	0,33	6,875 % fällig am 29.01.2026	6.400	7.431	0,14	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
State Grid Overseas Investment Ltd. 4,125 % fällig am 07.05.2024	1.800	1.962	0,04	7,450 % fällig am 30.04.2044	100	121	0,00	Deutsche Bank AG			
Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 15.04.2024	4.900	4.735	0,09	8,900 % fällig am 15.02.2023	100	121	0,00	3,700 % fällig am 30.05.2024	4.222	4.527	0,09
ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd. 3,125 % fällig am 16.07.2025	11.800	11.838	0,23	9,750 % fällig am 05.06.2026	DOP149.250	2.751	0,05	3,950 % fällig am 27.02.2023	6.769	7.111	0,13
		98.680	1,91	10,750 % fällig am 11.08.2028	190.700	3.942	0,08	5,000 % fällig am 14.02.2022	6.000	6.165	0,12
STAATSEMISSIONEN				Summe Dominikanische Republik		117.140	2,27	Summe Deutschland		17.803	0,34
Export-Import Bank of China 4,000 % fällig am 28.11.2047	7.100	8.756	0,17	ECUADOR				GHANA			
Summe China		107.436	2,08	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN			
KOLUMBIEN				Petroamazonas EP				Ghana Government International Bond			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,625 % fällig am 06.12.2021	\$ 1.934	1.919	0,04	0,000 % fällig am 07.04.2025 (d)	3.100	2.472	0,05
Ecopetrol S.A. 4,125 % fällig am 16.01.2025	600	633	0,01	STAATSEMISSIONEN				6,375 % fällig am 11.02.2027	15.200	15.310	0,30
5,375 % fällig am 26.06.2026	2.100	2.318	0,05	Ecuador Government International Bond				7,625 % fällig am 16.05.2029	800	811	0,02
5,875 % fällig am 28.05.2045	3.000	3.218	0,06	0,000 % fällig am 31.07.2030 (d)	5.232	2.909	0,06	7,750 % fällig am 07.04.2029	7.300	7.478	0,14
7,375 % fällig am 18.09.2043	2.200	2.720	0,05	0,500 % fällig am 31.07.2030	26.726	23.052	0,44	7,875 % fällig am 26.03.2027	6.200	6.568	0,13
		8.889	0,17	0,500 % fällig am 31.07.2035	42.471	29.252	0,56	7,875 % fällig am 11.02.2035	3.129	3.092	0,06
STAATSEMISSIONEN				0,500 % fällig am 31.07.2040	22.163	13.796	0,27	8,125 % fällig am 26.03.2032	8.800	8.946	0,17
Colombia Government International Bond				Summe Ecuador		69.009	1,33	8,625 % fällig am 07.04.2034	9.100	9.416	0,18
3,000 % fällig am 30.01.2030	3.000	2.945	0,06	AGYPTEN				8,750 % fällig am 11.03.2061	10.350	9.978	0,19
3,125 % fällig am 15.04.2031	25.607	25.102	0,49	STAATSEMISSIONEN				8,950 % fällig am 26.03.2051	11.100	11.006	0,21
3,875 % fällig am 15.02.2061	5.500	4.942	0,10	Egypt Government International Bond				Summe Ghana		75.077	1,45
4,125 % fällig am 22.02.2042	2.900	2.832	0,05	4,750 % fällig am 11.04.2025	€ 8.300	10.287	0,20	GUATEMALA			
4,125 % fällig am 15.05.2051 (j)	15.900	15.118	0,29	4,750 % fällig am 16.04.2026	12.008	14.886	0,29	STAATSEMISSIONEN			
5,000 % fällig am 15.06.2045	3.900	4.157	0,08	5,250 % fällig am 06.10.2025	\$ 6.450	6.815	0,13	Guatemala Government International Bond			
				5,577 % fällig am 21.02.2023	2.000	2.105	0,04	4,375 % fällig am 05.06.2027	9.000	9.837	0,19
				5,625 % fällig am 16.04.2030	€ 4.770	5.694	0,11	4,500 % fällig am 03.05.2026	7.400	8.140	0,16
				6,125 % fällig am 31.01.2022	€ 33.924	34.726	0,67	4,875 % fällig am 13.02.2028	6.620	7.480	0,14
				6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 1.900	2.355	0,05	4,900 % fällig am 01.06.2030	697	787	0,02
				6,75 % fällig am 30.04.2040	\$ 3.100	3.034	0,06	5,375 % fällig am 24.04.2032	700	815	0,02
				7,053 % fällig am 15.01.2032	17.000	17.480	0,34	5,750 % fällig am 06.06.2022	19.920	20.741	0,40
				7,500 % fällig am 31.01.2027	7.800	8.785	0,17	6,125 % fällig am 01.06.2050	7.300	8.961	0,17
				7,625 % fällig am 29.05.2032	5.200	5.727	0,11	Summe Guatemala		56.761	1,10
				7,903 % fällig am 21.02.2048	7.400	7.871	0,15	HONGKONG			
				8,150 % fällig am 20.11.2059	3.900	3.872	0,08	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				8,500 % fällig am 31.01.2047	5.600	5.620	0,11	AIA Group Ltd.			
				8,875 % fällig am 29.05.2050	9.900	10.350	0,20	3,200 % fällig am 16.09.2040	900	933	0,02
				14,313 % fällig am 13.10.2023	700	756	0,01	Far East Horizon Ltd.			
				14,369 % fällig am 20.10.2025	EGP 32.000	2.045	0,04	3,375 % fällig am 18.02.2025	4.400	4.458	0,08
					125.100	7.957	0,15	Huarong Finance Co. Ltd.			
								1,275 % fällig am 24.02.2023	9.000	6.731	0,13
								3,375 % fällig am 24.02.2030	700	482	0,01
								4,500 % fällig am 29.05.2029	3.450	2.398	0,05
								5,000 % fällig am 19.11.2025	3.700	2.673	0,05
										17.675	0,34

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				KASACHSTAN			
Airport Authority Hong Kong				5,125 % fällig am 15.01.2045	\$ 9.450	\$ 11.723	0,23	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
2,100 % fällig am 08.03.2026 (f)	\$ 7.500	\$ 7.547	0,15	5,250 % fällig am 17.01.2042	3.300	4.122	0,08	Development Bank of Kazakhstan JSC			
2,400 % fällig am 08.03.2028 (f)	12.100	12.096	0,23	5,350 % fällig am 11.02.2049	200	260	0,01	4,125 % fällig am 10.12.2022	\$ 1.100	\$ 1.148	0,02
		19.643	0,38	6,625 % fällig am 17.02.2037	10.200	14.105	0,27	KazMunayGas National Co. JSC			
Summe Hongkong		37.318	0,72	6,750 % fällig am 15.01.2044	14.250	21.116	0,41	4,750 % fällig am 24.04.2025	700	785	0,02
UNGARN				PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA				TENGIZCHEVROIL FINANCE CO. INTERNATIONAL LTD.			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN			
Hungary Government International Bond				2,800 % fällig am 23.06.2030	200	205	0,00	3,250 % fällig am 15.08.2030	11.900	12.152	0,23
0,500 % fällig am 18.11.2030	€ 800	932	0,02	3,800 % fällig am 23.06.2050	12.800	13.441	0,26				
1,750 % fällig am 05.06.2035	7.500	9.449	0,18	4,400 % fällig am 01.03.2028	5.000	5.714	0,11				
				4,450 % fällig am 20.02.2029	15.000	17.268	0,34				
Summe Ungarn		10.381	0,20	4,550 % fällig am 29.03.2026	2.000	2.279	0,04				
INDIEN				IRLAND				STAATSEMISSIONEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN			
Adani Electricity Mumbai Ltd.				5,950 % fällig am 15.04.2030 (h)	6.800	7.158	0,14	Kazakhstan Government International Bond			
3,949 % fällig am 12.02.2030	\$ 7.000	7.003	0,14	Russian Railways Via RZD Capital PLC				1,550 % fällig am 09.11.2023	€ 400	491	0,01
Adani Transmission Ltd.				7,487 % fällig am 25.03.2031	€ 5.000	9.175	0,17	2,375 % fällig am 09.11.2028	1.000	1.330	0,03
4,250 % fällig am 21.05.2036	2.618	2.673	0,05	5,942 % fällig am 21.11.2023	\$ 5.100	5.600	0,11	4,875 % fällig am 14.10.2044	\$ 6.600	8.304	0,16
Indian Railway Finance Corp. Ltd.				Summe Irland		21.933	0,42	6,500 % fällig am 21.07.2045	5.100	7.475	0,14
3,950 % fällig am 13.02.2050	2.200	2.160	0,04	ISRAEL							
Muthoot Finance Ltd.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
4,400 % fällig am 02.09.2023	5.400	5.570	0,11	Delek & Avner Tamar Bond Ltd.							
NTPC Ltd.				5,082 % fällig am 30.12.2023	900	908	0,02				
3,750 % fällig am 03.04.2024	2.000	2.107	0,04	5,412 % fällig am 30.12.2025	6.160	6.208	0,12	Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK)			
Shriram Transport Finance Co. Ltd.				Israel Electric Corp. Ltd.				10,000 % fällig am 09.11.2024 ^{(b)}	9.575	2.402	0,05
5,100 % fällig am 16.07.2023	5.200	5.294	0,10	4,250 % fällig am 14.08.2028	5.400	6.063	0,12	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.			
5,700 % fällig am 27.02.2022	6.800	6.887	0,13	5,000 % fällig am 12.11.2024	200	224	0,00	4,375 % fällig am 19.09.2022	7.700	8.002	0,15
State Bank of India				Leviathan Bond Ltd.				6,000 % fällig am 27.11.2023	5.100	5.628	0,11
4,000 % fällig am 24.01.2022	3.300	3.357	0,07	6,500 % fällig am 30.06.2027	8.400	9.366	0,18	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.			
		35.051	0,68	STAATSEMISSIONEN				4,950 % fällig am 19.07.2022	3.000	3.127	0,06
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				5,150 % fällig am 11.02.2026	6.900	7.778	0,15
Export-Import Bank of India				Israel Government International Bond				6,510 % fällig am 07.03.2022	14.620	15.224	0,29
3,375 % fällig am 05.08.2026 (j)	1.100	1.174	0,02	3,800 % fällig am 13.05.2060 (j)	8.500	9.701	0,19	Guara Norte SARL			
3,875 % fällig am 12.03.2024 (j)	4.500	4.811	0,09	Summe Israel		32.470	0,63	5,198 % fällig am 15.06.2034	5.206	5.434	0,11
		5.985	0,11	JAMAIKA				Petrorio Luxembourg SARL			
Summe Indien		41.036	0,79	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,125 % fällig am 09.06.2026	7.200	7.374	0,14
INDONESIEN				JORDANIE				STAATSEMISSIONEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT				Ivory Coast Government International Bond				Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK)			
5,450 % fällig am 15.05.2030	12.700	14.782	0,28	4,875 % fällig am 30.01.2032	9.700	11.516	0,22	5,250 % fällig am 23.05.2023 (h)	300	318	0,01
LLPL Capital Pte. Ltd.				5,250 % fällig am 22.03.2030	21.450	26.643	0,52	6,125 % fällig am 07.02.2022	16.465	17.015	0,33
6,875 % fällig am 04.02.2039	1.003	1.168	0,02	5,750 % fällig am 31.12.2032	\$ 21.179	21.289	0,41	Unigel Luxembourg S.A.			
Pelabuhan Indonesia Persero PT				5,875 % fällig am 17.10.2031	€ 4.800	6.135	0,12	8,750 % fällig am 01.10.2026	7.900	8.576	0,17
4,875 % fällig am 01.10.2024	3.100	3.428	0,07	6,625 % fällig am 22.03.2048	1.800	2.248	0,04	Summe Luxemburg		80.878	1,57
Pelabuhan Indonesia PT				JAMAICA				MALAYSIA			
4,250 % fällig am 05.05.2025	8.400	9.169	0,18	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,375 % fällig am 05.05.2045	3.693	4.441	0,08	TransJamaican Highway Ltd.				Axiata SPV2 Bhd.			
Pertamina Persero PT				5,750 % fällig am 10.10.2036	\$ 3.877	3.863	0,07	2,163 % fällig am 19.08.2030	2.300	2.270	0,04
4,875 % fällig am 03.05.2022	2.300	2.386	0,05	JORDANIE				Axiata Spv5 Labuan Ltd.			
5,625 % fällig am 20.05.2043	3.000	3.541	0,07	STAATSEMISSIONEN				3,064 % fällig am 19.08.2050	6.100	5.862	0,11
6,000 % fällig am 03.05.2042	15.600	19.151	0,37	Jordan Government International Bond				Petronas Capital Ltd.			
6,450 % fällig am 30.05.2044	12.900	16.839	0,32	4,950 % fällig am 07.07.2025	2.200	2.292	0,05	3,404 % fällig am 28.04.2061	15.900	16.342	0,32
6,500 % fällig am 07.11.2048	9.500	12.622	0,24	5,750 % fällig am 31.01.2027	13.500	14.547	0,28	4,500 % fällig am 18.03.2045	500	617	0,01
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				5,850 % fällig am 07.07.2030	9.600	10.026	0,19	4,550 % fällig am 21.04.2050	8.600	10.632	0,21
4,000 % fällig am 30.06.2050	21.300	21.193	0,41	6,125 % fällig am 29.01.2026	5.300	5.761	0,11	4,800 % fällig am 21.04.2060	8.600	11.430	0,22
4,125 % fällig am 15.05.2027	1.300	1.412	0,03	7,375 % fällig am 10.10.2047	1.800	1.900	0,04	Summe Malaysia		47.153	0,91
4,375 % fällig am 05.02.2050	5.400	5.542	0,11	JORDANIE				MARSHALLINSELN			
5,250 % fällig am 24.10.2042	300	340	0,01	STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,250 % fällig am 15.05.2047	5.400	6.091	0,12	Jordan Government International Bond				Nakilat, Inc.			
6,150 % fällig am 21.05.2048	700	886	0,02	4,950 % fällig am 07.07.2025	2.200	2.292	0,05	6,267 % fällig am 31.12.2033	504	625	0,01
6,250 % fällig am 25.01.2049	7.800	9.860	0,19	5,750 % fällig am 31.01.2027	13.500	14.547	0,28	MAURITIUS			
		154.668	2,99	5,850 % fällig am 07.07.2030	9.600	10.026	0,19	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
STAATSEMISSIONEN				Summe Jordanien				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Indonesia Government International Bond						34.526	0,67	Greenko Solar Mauritius Ltd.			
1,100 % fällig am 12.03.2033	€ 10.400	12.088	0,23					5,950 % fällig am 29.07.2026	3.700	3.994	0,08
4,350 % fällig am 08.01.2027	\$ 2.500	2.835	0,06								
4,350 % fällig am 11.01.2048	11.000	12.518	0,24								
4,750 % fällig am 18.07.2047	4.200	5.015	0,10								

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
6,550 % fällig am 14.03.2037	\$ 1.243			SAUDI-ARABIEN				10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 1.148.900	\$ 91.446	1,77
		36.464	0,71	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						168.835	3,27
Summe Peru		66.991	1,30	Saudi Arabian Oil Co.	\$ 600	\$ 632	0,01	Summe Südafrika		260.334	5,04
				2,875 % fällig am 16.04.2024		3.000	0,06	SPANIEN			
PHILIPPINEN				3,500 % fällig am 16.04.2029	50.200	48.881	0,95	STAATSEMISSIONEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,500 % fällig am 24.11.2070		52.768	1,02	Autonomous Community of Catalonia	€ 200	240	0,00
JGSH Philippines Ltd.	6.600	7.106	0,14	STAATSEMISSIONEN				4,900 % fällig am 15.09.2021			
4,125 % fällig am 09.07.2030				Saudi Government International Bond	19.700	19.176	0,37	SRI LANKA			
Jolilbee Worldwide Pte. Ltd.	8.700	9.388	0,18	2,250 % fällig am 02.02.2033		600	0,01	STAATSEMISSIONEN			
4,125 % fällig am 24.01.2026				2,900 % fällig am 22.10.2025		600	0,01	Sri Lanka Government International Bond			
4,750 % fällig am 24.06.2030	600	638	0,01	3,450 % fällig am 02.02.2061	12.400	12.409	0,24	5,750 % fällig am 18.04.2023	\$ 11.770	8.813	0,17
PLDIT, Inc.				3,625 % fällig am 04.03.2028	22.300	24.686	0,48	5,875 % fällig am 25.07.2022	4.450	3.782	0,07
2,500 % fällig am 23.01.2031	3.200	3.173	0,06	3,700 % fällig am 21.01.2055 (j)	30.000	31.778	0,61	6,125 % fällig am 03.06.2025	5.100	3.468	0,07
		20.305	0,39	4,000 % fällig am 17.04.2025	3.400	3.760	0,07	6,200 % fällig am 11.05.2027	8.200	5.082	0,10
STAATSEMISSIONEN				4,375 % fällig am 16.04.2029	700	812	0,02	6,250 % fällig am 27.07.2021	6.111	6.020	0,12
Philippines Government International Bond				4,500 % fällig am 26.10.2046	44.700	52.546	1,02	6,825 % fällig am 18.07.2026	1.200	771	0,02
2,650 % fällig am 10.12.2045	9.000	8.339	0,16	4,625 % fällig am 04.10.2047	300	359	0,01	6,850 % fällig am 03.11.2025	6.500	4.371	0,08
2,950 % fällig am 05.05.2045 (j)	19.700	19.067	0,37	Summe Saudi-Arabien		198.937	3,85	7,550 % fällig am 28.03.2030	26.700	16.900	0,33
3,700 % fällig am 01.03.2041	650	705	0,01					7,850 % fällig am 14.03.2029	3.600	2.304	0,04
3,950 % fällig am 20.01.2040	3.000	3.340	0,07	SENEGAL				Summe Sri Lanka		51.511	1,00
		31.451	0,61	STAATSEMISSIONEN				SUPRANATIONAL			
Summe Philippinen		51.756	1,00	Senegal Government International Bond				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
KATAR				4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 3.100	3.845	0,07	Banque Ouest Africaine de Developpement			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,375 % fällig am 08.06.2037	7.900	9.248	0,18	5,000 % fällig am 27.07.2027	3.000	3.347	0,07
Nakilat, Inc.				6,250 % fällig am 23.05.2033	\$ 1.900	2.009	0,04	TANSANIA			
6,067 % fällig am 31.12.2033	200	247	0,00	6,750 % fällig am 13.03.2048	800	810	0,02	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
STAATSEMISSIONEN				Summe Senegal		15.912	0,31	The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania			
Qatar Government International Bond				SERBIEN				5,364 % fällig am 23.06.2022	2.257	2.257	0,04
3,750 % fällig am 16.04.2030 (j)	13.100	14.851	0,29	STAATSEMISSIONEN				THAILAND			
3,750 % fällig am 16.04.2030	10.300	11.676	0,23	Serbia Government International Bond				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,400 % fällig am 16.04.2050 (j)	6.000	7.317	0,14	1,500 % fällig am 26.06.2029	€ 10.900	13.043	0,25	Bangkok Bank PCL			
4,400 % fällig am 16.04.2050	6.900	8.414	0,16	SINGAPUR				3,733 % fällig am 25.09.2034 (h)	800	832	0,02
4,500 % fällig am 23.04.2028	400	473	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				GC Treasury Center Co. Ltd.			
4,817 % fällig am 14.03.2049 (j)	21.100	27.221	0,53	BOC Aviation Ltd.				2,980 % fällig am 18.03.2031	3.200	3.275	0,06
5,103 % fällig am 23.04.2048	14.080	18.727	0,36	2,750 % fällig am 18.09.2022	\$ 200	203	0,00	4,300 % fällig am 18.03.2051	2.300	2.525	0,05
		88.679	1,72	Flex Ltd.				Thaioil Treasury Center Co. Ltd.			
Summe Katar		88.926	1,72	4,875 % fällig am 15.06.2029	1.300	1.502	0,03	3,500 % fällig am 17.10.2049	800	742	0,01
RUMÄNIEN				Medco Bell Pte. Ltd.				Summe Thailand		7.374	0,14
STAATSEMISSIONEN				6,375 % fällig am 30.01.2027	5.900	6.094	0,12	TRINIDAD UND TOBAGO			
Romania Government International Bond				Summe Singapur		7.799	0,15	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
1,375 % fällig am 02.12.2029	€ 2.100	2.489	0,05	SÜDAFRIKA				Trinidad Petroleum Holdings Ltd.			
2,000 % fällig am 08.12.2026	3.900	4.986	0,10	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,000 % fällig am 08.05.2022	622	625	0,01
2,124 % fällig am 16.07.2031	10.000	12.265	0,24	Absa Group Ltd.				TUNESIEN			
2,375 % fällig am 19.04.2027	1.600	2.077	0,04	6,375 % fällig am 27.05.2026 (f)(h)	14.300	14.643	0,28	STAATSEMISSIONEN			
2,625 % fällig am 02.12.2040	8.200	9.668	0,19	AngloGold Ashanti Holdings PLC				Banque Centrale de Tunisie Government International Bond			
2,875 % fällig am 26.05.2028	1.600	2.122	0,04	3,750 % fällig am 01.10.2030	3.600	3.729	0,07	3,280 % fällig am 09.08.2027	¥ 200.000	1.283	0,03
3,000 % fällig am 14.02.2031	€ 4.600	4.776	0,09	6,500 % fällig am 15.04.2040	200	250	0,01	5,750 % fällig am 30.01.2025	\$ 2.800	2.620	0,05
3,375 % fällig am 28.01.2050	€ 6.200	7.868	0,15	Eskom Holdings SOC Ltd.				Summe Tunesien		3.903	0,08
3,500 % fällig am 03.04.2034	700	949	0,02	6,350 % fällig am 10.08.2028	25.100	28.003	0,54	TÜRKEI			
3,624 % fällig am 26.05.2030	3.900	5.360	0,10	6,750 % fällig am 06.08.2023	11.600	12.154	0,24	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
3,875 % fällig am 29.10.2035	100	140	0,00	Growthpoint Properties International Pty. Ltd.				Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S			
4,000 % fällig am 14.02.2051	\$ 4.700	4.945	0,10	5,872 % fällig am 02.05.2023	5.200	5.581	0,11	5,004 % fällig am 06.04.2023	1.200	1.231	0,02
Summe Rumänien		57.645	1,12	Sasol Financing International Ltd.				5,125 % fällig am 22.06.2026	52.300	52.317	1,01
RUSLAND				4,500 % fällig am 14.11.2022	14.200	14.585	0,28	Turkish Airlines Pass-Through Trust			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				SASOL Financing USA LLC				4,200 % fällig am 15.09.2028	4.613	4.330	0,09
SCF Capital Designated Activity Co.				5,875 % fällig am 27.03.2024	5.815	6.225	0,12	Türkiye İis Bankası A/S			
5,375 % fällig am 16.06.2023	1.200	1.287	0,03	Transnet SOC Ltd.				6,125 % fällig am 25.04.2024	2.400	2.505	0,05
STAATSEMISSIONEN				4,000 % fällig am 26.07.2022	6.200	6.329	0,12	Yapi ve Kredi Bankasi A/S			
Russia Government International Bond				STAATSEMISSIONEN				5,850 % fällig am 21.06.2024	600	618	0,01
1,850 % fällig am 20.11.2032	€ 8.900	10.327	0,20	South Africa Government International Bond						61.001	1,18
4,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 23.200	26.178	0,51	4,300 % fällig am 12.10.2028	5.200	5.382	0,11				
4,750 % fällig am 27.05.2026	4.800	5.461	0,10	4,850 % fällig am 30.09.2029	13.100	13.929	0,27				
5,100 % fällig am 28.03.2035	29.000	34.546	0,67	5,000 % fällig am 12.10.2046	10.200	9.705	0,19				
5,625 % fällig am 04.04.2042	2.400	3.087	0,06	5,375 % fällig am 24.07.2044	400	403	0,01				
5,875 % fällig am 16.09.2043	2.000	2.674	0,05	5,750 % fällig am 30.09.2049	18.300	18.764	0,36				
		82.273	1,59	5,875 % fällig am 30.05.2022	17.400	18.255	0,35				
Summe Russland		83.560	1,62	6,300 % fällig am 22.06.2048 (j)	10.000	10.951	0,21				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS						
STAATSEMISSIONEN				4,583 % fällig am 19.06.2029	\$	300	\$	347	0,01	0,992 % fällig am 25.10.2037	\$	1.665	\$	1.470	0,03		
Export-Credit Bank of Turkey				Lloyds Banking Group PLC				Lloyds Banking Group PLC									
4,250 % fällig am 18.09.2022	\$	11.100	\$	11.274	0,22	4,582 % fällig am 10.12.2025	1,000	1.124	0,02					31.926	0,62		
5,375 % fällig am 24.10.2023		5.300		5.464	0,11	Natwest Group PLC				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
8,250 % fällig am 24.01.2024		4.700		5.117	0,10	2,875 % fällig am 19.09.2026	£	400	588	0,01	DAE Funding LLC						
Turkey Government International Bond						3,875 % fällig am 12.09.2023	\$	200	214	0,00	1,625 % fällig am 15.02.2024	6.700		6.809	0,13		
4,250 % fällig am 13.03.2025		5.000		4.916	0,10	4,269 % fällig am 22.03.2025		200	217	0,00	2,625 % fällig am 20.03.2025		3.500		3.570	0,07	
4,750 % fällig am 26.01.2026		8.750		8.623	0,17	4,800 % fällig am 05.04.2026	1,100	1.260	0,03	3,375 % fällig am 20.03.2028		4.000		4.102	0,08		
4,875 % fällig am 09.10.2026		6.000		5.888	0,11	5,076 % fällig am 27.01.2030		200	237	0,01	Ford Motor Credit Co. LLC						
4,875 % fällig am 16.04.2043		10.200		8.150	0,16	State Savings Bank of Ukraine Via SSB PLC					3,550 % fällig am 07.10.2022	3.700		3.804	0,07		
5,125 % fällig am 17.02.2028		25.000		24.344	0,47	9,375 % fällig am 10.03.2023	1,687	1.779	0,04	JPMorgan Structured Products BV							
5,750 % fällig am 11.05.2047		50.500		43.275	0,84	8,250 % fällig am 09.07.2024	16.100	16.998	0,33	3,650 % fällig am 14.10.2024 (i)		8.400		8.409	0,16		
5,950 % fällig am 15.01.2031		28.000		25.550	0,49	Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC				11,750 % fällig am 17.06.2022 (i)	UAH	37.000		1.365	0,03		
6,000 % fällig am 25.03.2027		17.400		17.809	0,34	9,875 % fällig am 15.09.2021	155	158	0,00	12,000 % fällig am 28.08.2026 (i)	ZMW	65.400		1.457	0,03		
6,000 % fällig am 24.01.2041		21.620		19.627	0,38	Ukrximbank Via Biz Finance PLC				12,000 % fällig am 04.01.2027 (i)		56.200		1.223	0,02		
6,125 % fällig am 24.10.2028		5.200		5.298	0,10	9,750 % fällig am 22.01.2025	2.915	3.142	0,06	14,000 % fällig am 28.05.2031 (i)		162.900		3.335	0,06		
6,375 % fällig am 14.10.2025		10.900		11.437	0,22			43.737	0,85	14,000 % fällig am 09.12.2031 (j)		73.700		1.554	0,03		
6,875 % fällig am 17.03.2036		16.070		16.281	0,32	NON-AGENCY-MBS				Rio Oil Finance Trust							
Turkiye Ihtirat Kredi Bankasi A/S						Warwick Finance Residential Mortgages PLC				8,200 % fällig am 06.04.2028	\$	8.928		10.339	0,20		
5,750 % fällig am 06.07.2026	4.400	4.373	0,08			0,000 % fällig am 21.12.2049 (d)	£	0	237	0,00	9,250 % fällig am 06.07.2024		3.653		4.054	0,08	
Summe Türkei		278.427	5,39			1,699 % fällig am 21.12.2049		5.242	7.263	0,14	9,750 % fällig am 06.01.2027		9.812		11.616	0,23	
UKRAINE						2,199 % fällig am 21.12.2049		735	1.021	0,01	Rutas 2 and 7 Finance Ltd.						
STAATSEMISSIONEN						2,699 % fällig am 21.12.2049		367	511	0,01	0,000 % fällig am 30.09.2036 (d)	5.600		4.069	0,08		
Ukraine Government International Bond						3,199 % fällig am 21.12.2049		210	292	0,01							
1,258 % fällig am 31.05.2040	21.600	25.682	0,50			Summe Großbritannien		53.352	1,03	NON-AGENCY-MBS							
4,375 % fällig am 27.01.2030	€	5.200		5.775	0,11	USA				Banc of America Mortgage Trust							
6,876 % fällig am 21.05.2029	\$	3.200		3.330	0,06	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				2,787 % fällig am 25.02.2036 ^		9		9	0,00		
7,253 % fällig am 15.03.2033		16.800		17.545	0,34	Aames Mortgage Investment Trust					BCAP LLC Trust						
7,750 % fällig am 01.09.2021		36.723		37.090	0,72	0,572 % fällig am 25.04.2036	\$	3.216	3.159	0,06	2,648 % fällig am 26.05.2037		4.606		4.600	0,09	
7,750 % fällig am 01.09.2022		32.200		33.893	0,66	Argent Mortgage Loan Trust					Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust						
7,750 % fällig am 01.09.2023		11.600		12.525	0,24	0,392 % fällig am 25.07.2036	1.207	1.098	0,02	2,756 % fällig am 25.01.2035	7			7	0,00		
7,750 % fällig am 01.09.2024		5.350		5.850	0,11	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				3,156 % fällig am 2.05.2047 ^		132		131	0,00		
7,750 % fällig am 01.09.2025		6.000		6.587	0,13	0,332 % fällig am 25.05.2035	559	524	0,01	5,077 % fällig am 25.01.2036 ^		2654		2.654	0,05		
7,750 % fällig am 01.09.2026		10.000		11.066	0,21	0,332 % fällig am 25.05.2037	1.207	1.098	0,02	3,093 % fällig am 25.11.2037		597		594	0,01		
Summe Ukraine		159.343	3,08			GSAA Home Equity Trust				Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust							
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						0,532 % fällig am 25.05.2047	982	752	0,02	0,512 % fällig am 25.11.2034		329		304	0,01		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						0,572 % fällig am 25.11.2036	309	153	0,00	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust							
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC						6,502 % fällig am 25.11.2036	1.021	565	0,01	0,422 % fällig am 25.08.2037 ^		995		852	0,02		
3,650 % fällig am 02.11.2029	2.200	2.455	0,05			Home Equity Asset Trust				GSMPS Mortgage Loan Trust							
4,600 % fällig am 02.11.2047	600	709	0,01			1,442 % fällig am 25.02.2033	320	323	0,01	0,442 % fällig am 25.01.2036		184		153	0,00		
DAE Sukuk Dfc Ltd.						Humboldt Americas LLC				GSR Mortgage Loan Trust							
3,750 % fällig am 15.02.2026	12.200	12.945	0,25			0,000 % fällig am 31.07.2022	20.000.000	4.905	0,10	2,927 % fällig am 25.01.2036 ^		37		37	0,00		
DP World PLC						JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				HarborView Mortgage Loan Trust							
4,700 % fällig am 30.09.2049		800		890	0,02	0,362 % fällig am 25.08.2036	\$	100	94	0,00	2,116 % fällig am 19.10.2035		122		87	0,00	
5,625 % fällig am 25.09.2048		7.475		9.371	0,18	Lehman XS Trust				HomeBanc Mortgage Trust							
6,850 % fällig am 02.07.2037		3.080		4.184	0,08	5,077 % fällig am 25.01.2036 ^	2.654	2.654	0,05	0,612 % fällig am 25.01.2036		504		498	0,01		
Kuwait Projects Co. SPC Ltd.						MASTR Asset-Backed Securities Trust				Impac CMB Trust							
4,500 % fällig am 23.02.2027	4.000	3.978	0,08			0,312 % fällig am 25.11.2036	1.295	965	0,02	0,732 % fällig am 25.03.2035		134		132	0,00		
Summe Vereinigte Arabische Emirate		34.532	0,67			Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				IndyMac Mortgage Loan Trust							
STAATSEMISSIONEN						0,292 % fällig am 25.02.2037	1.666	1.008	0,02	0,272 % fällig am 25.02.2037		1.296		1.313	0,03		
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond						0,857 % fällig am 25.01.2035	185	181	0,00	25.02.2037 ^		426		422	0,01		
2,700 % fällig am 02.09.2070	10.500	9.545	0,18			Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				25.02.2037 ^		435		388	0,01		
3,125 % fällig am 30.09.2049	9.400	9.615	0,19			Option One Mortgage Loan Trust				0,732 % fällig am 25.07.2045		269		262	0,01		
3,875 % fällig am 16.04.2050	17.300	19.977	0,39			0,312 % fällig am 25.05.2037	903	731	0,02	2,790 % fällig am 25.11.2037		269		262	0,01		
Emirate of Dubai Government International Bond						Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				JPMorgan Resecuritization Trust							
3,900 % fällig am 09.09.2050	7.200	6.766	0,13			0,872 % fällig am 25.09.2035	3.900	3.768	0,07	2,500 % fällig am 25.03.2056		450		451	0,01		
Summe Vereinigte Arabische Emirate		80.435	1,56			Renaissance Home Equity Loan Trust				Lehman XS Trust							
GROSSBRITANNIEN						5,797 % fällig am 25.08.2036	799	452	0,01	0,282 % fällig am 25.09.2046		2.773		2.810	0,05		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						Saxon Asset Securities Trust				Residential Accredit Loans, Inc. Trust							
Antofagasta PLC						0,402 % fällig am 25.09.2037	430	424	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		466		457	0,01		
2,375 % fällig am 14.10.2030	2.500	2.412	0,05			Soundview Home Loan Trust				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust							
Barclays Bank PLC						0,262 % fällig am 25.08.2037	749	696	0,01	3,577 % fällig am 25.09.2037		26		27	0,00		
7,625 % fällig am 21.11.2022 (h)	318	347	0,01			0,592 % fällig am 25.11.2036	90	87	0,00								
Barclays PLC						0,617 % fällig am 25.03.2036	1.431	1.430	0,03								
4,375 % fällig am 11.09.2024	200	218	0,00														
Fresnillo PLC																	
4,250 % fällig am 02.10.2050	12.900	13.138	0,25														
HSBC Holdings PLC																	
3,973 % fällig am 22.05.2030	400	448	0,01														
4,041 % fällig am 13.03.2028	1.000	1.110	0,02														

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,392 % fällig am 25.02.2037	\$ 1.025	\$ 997	0,02	8,250 % fällig am 13.10.2024 ^	\$ 12.483	\$ 1.317	0,03	EGYPT TREASURY BILLS			
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 2,910 % fällig am 25.10.2037 ^	916	863	0,02	9,000 % fällig am 07.05.2023 ^	9.878	1.008	0,02	12,850 % fällig am 13.07.2021 (d)(e)	EGP	129.500	8,225
TBW Mortgage-Backed Trust 6,540 % fällig am 25.01.2037 ^	1.439	569	0,01	9,250 % fällig am 15.09.2027 ^	13.410	1.428	0,03	12,930 % fällig am 17.08.2021 (d)(e)		129.600	8,135
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,462 % fällig am 25.05.2034	190	168	0,00	9,250 % fällig am 07.05.2028 ^	11.868	1.246	0,02	12,949 % fällig am 03.08.2021 (d)(e)		97.300	6,134
1,186 % fällig am 25.01.2046	98	97	0,00	11,950 % fällig am 05.08.2031 ^	2.930	311	0,01	13,049 % fällig am 03.08.2021 (d)(e)		397.675	25,071
2,931 % fällig am 25.03.2036	1.492	1.493	0,03	VENEZUELA				13,078 % fällig am 17.08.2021 (d)(e)		71.325	4,477
3,031 % fällig am 25.02.2037 ^	205	204	0,00	STAAITSEMISSIONEN				13,220 % fällig am 23.11.2021 (d)(e)		88.000	5,331
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 2,940 % fällig am 25.10.2036	480	475	0,01	Vietnam Government International Bond 4,800 % fällig am 19.11.2024	500	559	0,01	13,250 % fällig am 26.10.2021 (d)(e)		30.100	1,842
		21.386	0,41	JUNGFERNINSELN (BRITISCH)							59.215
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				U.S. TREASURY BILLS			
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				1MDB Global Investments Ltd. 4,400 % fällig am 09.03.2023	11.200	11.296	0,22	0,018 % fällig am 28.09.2021 (d)(e)(k)	\$	7.200	7,199
Uniform Mortgage-Backed Security				Champion Path Holdings Ltd. 4,850 % fällig am 27.01.2028	6.400	6.707	0,13	Summe kurzfristige Instrumente			107,020
1,993 % fällig am 01.12.2035	10	10	0,00	CLP Power Hong Kong Financing Ltd. 2,125 % fällig am 30.06.2030	5.300	5.275	0,10	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	4.962,155	96,05
2,190 % fällig am 01.03.2036	16	16	0,00	Easy Tactic Ltd. 11,750 % fällig am 02.08.2023	4.400	4.329	0,08	AKTIEN			
5,500 % fällig am 01.02.2038	2	2	0,00	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd. 5,125 % fällig am 15.05.2024	500	546	0,01	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029	4.000	4.044	0,08	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – Asia Strategic Interest Bond Fund (g)		250.000	2,543
2,500 % fällig am 01.09.2051	12.450	12.826	0,25	6,000 % fällig am 15.07.2025	3.000	3.158	0,06	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)		1.943,234	23,027
3,500 % fällig am 01.08.2051	14.100	14.851	0,29	Summe Jungferneinseln (Britisch)		35,355	0,68	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)		26.713,288	266,091
		27.705	0,54	SAMBIA				PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. – PIMCO China Bond Fund (g)		748,199	10,048
US-SCHATZOBIGATIONEN				STAAITSEMISSIONEN				Summe Investmentfonds	\$	301,709	5,84
U.S. Treasury Notes				Zambia Government International Bond							
2,375 % fällig am 15.05.2029	7.900	8.526	0,17	5,375 % fällig am 20.09.2022 ^	4.050	2.566	0,05				
Summe USA		155,249	3,01	8,500 % fällig am 14.04.2024 ^	8.900	5.728	0,11				
URUGUAY				8,970 % fällig am 30.07.2027 ^	5.100	3.237	0,06				
STAAITSEMISSIONEN				Summe Sambia		11,531	0,22				
Uruguay Government International Bond				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE							
4,375 % fällig am 27.10.2027	200	230	0,01	COMMERCIAL PAPER							
4,375 % fällig am 23.01.2031	15.478	18.047	0,35	Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 30.12.2021 (i)	10.800	10.808	0,21				
7,875 % fällig am 15.01.2033	9.350	14.131	0,27	KURZFRISTIGE SCHULDITITEL							
Summe Uruguay		32,408	0,63	JPMorgan Structured Products BV							
VENEZUELA				3,550 % fällig am 29.12.2021 (i)	€	11.600	13,756	0,27			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				11,730 % fällig am 11.03.2022 (j)	UAH	59.000	2,185	0,04			
Petroleos de Venezuela S.A.				17,250 % fällig am 07.01.2022 (i)	361.000	13.857	0,27				
5,375 % fällig am 12.04.2027 ^	73.690	3.316	0,06			29,798	0,58				
5,500 % fällig am 12.04.2037 ^	19.365	871	0,02								
6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	3.500	158	0,00								
		4,345	0,08								
STAAITSEMISSIONEN											
Venezuela Government International Bond											
7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	19.650	2.102	0,04								
7,650 % fällig am 21.04.2025 ^	6.624	679	0,01								
7,750 % fällig am 13.10.2019 ^	20.130	2.164	0,04								

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2021	649	\$ (101)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	874	(1.111)	(0,02)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	89	(378)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2021	291	101	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	4.315	(1.211)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	2.016	1.716	0,03
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	116	(314)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2021	289	2.499	0,05
				\$ 1,201	0,02
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 1,201	0,02

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 1.500	\$ 22	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	\$ 31.730	\$ (149)	0,00
CDX.EM-34 5-Year Index	(1,000)	20.12.2025	30.000	186	0,00
				\$ 37	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	Variablem Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung		1-Year BRL-CDI	5,863 %	02.01.2023	BRL 672.800	\$ (467)	(0,01)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	\$ 14.200	101	0,00
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	21.800	(15)	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,800	15.01.2051	37.500	3.699	0,07
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,500	21.06.2027	13.700	(488)	(0,01)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	149.170	(1.914)	(0,04)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	1.200	144	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,500	15.06.2046	600	74	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾		6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 9.400	7	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾		6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	12.000	26	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,470	21.04.2025	MXN 182.700	466	0,01
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,520	24.04.2025	175.900	452	0,01
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,530	24.04.2025	37.200	96	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIIE	5,615	23.04.2025	719.200	1.860	0,04
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	6,080	26.02.2025	196.200	(515)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	6,100	26.02.2025	58.000	(152)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	6,100	28.02.2025	372.800	(982)	(0,02)
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	6,140	26.02.2025	65.000	(171)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	6,150	26.02.2025	388.000	(1.023)	(0,02)
						\$ 1.198	0,02

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

\$ 1.257 0,02

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	(1,000) %	20.06.2026	\$ 12.250	\$ 1.551	\$ (32)	\$ 1.519	0,03
BPS	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	9.950	1.258	(24)	1.234	0,02
DUB	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	12.300	1.554	(30)	1.524	0,03
GST	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	11.600	1.472	(33)	1.439	0,03
HUS	Dubai Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	3.600	(12)	(32)	(44)	0,00
JPM	Dubai Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.500	(2)	(16)	(18)	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2025	6.300	608	85	693	0,01
					\$ 6.429	\$ (82)	\$ 6.347	0,12

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.09.2021	\$ 400	\$ (17)	\$ 18	\$ 1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	9.600	(43)	88	45	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.300	(111)	41	(70)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2031	7.200	(1.064)	159	(905)	(0,02)
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.900	26	0	26	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2022	6.500	(154)	194	40	0,00
BPS	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	9.600	(526)	239	(287)	(0,01)
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	5.400	(12)	37	25	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	4.300	(214)	83	(131)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2022	1.700	(29)	39	10	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2021	19.900	(614)	699	85	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2026	33.200	234	187	421	0,01
BRC	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	32.100	116	169	285	0,01
	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	6.800	(984)	(391)	(1.375)	(0,03)
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2030	4.000	(554)	85	(469)	(0,01)
	Eskom Holdings SOC Ltd.	1,000	20.12.2021	12.500	(270)	193	(77)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2031	43.000	(1.689)	319	(1.370)	(0,02)
	Nigeria Government International Bond	5,000	20.12.2021	6.400	344	(207)	137	0,00
CBK	QNB Finance Ltd.	1,000	20.06.2023	3.600	28	1	29	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.687	(277)	658	381	0,01
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.700	(335)	353	18	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	6.100	(16)	45	29	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	500	(5)	7	2	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.200	19	0	19	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.200	(41)	70	29	0,00
	Egypt Government International Bond	5,000	20.06.2022	10.400	357	7	364	0,01
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2026	700	15	1	16	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	21.000	0	80	80	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2022	8.900	(65)	110	45	0,00
	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2021	7.200	(614)	605	(9)	0,00
FBF	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2022	10.000	122	(13)	109	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	4.100	(14)	33	19	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	4.400	(236)	102	(134)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2031	4.100	(621)	106	(515)	(0,01)
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.700	(41)	56	15	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	2	1	0,00
GST	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	7.200	89	(29)	60	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	29.100	118	140	258	0,01
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2025	14.900	(176)	346	170	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.000	29	42	71	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.413	36	47	83	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	400	(6)	12	6	0,00
HUS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(1)	3	2	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	28.000	300	360	660	0,01
	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	4.700	(703)	(248)	(951)	(0,02)
	Banque Centrale de Tunisie International Bond	1,000	20.06.2022	2.800	(198)	49	(149)	0,00
	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2024	6.100	144	(3)	141	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	100	(1)	1	0	0,00
JPM	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.500	13	0	13	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	29.300	319	372	691	0,02
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	10.600	(171)	161	(10)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	4.400	(19)	40	21	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2030	4.300	(600)	96	(504)	(0,01)
	Eskom Holdings SOC Ltd.	1,000	20.06.2022	6.700	(127)	25	(102)	0,00
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	300	(2)	3	1	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	39.200	122	226	348	0,01
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	22.700	167	(75)	92	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	18.000	98	326	424	0,01
MYI	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.700	22	2	24	0,00
	UAG	1,000	20.06.2022	350	(25)	27	2	0,00
					\$ (7.860)	\$ 6.102	\$ (1.758)	(0,03)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2021	€ 5.740	\$ 6.989	\$ 182	\$ 0	\$ 182	0,00
	08.2021	\$ 1.036	UAH 28.738	5	0	5	0,00
	09.2021	CNY 60.335	\$ 9.381	91	0	91	0,00
BPS	09.2021	\$ 2.623	RUB 191.350	0	(32)	(32)	0,00
	07.2021	€ 2.730	\$ 3.308	71	0	71	0,00
	07.2021	¥ 187.100	€ 1.711	25	0	25	0,00
CBK	07.2021	\$ 3.264	€ 2.732	0	(24)	(24)	0,00
	11.2021	MXN 52.589	\$ 2.605	8	0	8	0,00
	07.2021	PEN 48.515	\$ 12.944	367	(105)	262	0,01
GLM	07.2021	\$ 145	MXN 2.899	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 8.752	PEN 33.473	28	(32)	(4)	0,00
	08.2021	COP 47.600.124	\$ 12.956	233	0	233	0,00
	08.2021	PEN 26.439	€ 6.902	0	(17)	(17)	0,00
	08.2021	\$ 414	HUF 124.415	6	0	6	0,00
	08.2021	\$ 2.488	PEN 9.895	103	0	103	0,00
	09.2021	PEN 72.807	\$ 19.793	730	0	730	0,01
	09.2021	ZAR 711.108	\$ 51.706	2.375	0	2.375	0,05
	10.2021	PEN 79.414	\$ 21.871	1.085	0	1.085	0,02
	10.2021	\$ 28.646	PEN 107.856	0	(419)	(419)	(0,01)
	11.2021	PEN 9.408	\$ 2.454	0	(8)	(8)	0,00
	12.2021	EGP 117.575	\$ 6.977	0	(202)	(202)	0,00
HUS	07.2021	DOP 491.183	\$ 8.302	0	(288)	(288)	(0,01)
	07.2021	£ 13.499	€ 19.084	436	0	436	0,01
	07.2021	RUB 18.141	\$ 235	0	(13)	(13)	0,00
	08.2021	COP 18.876.149	\$ 4.954	0	(91)	(91)	0,00
	08.2021	DOP 298.264	€ 5.048	0	(162)	(162)	0,00
	08.2021	\$ 12.723	COP 48.035.432	116	0	116	0,00
	08.2021	\$ 8.710	RUB 636.000	0	(62)	(62)	0,00
	09.2021	DOP 24.105	\$ 418	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	\$ 3.332	RUB 244.174	0	(26)	(26)	0,00
	09.2021	ZAR 344.594	\$ 25.034	1.127	0	1.127	0,02
	02.2022	\$ 339.030	€ 21.680	0	(1.363)	(1.363)	(0,03)
	JPM	07.2021	\$ 9.318	€ 7.831	0	(31)	(31)
07.2021		£ 18.714	€ 13.521	0	(35)	(35)	0,00
08.2021		£ 13.521	\$ 18.716	35	0	35	0,00
MYI	09.2021	MXN 48.549	\$ 2.309	0	(111)	(111)	0,00
	09.2021	\$ 1.376	RUB 100.749	0	(11)	(11)	0,00
	07.2021	PEN 58.220	\$ 15.484	280	0	280	0,01
SCX	07.2021	\$ 634	TRY 5.594	1	0	1	0,00
	07.2021	AUD 2	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2021	€ 3.972	€ 4.777	67	0	67	0,00
	07.2021	£ 37	€ 51	0	0	0	0,00
	07.2021	PEN 20.102	€ 5.510	260	0	260	0,01
	07.2021	SGD 240	€ 179	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 763	£ 551	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	EGP 240.218	\$ 14.838	0	(267)	(267)	(0,01)
	09.2021	\$ 4.030	EGP 64.682	11	0	11	0,00
	09.2021	\$ 4.208	ZAR 60.317	0	(23)	(23)	0,00
	07.2021	€ 200.636	\$ 245.407	7.472	0	7.472	0,15
	07.2021	\$ 38.478	PEN 150.604	870	0	870	0,02
TOR	08.2021	EGP 17.800	\$ 1.098	0	(26)	(26)	0,00
	09.2021	PEN 78.322	€ 19.693	0	(811)	(811)	(0,02)
	07.2021	€ 88	€ 105	0	0	0	0,00
UAG	07.2021	\$ 2.185	€ 2.658	67	0	67	0,00
	07.2021	\$ 9.044	RUB 654.046	0	(114)	(114)	0,00
	09.2021	\$ 1.357	€ 99.536	0	(9)	(9)	0,00
				\$ 16.052	\$ (4.284)	\$ 11.768	0,23

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen fur die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2021	AUD 909	\$ 684	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07.2021	\$ 688	AUD 891	0	(19)	(19)	0,00
	08.2021	\$ 684	€ 909	0	(2)	(2)	0,00
BPS	07.2021	\$ 521	€ 670	0	(17)	(17)	0,00
CBK	07.2021	\$ 26	€ 34	0	(1)	(1)	0,00
HUS	07.2021	\$ 1	€ 2	0	0	0	0,00
MYI	07.2021	AUD 388	\$ 293	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 1	AUD 2	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 292	€ 386	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2021	AUD 2	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 5	AUD 6	0	0	0	0,00
TOR	07.2021	\$ 156	€ 201	0	(5)	(5)	0,00
	07.2021	AUD 615	\$ 467	5	0	5	0,00
UAG	07.2021	\$ 692	AUD 893	0	(22)	(22)	0,00
	08.2021	\$ 463	€ 610	0	(5)	(5)	0,00
				\$ 9	\$ (73)	\$ (64)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 37.365	CHF 33.519	\$ 0	\$ (1.103)	\$ (1.103)	(0,02)
BRC	07.2021	573	514	0	(16)	(16)	0,00
CBK	07.2021	CHF 33.814	\$ 36.730	149	0	149	0,00
	07.2021	\$ 37.486	CHF 33.611	0	(1.125)	(1.125)	(0,02)
	08.2021	36.761	33.814	0	(148)	(148)	0,00
MYI	07.2021	36.344	32.745	0	(919)	(919)	(0,02)
SSB	07.2021	CHF 28	\$ 32	1	0	1	0,00
UAG	07.2021	\$ 2	CHF 2	0	0	0	0,00
				\$ 150	\$ (3.311)	\$ (3.161)	(0,06)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 1.290	€ 1.071	\$ 0	\$ (20)	\$ (20)	0,00
BPS	07.2021	€ 291	\$ 348	3	0	3	0,00
	07.2021	\$ 672.636	€ 550.053	0	(20.328)	(20.328)	(0,39)
BRC	07.2021	311	255	0	(8)	(8)	0,00
GLM	07.2021	8.482	6.998	0	(183)	(183)	0,00
HUS	07.2021	€ 53.816	\$ 64.620	801	0	801	0,01
	07.2021	\$ 41.340	€ 34.107	0	(892)	(892)	(0,02)
MYI	07.2021	1.913	1.607	0	(7)	(7)	0,00
SCX	07.2021	€ 126	\$ 153	4	0	4	0,00
	07.2021	\$ 762.319	€ 623.132	0	(23.347)	(23.347)	(0,45)
TOR	07.2021	762.319	623.132	0	(23.347)	(23.347)	(0,45)
UAG	07.2021	€ 4.302	\$ 5.233	131	0	131	0,00
				\$ 939	\$ (68.132)	\$ (67.193)	(1,30)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 41	\$ 57	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2021	\$ 578	£ 412	0	(8)	(8)	0,00
BRC	07.2021	£ 338	\$ 476	8	0	8	0,00
GLM	07.2021	\$ 37.903	£ 26.811	0	(865)	(865)	(0,02)
HUS	07.2021	£ 28.360	\$ 39.254	76	0	76	0,00
	07.2021	\$ 7	£ 5	0	0	0	0,00
	08.2021	39.184	28.308	0	(74)	(74)	0,00
MYI	07.2021	£ 328	\$ 459	6	0	6	0,00
	07.2021	\$ 196	£ 141	0	(1)	(1)	0,00
RYL	07.2021	£ 104	\$ 147	3	0	3	0,00
SCX	07.2021	4	6	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 37.918	£ 26.673	0	(1.070)	(1.070)	(0,02)
SSB	07.2021	£ 28.416	\$ 39.273	17	0	17	0,00
	07.2021	\$ 3	£ 2	0	0	0	0,00
	08.2021	39.123	28.308	0	(13)	(13)	0,00
UAG	07.2021	37.987	26.811	0	(950)	(950)	(0,02)
				\$ 111	\$ (2.981)	\$ (2.870)	(0,06)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional PLN (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 121	PLN 458	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
SSB	07.2021	121	458	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 12.070	\$ 8.990	\$ 10	\$ 0	\$ 10	0,00
	08.2021	\$ 8.989	SGD 12.070	0	(10)	(10)	0,00
BPS	07.2021	8.736	11.557	0	(138)	(138)	(0,01)
GLM	07.2021	179	240	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	32	43	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	8.699	11.510	0	(137)	(137)	0,00
MYI	07.2021	SGD 12.080	\$ 8.987	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 8.986	SGD 12.080	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
SCX	07.2021	\$ 8.305	SGD 11.008	\$ 0	\$ (116)	\$ (116)	0,00
SSB	07.2021	SGD 180	\$ 136	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 1.182	SGD 1.570	0	(14)	(14)	0,00
UAG	07.2021	135	179	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 12	\$ (418)	\$ (406)	(0,01)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (57.339)	(1,11)
Summe Anlagen						\$ 5.208.983	100,82
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (42.473)	(0,82)
Nettovermogen						\$ 5.166.510	100,00

ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschrankte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Falligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
JPMorgan Structured Products BV	3,550 %	29.12.2021	02.04.2021	\$ 13.895	\$ 13.756	0,27
JPMorgan Structured Products BV	3,650	14.10.2024	18.10.2019	8.400	8.409	0,16
JPMorgan Structured Products BV	11,730	11.03.2022	30.03.2021	2.143	2.185	0,04
JPMorgan Structured Products BV	11,750	17.06.2022	12.03.2021	1.382	1.365	0,03
JPMorgan Structured Products BV	12,000	28.08.2026	15.06.2021	1.561	1.457	0,03
JPMorgan Structured Products BV	12,000	04.01.2027	15.06.2021	1.358	1.223	0,02
JPMorgan Structured Products BV	14,000	28.05.2031	24.05.2021 - 01.06.2021	3.356	3.335	0,06
JPMorgan Structured Products BV	14,000	09.12.2031	24.05.2021 - 01.06.2021	1.744	1.554	0,03
JPMorgan Structured Products BV	17,250	07.01.2022	15.01.2021	13.275	13.857	0,27
Sunac China Holdings Ltd.	5,950	30.12.2021	01.11.2021	10.799	10.808	0,21
				\$ 57.913	\$ 57.949	1,12

(j) Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 149.908 als Sicherheiten verpfandet.

(k) Gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 7.199 und Barmittel in Hohe von USD 49.849 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 269 und Barmittel in Hohe von USD 2.593 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Hohe von USD 25.476 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Bewertung zum Marktwert¹

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)		Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)		Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)		Marktwert
	\$		\$		\$		
Ubertragbare Wertpapiere	\$	1	\$	4.954.992	\$	7.162	\$ 4.962.155
Investmentfonds		301.709		0		0	301.709
Finanzderivate ⁽³⁾		(1.590)		(53.291)		0	(54.881)
Summen	\$	300.120	\$	4.901.701	\$	7.162	\$ 5.208.983

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten			Marktwert
	notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 4.924.892	\$ 24.844	\$ 4.949.737
Investmentfonds	381.348	0	0	381.348
Pensionsgeschäfte	0	3.386	0	3.386
Finanzderivate ⁽³⁾	(815)	39.683	0	38.868
Summen	\$ 380.534	\$ 4.967.961	\$ 24.844	\$ 5.373.339

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrech-nungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlich-keiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BPS	(0,750) %	16.06.2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (2.354)	\$ (2.353)	(0,05)
	(0,500)	19.05.2021	TBD ⁽¹⁾	(5.404)	(5.401)	(0,10)
	(0,500)	09.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(5.225)	(5.224)	(0,10)
	0,150	08.02.2021	TBD ⁽¹⁾	(5.855)	(5.858)	(0,11)
	0,350	18.06.2021	16.09.2021	(23.272)	(23.275)	(0,45)
JML	0,390	10.05.2021	12.08.2021	(23.903)	(23.916)	(0,46)
	(2,000)	17.06.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (1.315)	(1.559)	(0,03)
	(0,150)	23.04.2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (5.537)	(5.535)	(0,11)
	0,320	25.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(8.540)	(8.541)	(0,17)
	0,350	07.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(8.338)	(8.344)	(0,16)
NOM	0,600	07.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(2.780)	(2.784)	(0,05)
	0,000	24.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(10.763)	(10.763)	(0,21)
	0,100	20.05.2021	TBD ⁽¹⁾	(9.165)	(9.166)	(0,18)
SCX	0,350	21.05.2021	20.08.2021	(19.462)	(19.469)	(0,38)
	0,370	23.06.2021	20.09.2021	(4.515)	(4.515)	(0,09)
	0,370	23.06.2021	20.09.2021	(1.104)	(1.104)	(0,02)
	0,370	02.07.2021	20.09.2021	(4.113)	(4.113)	(0,08)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte				\$ (141.920)	(141.920)	(2,75)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (528)	\$ 270	\$ (258)
BPS	(18.478)	15.960	(2.518)
BRC	(2.742)	2.672	(70)
CBK	3.099	(3.530)	(431)
DUB	2.029	(2.330)	(301)
FBF	100	0	100
GLM	(1.376)	1.091	(285)
GST	1.467	(1.490)	(23)
HUS	245	(353)	(108)
JPM	691	(880)	(189)
MYC	282	(323)	(41)
MYI	(850)	690	(160)
RYL	3	0	3
SCX	(17.024)	15.276	(1.748)
SSB	(8)	0	(8)
TOR	(23.352)	20.540	(2.812)
UAG	(897)	549	(348)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,15	80,20
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	8,66	13,69
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,24	0,16
Investmentfonds	5,84	7,25
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,06
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,02	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,02	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,11)	0,75
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(2,75)	(2,62)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Angola	1,27	1,20
Argentinien	2,07	2,19
Armenien	0,25	0,05
Österreich	0,09	0,09
Aserbaidshjan	0,98	0,97
Bahamas	0,26	0,24
Bahrain	0,57	0,34
Weissrussland	0,03	0,04
Bermudas	0,15	0,15
Brasilien	3,17	3,70
Cayman Inseln	4,16	2,56
Chile	1,76	2,45
China	2,08	2,34
Kolumbien	1,81	1,59
Costa Rica	0,33	0,29
Kroatien	k. A.	0,03
Dominikanische Republik	2,27	2,82
Ecuador	1,37	0,94
Ägypten	2,95	2,86
El Salvador	0,30	0,32
Äthiopien	0,06	0,06
Gabun	0,02	0,02
Deutschland	0,34	0,34
Ghana	1,45	1,14
Guatemala	1,10	1,23
Hongkong	0,72	0,73
Ungarn	0,20	0,79
Indien	0,79	0,97
Indonesien	5,61	5,61
Irland	0,42	0,42
Israel	0,63	0,92
Elfenbeinküste	1,41	1,31
Jamaika	0,07	0,08
Jordanien	0,67	0,53
Kasachstan	0,99	1,31
Kenia	0,37	0,12
Luxemburg	1,57	1,33
Malaysia	0,91	0,64
Marshallinseln	0,01	0,01
Mauritius	0,08	0,08
Mexiko	7,84	7,88
Mongolei	0,77	0,39
Marokko	0,71	0,46
Multinational	0,22	k. A.
Namibia	0,18	0,10
Niederlande	0,92	1,03
Nigeria	2,40	2,08
Oman	1,97	1,26
Pakistan	0,53	0,30
Panama	1,31	1,25
Paraguay	0,25	0,40
Peru	1,30	1,50
Philippinen	1,00	1,35
Katar	1,72	2,38
Rumänien	1,12	1,42
Russland	1,62	2,78
Saudi-Arabien	3,85	3,27
Senegal	0,31	0,23
Serbien	0,25	0,66
Singapur	0,15	0,15
Südafrika	5,04	4,63
Spanien	0,00	0,00
Sri Lanka	1,00	0,77
Supranational	0,07	0,06
Tansania	0,04	0,06
Thailand	0,14	0,07

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Trinidad und Tobago	0,01	0,02
Tunesien	0,08	0,08
Türkei	5,39	4,48
Ukraine	3,08	2,25
Vereinigte Arabische Emirate	1,56	3,07
Großbritannien	1,03	1,13
USA	3,01	2,65
Uruguay	0,63	1,11
Venezuela	0,28	0,25
Vietnam	0,01	0,01
Jungfernseln (Britisch)	0,68	0,17
Sambia	0,22	0,18
Kurzfristige Instrumente	2,07	1,36
Investmentfonds	5,84	7,25
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,06
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,02	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	(0,01)
Zinsswaps	0,02	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,12	0,05
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,03)	0,04
Devisenterminkontrakte	0,23	(0,24)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,43)	0,90
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,82)	(2,10)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
10,375 % fällig am 28.01.2033	\$ 1.100	\$ 1.655	0,07
		43.605	1,83
Summe Kolumbien		57.901	2,43

COSTA RICA STAATSEMISSIONEN			
Costa Rica Government International Bond			
4,250 % fällig am 26.01.2023	5.180	5.269	0,22
5,625 % fällig am 30.04.2043 (g)	15.650	14.537	0,61
6,125 % fällig am 19.02.2031	1.400	1.488	0,06
7,158 % fällig am 12.03.2045	400	419	0,02
Summe Costa Rica		21.713	0,91

DOMINIKANISCHE REPUBLIK STAATSEMISSIONEN			
Dominican Republic Government International Bond			
4,875 % fällig am 23.09.2032	7.900	8.157	0,34
5,300 % fällig am 21.01.2041	6.800	6.800	0,29
5,500 % fällig am 27.01.2025	5.500	6.052	0,26
5,875 % fällig am 30.01.2060	21.950	21.928	0,92
5,950 % fällig am 25.01.2027	17.500	19.722	0,83
6,000 % fällig am 19.07.2028	1.120	1.276	0,05
6,400 % fällig am 05.06.2049	2.500	2.694	0,11
6,500 % fällig am 15.02.2048	200	219	0,01
6,850 % fällig am 27.01.2045	100	113	0,01
6,875 % fällig am 29.01.2026	4.500	5.225	0,22
8,900 % fällig am 15.02.2023	DOP 43.300	798	0,03
9,750 % fällig am 05.06.2026	87.700	1.746	0,07
10,750 % fällig am 11.08.2028	34.100	705	0,03
Summe Dominikanische Republik		75.435	3,17

ECUADOR STAATSEMISSIONEN			
Ecuador Government International Bond			
0,000 % fällig am 31.07.2030 (b)	\$ 9.216	5.124	0,21
0,500 % fällig am 31.07.2030	17.534	15.123	0,64
0,500 % fällig am 31.07.2035	37.200	25.621	1,08
0,500 % fällig am 31.07.2040	13.727	8.545	0,36
Summe Ecuador		54.413	2,29

AGYPTE STAATSEMISSIONEN			
Egypt Government International Bond			
4,750 % fällig am 16.04.2026	€ 4.800	5.950	0,25
5,250 % fällig am 06.10.2025	\$ 34.100	36.032	1,51
5,625 % fällig am 16.04.2030	€ 1.100	1.313	0,06
6,125 % fällig am 31.01.2022	\$ 13.400	13.717	0,58
6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 3.700	4.586	0,19
7,053 % fällig am 15.01.2032	\$ 6.200	6.375	0,27
7,500 % fällig am 31.01.2027	300	338	0,02
7,625 % fällig am 29.05.2032	7.600	8.084	0,34
7,903 % fällig am 21.02.2048	5.500	5.460	0,23
8,500 % fällig am 31.01.2047	1.000	1.045	0,04
8,700 % fällig am 01.03.2049	2.300	2.437	0,10
14,313 % fällig am 13.10.2023	EGP 15.000	959	0,04
14,369 % fällig am 20.10.2025	18.400	1.170	0,05
14,605 % fällig am 08.09.2025	15.000	965	0,04
Summe Ägypten		88.431	3,72

EL SALVADOR STAATSEMISSIONEN			
El Salvador Government International Bond			
5,875 % fällig am 30.01.2025	\$ 300	278	0,01
6,375 % fällig am 18.01.2027	3.600	3.267	0,14
7,125 % fällig am 20.01.2050	5.600	4.788	0,20
7,625 % fällig am 21.09.2034	1.100	1.001	0,04
7,625 % fällig am 01.02.2041	250	223	0,01
7,650 % fällig am 15.06.2035	1.000	918	0,04
7,750 % fällig am 24.01.2023	110	109	0,01
9,500 % fällig am 15.07.2052	7.750	7.653	0,32
Summe El Salvador		18.237	0,77

GEORGIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Georgian Railway JSC			
4,000 % fällig am 17.06.2028	11.000	11.102	0,47

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Deutsche Bank AG			
3,700 % fällig am 30.05.2024	\$ 600	\$ 643	0,03

GHANA STAATSEMISSIONEN			
Ghana Government International Bond			
0,000 % fällig am 07.04.2025 (b)	1.200	957	0,04
6,375 % fällig am 11.02.2027	3.500	3.525	0,15
7,625 % fällig am 16.05.2029	3.300	3.347	0,14
7,750 % fällig am 07.04.2029	7.100	7.274	0,31
7,875 % fällig am 26.03.2027	1.100	1.165	0,05
7,875 % fällig am 11.02.2035	8.100	8.004	0,34
8,125 % fällig am 18.01.2026	200	216	0,01
8,125 % fällig am 26.03.2032	15.300	15.553	0,65
8,625 % fällig am 07.04.2034	4.600	4.760	0,20
8,627 % fällig am 16.06.2049	1.600	1.545	0,06
8,750 % fällig am 11.03.2061	15.750	15.184	0,64
8,950 % fällig am 26.03.2051	5.300	5.255	0,22
Summe Ghana		66.785	2,81

GUATEMALA STAATSEMISSIONEN			
Guatemala Government International Bond			
4,375 % fällig am 05.06.2027	4.200	4.591	0,19
4,500 % fällig am 03.05.2026	1.600	1.760	0,07
4,875 % fällig am 13.02.2028	3.300	3.729	0,16
4,900 % fällig am 01.06.2030	2.000	2.257	0,10
5,375 % fällig am 24.04.2032	500	582	0,02
5,750 % fällig am 06.06.2022	2.270	2.363	0,10
6,125 % fällig am 01.06.2050	3.900	4.787	0,20
Summe Guatemala		20.069	0,84

GUERNSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
2,950 % fällig am 29.07.2026	€ 3.500	4.502	0,19

HONGKONG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AIA Group Ltd.			
3,200 % fällig am 16.09.2040	\$ 200	208	0,01
Fortune Star BVI Ltd.			
5,950 % fällig am 19.10.2025	4.000	4.205	0,18
Huarong Finance Co. Ltd.			
1,275 % fällig am 24.02.2023	1.600	1.197	0,05
3,375 % fällig am 24.02.2030	500	344	0,01
4,500 % fällig am 29.05.2029	1.000	695	0,03
Lenovo Group Ltd.			
3,421 % fällig am 02.11.2030	1.300	1.361	0,06
MTR Corp. Ltd.			
1,625 % fällig am 19.08.2030 (g)	7.300	7.083	0,30
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.			
4,200 % fällig am 07.06.2024	2.800	3.007	0,12
Yanlord Land HK Co. Ltd.			
5,125 % fällig am 20.05.2026	4.700	4.804	0,20
Summe Hongkong		22.904	0,96

STAATSEMISSIONEN			
Airport Authority Hong Kong			
2,100 % fällig am 08.03.2026 (d)	1.800	1.811	0,08
2,400 % fällig am 08.03.2028 (d)	3.000	2.999	0,12
Hong Kong Government International Bond			
2,375 % fällig am 02.02.2051 (g)	1.200	1.173	0,05
Summe Hongkong		5.983	0,25
Summe Hongkong		28.887	1,21

UNGARN STAATSEMISSIONEN			
Hungary Government International Bond			
1,750 % fällig am 05.06.2035	€ 3.900	4.914	0,21

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
INDIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Adani Renewable Energy RJ Ltd.			
4,625 % fällig am 15.10.2039	\$ 4.158	\$ 4.235	0,18
Indian Railway Finance Corp. Ltd.			
3,835 % fällig am 13.12.2027	4.600	4.974	0,21
JSW Hydro Energy Ltd.			
4,125 % fällig am 18.05.2031	9.500	9.652	0,40
Muthoot Finance Ltd.			
4,400 % fällig am 02.09.2023	900	928	0,04
ReNew Power Pvt Ltd.			
4,500 % fällig am 14.07.2028	10.000	10.190	0,43
5,875 % fällig am 05.03.2027	2.000	2.139	0,09
Shriram Transport Finance Co. Ltd.			
4,400 % fällig am 13.03.2024	4.700	4.722	0,20
UltraTech Cement Ltd.			
2,800 % fällig am 16.02.2031	8.000	7.760	0,32
Wipro IT Services LLC			
1,500 % fällig am 23.06.2026	10.000	9.988	0,42
Summe Indien		54.588	2,29

INDONESIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Bank Mandiri Persero Tbk PT			
2,000 % fällig am 19.04.2026	8.700	8.719	0,37
3,750 % fällig am 11.04.2024	2.000	2.128	0,09
Pelabuhan Indonesia PT			
4,250 % fällig am 05.05.2025	3.700	4.039	0,17
5,375 % fällig am 05.05.2045	1.000	1.202	0,05
Summe Indonesien		16.088	0,68

STAATSEMISSIONEN			
Indonesia Government International Bond			
1,100 % fällig am 12.03.2033	€ 1.400	1.627	0,07
3,375 % fällig am 30.07.2025	1.100	1.462	0,06
3,850 % fällig am 18.07.2027	\$ 1.500	1.674	0,07
4,350 % fällig am 08.01.2027	300	340	0,01
4,350 % fällig am 11.01.2048	11.400	12.974	0,54
4,750 % fällig am 18.07.2047	4.400	5.254	0,22
5,125 % fällig am 15.01.2045	1.200	1.489	0,06
5,250 % fällig am 17.01.2042	900	1.124	0,05
5,250 % fällig am 08.01.2047	200	255	0,01
6,750 % fällig am 15.01.2044	3.000	4.446	0,19
7,750 % fällig am 17.01.2038	180	273	0,01
Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia			
3,875 % fällig am 06.04.2024	800	858	0,04
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
2,300 % fällig am 23.06.2025	9.100	9.462	0,40
2,800 % fällig am 23.06.2030	500	512	0,02
3,550 % fällig am 09.06.2051	5.500	5.609	0,24
3,800 % fällig am 23.06.2050	3.500	3.675	0,15
4,400 % fällig am 01.03.2028	2.200	2.514	0,10
4,450 % fällig am 20.02.2029	2.400	2.763	0,12
Summe Indonesien		72.399	3,04

IRLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC			
5,950 % fällig am 15.04.2030 (e)	700	737	0,03
Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC			
3,949 % fällig am 24.04.2023	1.700	1.773	0,07
Sovcombank Via SovCom Capital DAC			
3,400 % fällig am 26.01.2025	5.400	5.421	0,23
Summe Irland		7.931	0,33

INSEL MAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
NE Property BV			
2,625 % fällig am 22.05.2023	€ 700	864	0,03
3,375 % fällig am 14.07.2027	2.300	3.036	0,13
Summe Isle of Man		3.900	0,16

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ISRAEL				BESCHREIBUNG				BESCHREIBUNG			
STAATSEMISSIONEN				MAURITIUS				MULTINATIONAL			
Unternehmensanleihen und Wechsel				Unternehmensanleihen und Wechsel				Unternehmensanleihen und Wechsel			
Israel Government International Bond				Aziata Spv5 Labuan Ltd.				4,250 % fällig am 11.12.2022			
3,800 % fällig am 13.05.2060	\$ 2.000	\$ 2.282	0,10	3,064 % fällig am 19.08.2050	\$ 3.800	\$ 3.651	0,15	5,500 % fällig am 11.12.2042	\$ 2.300	\$ 2.419	0,10
				Malaysia Wakala Sukuk Bhd.					4.400	5.016	0,21
				2,070 % fällig am 28.04.2031	17.300	17.526	0,74	Summe Marokko		39.368	1,65
				Summe Malaysia		21.769	0,91	NAMIBIA			
				Unternehmensanleihen und Wechsel				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Azure Power Energy Ltd.				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				5,500 % fällig am 03.11.2022	1.700	1.728	0,07	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Azure Power Solar Energy Pvt Ltd.				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				5,650 % fällig am 24.12.2024	1.700	1.808	0,08	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Greenko Dutch BV				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				3,850 % fällig am 29.03.2026	8.800	9.027	0,38	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Greenko Solar Mauritius Ltd.				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				5,950 % fällig am 29.07.2026	7.300	7.879	0,33	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				India Green Energy Holdings				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				5,375 % fällig am 29.04.2024	9.400	9.848	0,41	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Summe Mauritius		30.290	1,27	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				MEXIKO				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Unternehmensanleihen und Wechsel				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				America Movil S.A.B. de C.V.				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				6,450 % fällig am 05.12.2022	MXN 2.000	101	0,00	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Banco Mercantil del Norte S.A.				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				7,500 % fällig am				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				27.06.2029 (d)(e)	\$ 3.400	3.846	0,16	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				7,625 % fällig am				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				10.01.2028 (d)(e)	300	341	0,02	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				8,375 % fällig am				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				14.10.2030 (d)(e)	400	485	0,02	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Banco Santander Mexico S.A.				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				4,125 % fällig am 09.11.2022	400	416	0,02	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				BBVA Bancomer S.A.				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				6,750 % fällig am 30.09.2022	16.840	17.915	0,75	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Cibanco S.A. Ibm				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				4,962 % fällig am 18.07.2029 (g)	2.700	2.987	0,13	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Corp. GEO S.A.B. de C.V.				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				8,875 % fällig am 25.09.2014 ^	500	0	0,00	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Metalsa S.A. de C.V.				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				3,750 % fällig am 04.05.2031	10.600	10.503	0,44	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Trust Fibra Uno				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				4,869 % fällig am 15.01.2030	300	331	0,01	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				6,390 % fällig am 15.01.2050	2.000	2.347	0,10	Unternehmensanleihen und Wechsel			
						39.272	1,65	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				STAATSEMISSIONEN				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Mexico Government International Bond				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				2,659 % fällig am 24.05.2031	500	490	0,02	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				3,750 % fällig am 11.01.2028	1.000	1.091	0,04	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				3,750 % fällig am 19.04.2071	7.200	6.602	0,28	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				3,771 % fällig am 24.05.2061 (g)	3.700	3.451	0,14	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				4,750 % fällig am 27.04.2032 (g)	4.700	5.393	0,23	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				5,000 % fällig am 27.04.2051	200	227	0,01	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				5,750 % fällig am 12.10.2110 (g)	8.700	10.428	0,44	Unternehmensanleihen und Wechsel			
						27.682	1,16	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Summe Mexiko		66.954	2,81	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				MONGOLEI				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Unternehmensanleihen und Wechsel				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Mongolia Government International Bond				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				3,500 % fällig am 07.07.2027 (a)	6.000	5.913	0,25	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				4,450 % fällig am 07.07.2031 (a)	7.800	7.671	0,32	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				5,125 % fällig am 05.12.2022	3.950	4.127	0,17	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				5,125 % fällig am 07.04.2026	1.100	1.177	0,05	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				5,625 % fällig am 01.05.2023	4.700	4.976	0,21	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Summe Mongolei		23.864	1,00	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				MAROKKO				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Unternehmensanleihen und Wechsel				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Morocco Government International Bond				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				1,500 % fällig am 27.11.2031	€ 1.900	2.121	0,09	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				2,375 % fällig am 15.12.2027	\$ 9.310	9.160	0,39	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				3,000 % fällig am 15.12.2032	5.000	4.842	0,20	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				4,000 % fällig am 15.12.2050	17.000	15.810	0,66	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				PANAMA				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Unternehmensanleihen und Wechsel				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Banco General S.A.				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				5,250 % fällig am 07.05.2031				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				(d)(e)	6.500	6.812	0,29	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Banco Nacional de Panama				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				2,500 % fällig am 11.08.2030	600	582	0,02	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Empresa de Transmision Electrica S.A.				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				5,125 % fällig am 02.05.2049	1.000	1.114	0,05	Unternehmensanleihen und Wechsel			
						8.508	0,36	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				STAATSEMISSIONEN				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				Panama Government International Bond				Unternehmensanleihen und Wechsel			
				2,252 % fällig am 29.09.2032	6.100	5.862	0,25	Unternehmensanleihen und Wechsel			
				3,160 % fällig am 23.01.2030	1.800	1.892	0,08	Unternehmensanleihen und Wechsel			

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
3,870 % fällig am 23.07.2060	\$ 8.500	\$ 8.701	0,36	3,000 % fällig am 14.02.2031	\$ 1.900	\$ 1.973	0,08	10,500 % fällig am 21.12.2026 (g)	ZAR 424.700	\$ 33.804	1,42
4,300 % fällig am 29.04.2053	12.900	14.338	0,80	3,375 % fällig am 28.01.2050	€ 1.900	2.411	0,10			91.653	3,85
4,500 % fällig am 15.05.2047	1.000	1.141	0,05	3,624 % fällig am 26.05.2030	700	962	0,04	Summe Südafrika		108.057	4,54
4,500 % fällig am 16.04.2050	16.800	19.121	0,80	4,000 % fällig am 14.02.2051	\$ 7.550	7.944	0,33	SÜDKOREA			
4,500 % fällig am 01.04.2056 (g)	10.400	11.793	0,49	4,625 % fällig am 03.04.2049	€ 400	603	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
6,700 % fällig am 26.01.2036 (g)	4.900	6.668	0,28	Summe Rumänien		58.631	2,46	Hyundai Capital Services, Inc.	\$ 9.700	9.557	0,40
7,125 % fällig am 29.01.2026	204	253	0,01	RUSLAND				1,250 % fällig am 08.02.2026			
8,125 % fällig am 28.04.2034	1.000	1.442	0,06	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				KB Kookmin Card Co. Ltd.	10.000	9.965	0,42
8,875 % fällig am 20.03.2027	800	1.105	0,05	MMK International Capital DAC				1,500 % fällig am 13.05.2026			
9,375 % fällig am 16.01.2023	180	205	0,01	4,375 % fällig am 13.06.2024	\$ 2.800	3.008	0,13	Kia Corp.			
9,375 % fällig am 01.04.2029	800	1.186	0,05	STAATSEMISSIONEN				1,000 % fällig am 16.04.2024	5.200	5.231	0,22
Summe Panama		73.707	3,09	Russia Government International Bond				Kookmin Bank			
		82.215	3,45	1,850 % fällig am 20.11.2032	€ 700	812	0,03	1,375 % fällig am 06.05.2026 (g)	9.400	9.413	0,40
PARAGUAY				4,750 % fällig am 27.05.2026	\$ 400	455	0,02	2,500 % fällig am 04.11.2030 (e)	2.500	2.491	0,10
STAATSEMISSIONEN				5,100 % fällig am 28.03.2035	1.800	2.144	0,09	Mirae Asset Securities Co. Ltd.			
Paraguay Government International Bond				5,250 % fällig am 23.06.2047	1.400	1.763	0,08	1,375 % fällig am 07.07.2024 (a)	17.600	17.605	0,74
2,739 % fällig am 29.01.2033	1.700	1.662	0,07	5,625 % fällig am 04.04.2042	2.000	2.573	0,11	Shinhan Bank Co. Ltd.			
4,950 % fällig am 28.04.2031	2.100	2.417	0,10	5,875 % fällig am 16.09.2043	600	802	0,03	1,375 % fällig am 21.10.2026	9.000	9.019	0,38
5,400 % fällig am 30.03.2050	9.900	11.590	0,49	Summe Russland		8.549	0,36	Shinhan Card Co. Ltd.			
5,600 % fällig am 13.03.2048	1.800	2.122	0,09			11.557	0,49	1,375 % fällig am 19.10.2025	3.000	3.004	0,13
6,100 % fällig am 11.08.2044	2.700	3.367	0,14	SENEGAL				1,375 % fällig am 23.06.2026	3.000	2.979	0,12
Summe Paraguay		21.158	0,89	STAATSEMISSIONEN				Shinhan Financial Group Co. Ltd.			
PERU				Senegal Government International Bond				2,875 % fällig am			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 1.200	1.488	0,06	12.05.2026 (d)(e)	10.000	9.955	0,42
InRetail Consumer				5,375 % fällig am 08.06.2037	1.500	1.756	0,07	3,340 % fällig am			
3,250 % fällig am 22.03.2028	3.700	3.665	0,16	6,250 % fällig am 23.05.2033	\$ 14.600	15.434	0,65	05.02.2030 (e)	5.100	5.337	0,22
STAATSEMISSIONEN				6,750 % fällig am 13.03.2048	600	608	0,03	SK Hynix, Inc.			
Peru Government International Bond				Summe Senegal		19.286	0,81	2,375 % fällig am 19.01.2031	5.300	5.172	0,22
2,780 % fällig am 01.12.2060 (g)	11.200	10.019	0,42	SERBIEN				Woori Card Co. Ltd.			
2,783 % fällig am 23.01.2031 (g)	2.200	2.247	0,09	STAATSEMISSIONEN				1,750 % fällig am 23.03.2026	6.000	6.023	0,25
3,230 % fällig am 28.07.2121 (g)	3.300	2.907	0,12	Serbia Government International Bond							
5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN 4.600	1.066	0,05	1,500 % fällig am 26.06.2029	€ 900	1.077	0,05	STAATSEMISSIONEN			
6,350 % fällig am 12.08.2028	10.700	3.127	0,13	1,650 % fällig am 03.03.2033	4.400	5.120	0,21	Export-Import Bank of Korea			
6,550 % fällig am 14.03.2037	\$ 1.690	2.333	0,10	3,125 % fällig am 15.05.2027	6.600	8.721	0,37	2,500 % fällig am 29.06.2041	6.400	6.366	0,27
Summe Peru		21.699	0,91	Summe Serbien		14.918	0,63	Korea Expressway Corp.			
		25.364	1,07	SINGAPUR				1,125 % fällig am 17.05.2026	4.800	4.777	0,20
PHILIPPINEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				BOC Aviation Ltd.				Summe Südkorea		106.894	4,49
Jollibee Worldwide Pte. Ltd.				3,500 % fällig am 10.10.2024 (g)	\$ 2.700	2.881	0,12	SRI LANKA			
4,125 % fällig am 24.01.2026	2.100	2.266	0,10	Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.				STAATSEMISSIONEN			
4,750 % fällig am 24.06.2030	3.300	3.509	0,15	4,250 % fällig am 25.03.2027	5.600	5.712	0,24	Sri Lanka Government International Bond			
PLDT, Inc.				Continuum Energy Levanter Pte. Ltd.				5,750 % fällig am 18.01.2022 (g)	1.750	1.611	0,07
2,500 % fällig am 23.01.2031 (g)	800	793	0,03	4,500 % fällig am 09.02.2027	6.000	6.152	0,26	5,750 % fällig am 18.04.2023	7.100	5.316	0,22
3,450 % fällig am 23.06.2050 (g)	3.900	3.918	0,16	Flex Ltd.				5,875 % fällig am 25.07.2022 (g)	4.050	3.442	0,14
		10.486	0,44	4,875 % fällig am 15.06.2029	200	231	0,01	6,125 % fällig am 03.06.2025	3.700	2.516	0,11
STAATSEMISSIONEN				United Overseas Bank Ltd.				6,200 % fällig am 11.05.2027	7.100	4.401	0,19
Philippines Government International Bond				1,250 % fällig am 14.04.2026	8.000	8.010	0,33	6,250 % fällig am 27.07.2021	3.300	3.251	0,14
2,650 % fällig am 10.12.2045	2.800	2.594	0,11	2,000 % fällig am 14.10.2031 (e)	10.000	10.016	0,42	6,825 % fällig am 18.07.2026	3.800	2.442	0,10
2,950 % fällig am 05.05.2045 (g)	7.500	7.259	0,31	2,880 % fällig am 08.03.2027 (e)	200	203	0,01	6,850 % fällig am 14.03.2024	900	628	0,03
3,200 % fällig am 06.07.2046 (a)	12.900	12.965	0,54	Summe Singapur		33.205	1,39	6,850 % fällig am 03.11.2025	3.000	2.017	0,08
3,700 % fällig am 01.03.2041	300	325	0,01	SÜDAFRIKA				7,550 % fällig am 28.03.2030	16.900	10.697	0,45
Summe Philippinen		23.143	0,97	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,850 % fällig am 14.03.2029	1.600	1.024	0,04
		33.629	1,41	Absa Group Ltd.				Summe Sri Lanka		37.345	1,57
KATAR				6,375 % fällig am 27.05.2026	11.200	11.469	0,48	SUPRANATIONAL			
STAATSEMISSIONEN				(d)(e)				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Qatar Government International Bond				Growthpoint Properties International Pty. Ltd.				African Export-Import Bank			
3,750 % fällig am 16.04.2030 (g)	7.200	8.162	0,34	5,872 % fällig am 02.05.2023	1.300	1.395	0,06	2,634 % fällig am 17.05.2026	5.500	5.587	0,23
4,400 % fällig am 16.04.2050 (g)	5.300	6.463	0,27	Prosus NV				Asian Development Bank			
4,400 % fällig am 16.04.2050	5.400	6.585	0,28	4,850 % fällig am 06.07.2027	2.500	2.853	0,12	4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN 89.800	4.518	0,19
4,817 % fällig am 14.03.2049 (g)	5.000	6.451	0,27	5,500 % fällig am 21.07.2025	600	687	0,03	Banque Ouest Africaine de Developpement			
Summe Katar		27.661	1,16	Summe Südafrika		16.404	0,69	2,750 % fällig am 22.01.2033	€ 5.400	6.733	0,28
RUMÄNIEN				STAATSEMISSIONEN				5,000 % fällig am 27.07.2027	\$ 800	893	0,04
STAATSEMISSIONEN				South Africa Government International Bond				Eastern & Southern African Trade & Development Bank			
Romania Government International Bond				4,300 % fällig am 12.10.2028	12.000	12.421	0,52	4,125 % fällig am 30.06.2028	11.600	11.606	0,49
2,000 % fällig am 08.12.2026	€ 300	383	0,02	4,850 % fällig am 27.09.2027	3.200	3.444	0,15				
2,124 % fällig am 16.07.2031	25.660	31.472	1,32	4,850 % fällig am 30.09.2029	5.200	5.529	0,23				
2,625 % fällig am 02.12.2040	3.600	4.244	0,18	4,875 % fällig am 14.04.2026	6.500	7.073	0,30				
2,750 % fällig am 14.04.2041	7.200	8.506	0,36	5,000 % fällig am 12.10.2046	2.000	1.903	0,08				
2,875 % fällig am 26.05.2028	100	133	0,01	5,750 % fällig am 30.09.2049	26.800	27.479	1,15				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
INTERNATIONALE BANK FÜR WIEDERAUFBAU UND ENTWICKLUNG			
5,310 % fällig am 05.02.2026	ZAR 114.000	\$ 7.639	0,32
INTERNATIONAL FINANCE CORP.			
8,000 % fällig am 09.10.2023	IDR 57.500.000	4.224	0,18
		41.200	1,73
STAATSEMISSIONEN			
Ghana Government International Bond			
10,750 % fällig am 14.10.2030	\$ 200	253	0,01
Summe übernational		41.453	1,74
TANSANIA			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania			
5,364 % fällig am 23.06.2022	486	486	0,02
TUNESIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Banque Centrale de Tunisie Government International Bond			
5,625 % fällig am 17.02.2024	€ 900	1.000	0,04
5,750 % fällig am 30.01.2025	\$ 1.000	936	0,04
6,375 % fällig am 15.07.2026	€ 900	989	0,04
Summe Tunesien		2.925	0,12
TÜRKEI			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Akbank T.A.S.			
6,800 % fällig am 22.06.2031 (e)	\$ 13.000	13.000	0,54
Hazine Mustesizli Vartik Kiralama A/S			
5,004 % fällig am 06.04.2023	200	205	0,01
5,125 % fällig am 22.06.2026	17.800	17.806	0,75
TC Ziraat Bankasi A/S			
5,375 % fällig am 02.03.2026	6.500	6.411	0,27
Turkish Airlines Pass-Through Trust			
4,200 % fällig am 15.09.2028	255	239	0,01
Türkiye İş Bankasi A/S			
6,125 % fällig am 25.04.2024	1.800	1.879	0,08
Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari A/S			
6,500 % fällig am 14.03.2026	1.700	1.894	0,08
Türkiye Vakiflar Bankasi TAO			
6,500 % fällig am 08.01.2026	4.600	4.724	0,20
		46.158	1,94
STAATSEMISSIONEN			
Export-Credit Bank of Turkey			
4,250 % fällig am 18.09.2022	6.100	6.195	0,26
5,375 % fällig am 24.10.2023	900	928	0,04
8,250 % fällig am 24.01.2024	1.500	1.633	0,07
Turkey Government International Bond			
4,250 % fällig am 13.03.2025	1.000	983	0,04
4,750 % fällig am 26.01.2026	1.800	1.774	0,08
4,875 % fällig am 16.04.2043	5.200	4.155	0,18
5,125 % fällig am 17.02.2028	4.500	4.382	0,18
5,750 % fällig am 11.05.2047	7.300	6.256	0,26
5,875 % fällig am 26.06.2031	2.400	2.338	0,10
5,950 % fällig am 15.01.2031	5.400	5.306	0,22
6,000 % fällig am 14.01.2041	600	545	0,02
6,375 % fällig am 14.10.2025	2.000	2.098	0,09
6,875 % fällig am 17.03.2036	3.130	3.171	0,13
7,250 % fällig am 05.03.2038	200	210	0,01
Türkiye İhracat Kredi Bankasi A/S			
5,750 % fällig am 06.07.2026	11.600	11.529	0,48
		51.503	2,16
Summe Türkei		97.661	4,10
UKRAINE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
State Agency of Roads of Ukraine			
6,250 % fällig am 24.06.2028	10.000	10.018	0,42

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
UKRAINE			
STAATSEMISSIONEN			
Ukraine Government International Bond			
1,258 % fällig am 31.05.2040	\$ 9.800	\$ 11.414	0,48
4,375 % fällig am 27.01.2030	€ 2.000	2.222	0,09
6,876 % fällig am 21.05.2029	\$ 8.300	8.637	0,36
7,253 % fällig am 15.03.2033	17.100	17.858	0,75
7,750 % fällig am 01.09.2021	41.967	42.387	1,78
7,750 % fällig am 01.09.2022	10.100	10.631	0,45
7,750 % fällig am 01.09.2023	5.200	5.615	0,24
7,750 % fällig am 01.09.2024	4.000	4.374	0,18
7,750 % fällig am 01.09.2025	9.000	9.880	0,42
7,750 % fällig am 01.09.2026	100	111	0,00
		113.129	4,75
Summe Ukraine		123.147	5,17
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Abu Dhabi Ports Co. PJSC			
2,500 % fällig am 06.05.2031	4.700	4.757	0,20
DAE Sukuk Dfc Ltd.			
3,750 % fällig am 15.02.2026	5.300	5.624	0,24
DP World PLC			
5,625 % fällig am 25.09.2048	1.000	1.253	0,05
6,850 % fällig am 02.07.2037	580	788	0,03
		12.422	0,52
STAATSEMISSIONEN			
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond			
2,700 % fällig am 02.09.2070 (g)	6.400	5.818	0,24
3,125 % fällig am 03.05.2026 (g)	1.000	1.094	0,05
3,125 % fällig am 30.09.2049 (g)	5.497	5.623	0,24
Emirate of Dubai Government International Bond			
3,900 % fällig am 09.09.2050	1.400	1.316	0,05
		13.851	0,58
Summe Vereinigte Arabische Emirate		26.273	1,10
GROSSBRITANNIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
HSBC Holdings PLC			
3,803 % fällig am 11.03.2025 (g)	300	323	0,01
6,000 % fällig am 22.05.2027 (d)(e)	800	890	0,04
Natwest Group PLC			
4,269 % fällig am 22.03.2025	200	217	0,01
5,076 % fällig am 27.01.2030	300	356	0,01
State Savings Bank of Ukraine Via SSB PLC			
9,375 % fällig am 10.03.2023	437	461	0,02
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC			
8,250 % fällig am 09.07.2024	3.100	3.273	0,14
Ukreximbank Via Biz Finance PLC			
9,750 % fällig am 22.01.2025	1.000	1.078	0,05
Summe Großbritannien		6.598	0,28
USA			
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
0,332 % fällig am 25.02.2037	1.047	1.023	0,04
1,217 % fällig am 25.11.2035	640	637	0,03
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
3,264 % fällig am 25.01.2037 ^	2.595	1.193	0,05
Long Beach Mortgage Loan Trust			
0,242 % fällig am 25.09.2036	1.007	742	0,03
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
0,312 % fällig am 25.11.2036	1.063	792	0,03
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
0,887 % fällig am 25.03.2034	1.077	1.066	0,05
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
0,242 % fällig am 25.07.2036	230	221	0,01
Option One Mortgage Loan Trust			
0,312 % fällig am 25.05.2037	280	208	0,01
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
0,872 % fällig am 25.09.2035	1.000	966	0,04
Saxon Asset Securities Trust			
0,402 % fällig am 25.09.2037	72	71	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SOUNDVIEW HOME LOAN TRUST			
0,272 % fällig am 25.02.2037	\$ 213	\$ 80	0,00
0,992 % fällig am 25.10.2037	157	139	0,01
		7.138	0,30
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Alphabet, Inc.			
2,250 % fällig am 15.08.2060 (g)	4.100	3.629	0,15
Bank of America Corp.			
0,981 % fällig am 25.09.2025 (g)	8.700	8.698	0,37
Ford Motor Credit Co. LLC			
3,550 % fällig am 07.10.2022	600	617	0,03
JPMorgan Chase & Co.			
0,653 % fällig am 16.09.2024 (g)	2.600	2.602	0,11
JPMorgan Structured Products BV			
3,650 % fällig am 14.10.2024 (f)	1.543	1.545	0,06
11,750 % fällig am 17.06.2022 (f) UAH	29.000	1.070	0,04
12,000 % fällig am 28.08.2026 (f) ZMW	30.500	680	0,03
12,000 % fällig am 04.01.2027 (f)	26.300	572	0,02
14,000 % fällig am 28.05.2031 (f)	60.100	1.230	0,05
14,000 % fällig am 09.12.2031 (f)	27.900	588	0,02
MercadoLibre, Inc.			
2,375 % fällig am 14.01.2026	\$ 7.300	7.357	0,31
Morgan Stanley			
0,864 % fällig am 21.10.2025 (g)	2.500	2.500	0,11
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.			
0,000 % fällig am 30.09.2036 (b)	2.200	1.599	0,07
		32.687	1,37
NON-AGENCY-MBS			
CitiMortgage Alternative Loan Trust			
0,742 % fällig am 25.10.2036	107	88	0,01
Countrywide Alternative Loan Trust			
0,442 % fällig am 25.05.2036 ^	132	67	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
0,592 % fällig am 30.11.2037	600	569	0,03
IndyMac Mortgage Loan Trust			
0,272 % fällig am 25.02.2037	331	335	0,02
0,732 % fällig am 25.07.2045	72	65	0,00
2,790 % fällig am 25.11.2037	269	262	0,01
JPMorgan Resecuritization Trust			
2,500 % fällig am 25.03.2056	64	64	0,00
Lehman XS Trust			
0,282 % fällig am 25.09.2046	295	299	0,01
0,342 % fällig am 25.08.2037	1.460	1.420	0,06
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
0,392 % fällig am 25.02.2037	564	548	0,02
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
2,910 % fällig am 25.10.2037 ^	102	96	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
2,931 % fällig am 25.03.2036	314	314	0,01
		4.127	0,18
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,500 % fällig am 01.09.2051	650	670	0,03
3,500 % fällig am 01.08.2051	2.600	2.738	0,11
		3.408	0,14
Summe USA		47.360	1,99
URUGUAY			
STAATSEMISSIONEN			
Uruguay Government International Bond			
4,125 % fällig am 20.11.2045	700	830	0,04
4,375 % fällig am 23.01.2031 (g)	16.604	19.360	0,81
4,975 % fällig am 20.04.2055 (g)	15.700	20.296	0,85
5,100 % fällig am 18.06.2050 (g)	14.418	18.927	0,80
7,625 % fällig am 21.03.2036	2.680	4.100	0,17
7,875 % fällig am 15.01.2033	2.730	4.126	0,17
Summe Uruguay		67.639	2,84
VIETNAM			
STAATSEMISSIONEN			
Vietnam Government International Bond			
4,800 % fällig am 19.11.2024	1.000	1.118	0,05

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
JUNGFERNINSELN (BRITISCH)				KURZFRISTIGE SCHULDITITEL				13,300 % fällig am 23.11.2021 (b)(c)			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Federal Home Loan Bank							
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.				0,008 % fällig am 27.08.2021 (b)(c)	4.400	4.400	0,18				
5,125 % fällig am 15.05.2024	\$ 300	\$ 328	0,01							1.817	0,08
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.				JPMorgan Structured Products BV						20.878	0,88
6,750 % fällig am 24.04.2023	6.828	7.778	0,33	3,550 % fällig am 29.12.2021 (f)	€ 3.500	\$ 4.151	0,17	U.S. TREASURY BILLS			
Summe Jungfernseln (Britisch)		8.106	0,34	11,730 % fällig am 11.03.2022 (f)	UAH 36.000	1.333	0,06	0,012 % fällig am 12.09.2021 (a)(b)(c)(h)	\$ 5.000	\$ 5.000	0,21
				17,250 % fällig am 07.01.2022 (f)	105.000	4.030	0,17	0,013 % fällig am 01.07.2021 (b)(c)(h)	9.000	9.000	0,38
						13.914	0,58	0,020 % fällig am 28.09.2021 (b)(c)(h)	1.400	1.400	0,06
SAMBIA				EGYPT TREASURY BILLS				0,022 % fällig am 12.11.2021 (b)(c)(h)			
STAATSEMISSIONEN				12,850 % fällig am 13.07.2021 (b)(c)				0,023 % fällig am 09.09.2021 (b)(c)			
Zambia Government International Bond				EGP 27.200	1.727	0,07		0,023 % fällig am 12.10.2021 (b)(c)	11.900	11.898	0,50
5,375 % fällig am 20.09.2022 ^	1.200	760	0,03					0,023 % fällig am 09.09.2021 (b)(c)	13.600	13.599	0,57
8,500 % fällig am 14.04.2024 ^	4.000	2.575	0,11					0,046 % fällig am 27.07.2021 (b)(c)	23.400	23.399	0,98
8,970 % fällig am 30.07.2027 ^	1.000	635	0,03					0,051 % fällig am 30.09.2021 (a)(b)(c)	9.000	8.999	0,38
Summe Sambia		3.970	0,17					Summe kurzfristige Instrumente		129.587	5,44
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				13,049 % fällig am 03.08.2021 (b)(c)				Summe Übertragbare Wertpapiere			
COMMERCIAL PAPER				13,051 % fällig am 03.08.2021 (b)(c)				\$ 2.532.106			
Sunac China Holdings Ltd.										106,38	
5,950 % fällig am 30.12.2021 (f)	3.000	3.002	0,12								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	30.06.2021	01.07.2021	\$ 19.208	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	\$ (19.592)	\$ 19.208	\$ 19.208	0,81
					0,125 % fällig am 15.04.2022	(96.277)	93.800	93.800	3,94
TDM	0,030	30.06.2021	01.07.2021	93.800	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2026				
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (115.869)	\$ 113.008	\$ 113.008	4,75

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	336	\$ (445)	(0,02)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	28	(119)	(0,01)
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2021	405	(12)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	1.625	(456)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	1.114	682	0,03
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2021	128	288	0,02
				\$ (62)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (62)	0,00

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,863 %	02.01.2023	BRL 203.900	\$ (142)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	\$ 7.100	51	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 15.400	12	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	1.800	3	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	5,470	21.04.2025	MXN 32.600	90	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	5,520	24.04.2025	31.000	87	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	5,615	23.04.2025	128.300	363	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,100	26.02.2025	126.600	(361)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,100	28.02.2025	66.100	(193)	(0,01)
					\$ (90)	0,00
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (90)	0,00

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	(1,000) %	20.12.2025	\$ 3.000	\$ 255	\$ 75	\$ 330	0,01
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	4.900	620	(12)	608	0,03
BPS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	20.000	(818)	5	(813)	(0,03)
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	3.950	499	(9)	490	0,02
BRC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	10.000	(409)	2	(407)	(0,02)
CBK	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2025	2.800	238	70	308	0,01
DUB	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	5.000	632	(12)	620	0,03
GST	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	4.450	564	(13)	551	0,02
					\$ 1.581	\$ 106	\$ 1.687	0,07

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2022	\$ 3.500	\$ (13)	\$ 29	\$ 16	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	700	(34)	13	(21)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2031	1.200	(181)	30	(151)	(0,01)
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	13.800	(33)	225	192	0,01
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2021	1.900	(22)	30	8	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2023	5.000	63	6	69	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	6.400	26	31	57	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2022	1.300	(31)	39	8	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	1.200	(66)	30	(36)	0,00
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	300	(1)	2	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.300	(65)	25	(40)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2026	200	1	2	3	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	6.100	54	0	54	0,00
BRC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	800	(96)	(66)	(162)	(0,01)
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2030	1.400	(194)	30	(164)	(0,01)
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.000	0	7	7	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2031	13.400	(525)	99	(426)	(0,02)
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2025	17.500	360	(157)	203	0,01
	QNB Finance Ltd.	1,000	20.06.2023	900	7	0	7	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	600	(43)	45	2	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	400	(1)	3	2	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(3)	4	1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	3	(3)	0	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.100	18	1	19	0,00
	Trust Fibra Uno	1,000	20.06.2022	1.100	(8)	(3)	(11)	0,00
DUB	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.000	(10)	25	15	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2022	2.100	(15)	26	11	0,00
FBF	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2021	1.600	(136)	134	(2)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	800	(3)	7	4	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.400	(75)	32	(43)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2031	1.500	(227)	39	(188)	(0,01)
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	14.000	(34)	33	(1)	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	13.700	99	23	122	0,01
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2026	10.000	(70)	154	84	0,00
HUS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(1)	3	2	0,00
JPM	Banque Centrale de Tunisie International Bond	1,000	20.06.2022	1.200	(85)	21	(64)	0,00
	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.100	26	(1)	25	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2021	3.800	(41)	57	16	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.400	16	49	65	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.500	(40)	38	(2)	0,00
MYC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	1.500	(289)	(14)	(303)	(0,01)
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	900	(4)	8	4	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2030	2.900	(405)	65	(340)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2026	15.000	208	100	308	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	200	(1)	2	1	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	1.200	(9)	19	10	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	12.100	65	43	108	0,01
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.600	34	(15)	19	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2025	12.000	38	99	137	0,01
MYI	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.300	11	1	12	0,00
	Ukraine Government International Bond	1,000	20.12.2021	7.500	(230)	180	(50)	0,00
					\$ (1.962)	\$ 1.550	\$ (412)	(0,02)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€	\$	7.463	8.960	\$ 110	0,01
	08.2021	\$	UAH	729	20.222	3	0,00
	09.2021	CNY	\$	1.355	211	2	0,00
BPS	09.2021	\$	RUB	1.058	77.218	0	0,00
	07.2021	€	\$	1.458	1.761	32	0,00
	07.2021	¥		9.800	90	1	0,00
BRC	07.2021	RUB		7.376	99	0	0,00
	08.2021	\$	MXN	8.208	175.050	548	0,02
	10.2021		PEN	9.959	38.376	86	0,00
CBK	02.2022		ZAR	1.523	22.296	0	0,00
	07.2021	PEN	\$	2.251	566	0	0,00
	07.2021	\$	PEN	595	2.251	0	0,00
GLM	08.2021	COP	\$	18.096.228	4.925	89	0,00
	08.2021	\$	PEN	566	2.251	23	0,00
	09.2021	ZAR	\$	233.877	17.006	781	0,03
HUS	10.2021	PEN		39.090	10.765	534	0,02
	11.2021	MXN		262.338	12.966	8	0,00
	11.2021	PEN		23.290	6.074	0	0,00
IND	12.2021	EGP		34.000	2.018	0	0,00
	02.2022	ZAR		5.322	348	0	0,00
	07.2021	DOP		115.495	1.952	0	0,00
JPM	07.2021	€		180	218	5	0,00
	07.2021	RUB		14.197	184	0	0,00
	08.2021	DOP		72.590	1.229	0	0,00
MYI	08.2021	\$	COP	4.804	18.137.406	44	0,00
	08.2021		RUB	3.515	256.667	0	0,00
	09.2021	DOP	\$	2.399	42	0	0,00
RBC	09.2021	\$	EGP	2.578	41.351	0	0,00
	09.2021		RUB	1.344	98.523	0	0,00
	09.2021	ZAR	\$	113.334	8.233	371	0,02
SCX	10.2021	\$	PEN	1.219	4.686	8	0,00
	02.2022	ZAR	\$	55.548	3.552	0	0,00
	07.2021	€		10.007	11.971	104	0,01
SSB	07.2021	£		3.821	5.421	142	0,01
	09.2021	\$	CNH	219	1.409	0	0,00
	09.2021		RUB	555	40.657	0	0,00
TOR	02.2022	ZAR	\$	85.941	5.565	0	0,00
	07.2021	\$	TRY	201	1.770	0	0,00
	09.2021		EGP	1.107	17.762	0	0,00
UAG	09.2021		ZAR	16.783	243.622	118	0,01
	02.2022			13.819	204.759	98	0,00
	02.2022	ZAR	\$	2.540	166	0	0,00
RYL	07.2021	€		5.997	7.154	43	0,00
	07.2021	£		116	161	1	0,00
	07.2021	\$	€	2.399	2.015	0	0,00
SCX	07.2021		£	425	307	0	0,00
	08.2021	EGP	\$	63.850	3.910	0	0,00
	08.2021	\$	EGP	4.376	70.175	33	0,00
RBC	09.2021			4.802	77.072	13	0,00
	07.2021	€	\$	921	1.099	7	0,00
	02.2022	ZAR		18.683	1.213	0	0,00
SSB	07.2021	€		108.231	132.394	4.043	0,16
	08.2021	EGP		19.000	1.172	0	0,00
	02.2022	ZAR		108.346	6.948	0	0,00
TOR	07.2021	\$	£	38	28	0	0,00
	02.2022	ZAR	\$	4.040	264	0	0,00
	07.2021	€		1.162	1.406	28	0,00
UAG	07.2021	\$	RUB	3.847	278.189	0	0,00
	09.2021			548	40.167	0	0,00
				\$ 7.275	\$ (1.490)	\$ 5.785	0,24

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 13.081	CHF 11.734	\$ 0	\$ (386)	\$ (386)	(0,02)
BRC	07.2021	12.535	11.306	0	(304)	(304)	(0,01)
CBK	07.2021	CHF 17.439	\$ 18.943	76	0	76	0,00
	08.2021	\$ 18.959	CHF 17.439	0	(76)	(76)	0,00
GLM	07.2021	9.679	8.703	0	(264)	(264)	(0,01)
MYI	07.2021	13.024	11.734	0	(329)	(329)	(0,02)
SCX	07.2021	8.919	7.987	0	(278)	(278)	(0,01)
SSB	07.2021	421	378	0	(12)	(12)	0,00
				\$ 76	\$ (1.649)	\$ (1.573)	(0,07)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 10.019	€ 8.281	\$ 0	\$ (199)	\$ (199)	(0,01)
BPS	07.2021	€ 29.301	\$ 35.542	794	0	794	0,03
	07.2021	\$ 407.835	€ 333.478	0	(12.364)	(12.364)	(0,52)
BRC	07.2021	201	165	0	(5)	(5)	0,00
GLM	07.2021	20.556	16.959	0	(444)	(444)	(0,02)
HUS	07.2021	€ 32.549	\$ 38.917	317	0	317	0,01
	07.2021	\$ 61.380	€ 50.617	0	(1.353)	(1.353)	(0,06)
MYI	07.2021	783	658	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2021	€ 264	\$ 321	8	0	8	0,00
	07.2021	\$ 471.286	€ 385.237	0	(14.434)	(14.434)	(0,60)
TOR	07.2021	471.286	385.237	0	(14.434)	(14.434)	(0,60)
UAG	07.2021	32.724	26.902	0	(821)	(821)	(0,03)
				\$ 1.119	\$ (44.057)	\$ (42.938)	(1,80)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	\$ 2.773	£ 1.969	\$ 0	\$ (53)	\$ (53)	0,00
BRC	07.2021	6.965	4.984	0	(80)	(80)	(0,01)
GLM	07.2021	8.671	6.133	0	(198)	(198)	(0,01)
HUS	07.2021	£ 11.371	\$ 15.738	30	0	30	0,00
	07.2021	\$ 919	£ 649	0	(22)	(22)	0,00
	08.2021	15.739	11.371	0	(30)	(30)	0,00
MYI	07.2021	£ 158	\$ 221	3	0	3	0,00
	07.2021	\$ 3.166	£ 2.276	0	(21)	(21)	0,00
RYL	07.2021	161	114	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2021	9.029	6.353	0	(253)	(253)	(0,01)
SSB	07.2021	£ 11.416	\$ 15.778	7	0	7	0,00
	07.2021	\$ 5.254	£ 3.776	0	(39)	(39)	0,00
	08.2021	15.715	11.371	0	(5)	(5)	0,00
UAG	07.2021	8.690	6.133	0	(217)	(217)	(0,01)
				\$ 40	\$ (921)	\$ (881)	(0,04)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Investor NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	NOK 2.388	\$ 279	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	08.2021	\$ 279	NOK 2.388	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2021	270	2.256	0	(8)	(8)	0,00
MYI	07.2021	275	2.292	0	(8)	(8)	0,00
SSB	07.2021	262	2.190	0	(8)	(8)	0,00
				\$ 1	\$ (25)	\$ (24)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Investor SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	\$	374 SEK	3.101	\$ 0	\$ (12)	0,00
BRC	07.2021		437	3.621	0	(13)	0,00
GLM	07.2021	SEK	8	\$ 1	0	0	0,00
RBC	07.2021	\$	437 SEK	3.621	0	(13)	0,00
SCX	07.2021		12	106	0	0	0,00
SSB	07.2021	SEK	13	\$ 2	0	0	0,00
	07.2021	\$	0 SEK	4	0	0	0,00
	08.2021	SEK	329	\$ 39	0	0	0,00
UAG	07.2021	\$	2 SEK	14	0	0	0,00
					\$ 0	\$ (38)	
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (38.394)	(1,62)
Summe Anlagen						\$ 2.606.568	109,51
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (226.402)	(9,51)
Nettovermögen						\$ 2.380.166	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
JPMorgan Structured Products BV	3,550 %	29.12.2021	04.02.2021	\$ 4.192	\$ 4.151	0,17
JPMorgan Structured Products BV	3,650	14.10.2024	18.10.2019	1.543	1.545	0,06
JPMorgan Structured Products BV	11,730	11.03.2022	30.03.2021	1.308	1.333	0,06
JPMorgan Structured Products BV	11,750	17.06.2022	12.03.2021	1.083	1.070	0,04
JPMorgan Structured Products BV	12,000	04.01.2027	15.06.2021	635	572	0,02
JPMorgan Structured Products BV	12,000	28.08.2026	15.06.2021	728	680	0,03
JPMorgan Structured Products BV	14,000	09.12.2031	24.05.2021 - 01.06.2021	661	588	0,02
JPMorgan Structured Products BV	14,000	28.05.2031	24.05.2021 - 01.06.2021	1.236	1.230	0,05
JPMorgan Structured Products BV	17,250	07.01.2022	15.01.2021	3.861	4.030	0,17
Sunac China Holdings Ltd.	5,950	30.12.2021	11.01.2021	3.000	3.002	0,12
				\$ 18.247	\$ 18.201	0,74

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 245.755 als Sicherheiten verpfändet.

(h) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 21.213 und Barmittel in Höhe von USD 23.366 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 4.114 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 6.571 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.531.620	\$ 486	\$ 2.532.106
Pensionsgeschäfte	0	113.008	0	113.008
Finanzderivate ⁽³⁾	(576)	(37.959)	(11)	(38.546)
Summen	\$ (576)	\$ 2.606.669	\$ 475	\$ 2.606.568

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.412.573	\$ 724	\$ 1.413.297
Pensionsgeschäfte	0	138.321	0	138.321
Finanzderivate ⁽³⁾	(207)	13.121	0	12.914
Summen	\$ (207)	\$ 1.564.015	\$ 724	\$ 1.564.532

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	0,350 %	10.05.2021	12.08.2021	\$ (17.623)	\$ (17.632)	(0,74)
	0,390	10.05.2021	12.08.2021	(9.515)	(9.520)	(0,40)
	5,850	23.06.2021	TBD ⁽¹⁾	ZAR (448.381)	(31.402)	(1,32)
	5,850	24.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(448.381)	(31.403)	(1,32)
BRC	(0,450)	25.06.2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (1.614)	(1.614)	(0,07)
	(0,150)	25.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(2.112)	(2.112)	(0,09)
JML	0,150	07.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(3.728)	(3.730)	(0,16)
	0,150	22.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(3.053)	(3.053)	(0,13)
	0,250	06.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.011)	(1.012)	(0,04)
NOM	(0,250)	03.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(789)	(789)	(0,03)
SCX	0,300	23.06.2021	24.08.2021	(9.148)	(9.148)	(0,38)
	0,350	21.05.2021	20.08.2021	(9.184)	(9.188)	(0,39)
	0,360	13.04.2021	12.07.2021	(16.346)	(16.359)	(0,69)
	0,360	21.05.2021	20.08.2021	(31.610)	(31.623)	(1,33)
	0,370	12.04.2021	12.07.2021	(9.350)	(9.358)	(0,39)
	0,370	13.04.2021	12.07.2021	(6.783)	(6.788)	(0,29)
	0,370	03.05.2021	02.08.2021	(12.144)	(12.151)	(0,51)
	0,380	15.04.2021	14.07.2021	(45.955)	(45.992)	(1,93)
TDM	0,250	16.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(14.554)	(14.561)	(0,61)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (257.435)	(10,82)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 597	\$ (648)	\$ (51)
BPS	(11.361)	9.910	(1.451)
BRC	(1.263)	1.290	27
CBK	1.624	(2.020)	(396)
DUB	646	(810)	(164)
FBF	(2)	0	(2)
GLM	(852)	622	(230)
GST	529	(550)	(21)
HUS	(817)	740	(77)
IND	(276)	275	(1)
JPM	250	(310)	(60)
MYC	(56)	0	(56)
MYI	(424)	322	(102)
RBC	(6)	0	(6)
RYL	(60)	262	202
SCX	(10.942)	17.179	6.237
SSB	(473)	588	115
TOR	(14.445)	12.710	(1.735)
UAG	(1.063)	681	(382)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	96,66	84,96
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	9,62	13,02
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,10	0,07
Pensionsgeschäfte	4,75	9,60
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,62)	0,91
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(10,82)	(8,52)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Argentinien	1,82	2,15
Armenien	0,26	0,06
Österreich	0,02	0,02
Aserbaidschan	0,03	0,04
Bahamas	0,15	0,22
Bahrain	1,31	0,46
Weissrussland	k. A.	0,30
Bermudas	0,18	k. A.
Brasilien	5,35	4,43
Cayman Inseln	3,21	3,03
Chile	1,75	2,48
China	0,44	0,97
Kolumbien	2,43	2,26
Costa Rica	0,91	0,72
Kroatien	k. A.	0,12
Dominikanische Republik	3,17	4,03
Ecuador	2,29	1,57
Ägypten	3,72	4,80
El Salvador	0,77	0,66
Georgia	0,47	k. A.
Deutschland	0,03	0,36
Ghana	2,81	1,82
Guatemala	0,84	1,34
Guernsey, Kanalinseln	0,19	0,31
Hongkong	1,21	1,59
Ungarn	0,21	1,67
Indien	2,29	1,35
Indonesien	3,04	2,47
Irland	0,33	0,17
Insel Man	0,16	0,27
Israel	0,10	0,65
Elfenbeinküste	1,87	1,63
Jamaika	0,21	0,36
Jordanien	1,02	0,73
Kasachstan	0,85	1,50
Kenia	0,97	0,92
Luxemburg	0,44	0,30
Malaysia	0,91	0,87
Mauritius	1,27	1,31
Mexiko	2,81	2,16
Mongolei	1,00	0,60
Marokko	1,65	1,08
Multinational	0,02	0,04
Namibia	0,25	0,21
Niederlande	1,88	1,81
Oman	4,02	2,62
Panama	3,45	2,65
Paraguay	0,89	0,94
Peru	1,07	2,53
Philippinen	1,41	1,87
Katar	1,16	2,23
Rumänien	2,46	2,20
Russland	0,49	2,02
Senegal	0,81	0,41
Serbien	0,63	0,75
Singapur	1,39	0,23
Südafrika	4,54	5,02
Südkorea	4,49	0,94
Sri Lanka	1,57	1,35
Supranational	1,74	0,08
Tansania	0,02	0,05
Tunesien	0,12	0,06
Türkei	4,10	3,27
Ukraine	5,17	3,28
Vereinigte Arabische Emirate	1,10	2,46
Großbritannien	0,28	0,56
USA	1,99	2,52

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Uruguay	2,84	4,02
Vietnam	0,05	0,08
Jungferinseln (Britisch)	0,34	0,57
Sambia	0,17	0,16
Kurzfristige Instrumente	5,44	1,34
Pensionsgeschäfte	4,75	9,60
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,00	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,00	(0,00)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,07	0,01
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	0,05
Devisenterminkontrakte	0,24	(0,27)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,91)	1,12
Sonstige Aktiva und Passiva	(9,51)	(8,54)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Corporate Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS		
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								INDUSTRIEWERTE					
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG													
Republic Elfenbeinküste				Interoceanea Finance Ltd.				AAC Technologies Holdings, Inc.	\$	600	614	0,25	
TBD % fällig am 19.03.2027	€	1.000	1,183	0,000 % fällig am 30.11.2025 (d)	\$	72	68	0,03	3,750 % fällig am 02.06.2031				
			0,49	Intesa Sanpaolo SpA				ABJA Investment Co. Pte. Ltd.		1.400	1.509	0,62	
				5,875 % fällig am 01.09.2031	€	500	675	0,28	5,450 % fällig am 24.01.2028				
				(e)(g)				Adani Electricity Mumbai Ltd.		400	400	0,16	
				Itau Unibanco Holding S.A.	\$	500	512	0,21	3,949 % fällig am 12.02.2030				
				2,900 % fällig am 24.01.2023				ADES International Holding PLC		600	617	0,25	
				Kaisa Group Holdings Ltd.		300	284	0,12	8,625 % fällig am 24.04.2024				
				9,375 % fällig am 30.06.2024	1.200	1.137	0,47	Aker BP ASA		500	540	0,22	
				11,250 % fällig am 16.04.2025	200	189	0,08	3,750 % fällig am 15.01.2030					
				11,700 % fällig am 11.11.2025	1.382	1.374	0,57	ALROSA Finance S.A.		200	206	0,08	
				Kuwait Projects Co. SPC Ltd.	1.020	1.131	0,47	3,100 % fällig am 25.06.2027		1.100	1.191	0,49	
				4,500 % fällig am 23.02.2027				4,650 % fällig am 09.04.2024	€	1.200	1.385	0,57	
				MAF Sukuk Ltd.				Altice Financing S.A.					
				4,400 % fällig am 03.11.2025	1.300	1.319	0,54	2,250 % fällig am 15.01.2025					
				Mizrahi Tefahot Bank Ltd.				Andrade Gutierrez International S.A. (11,000 % bar oder 12,000 %					
				3,077 % fällig am 07.04.2031 (g)				PIK)					
				Muthoot Finance Ltd.				11,000 % fällig am 20.08.2021	\$	0	0	0,00	
				4,400 % fällig am 02.09.2023	700	722	0,30	AngloGold Ashanti Holdings PLC		1.100	1.150	0,47	
				6,125 % fällig am 31.10.2022	500	520	0,21	5,125 % fällig am 01.08.2022		800	1.000	0,41	
				Natwest Group PLC				6,500 % fällig am 15.04.2040					
				5,125 % fällig am 12.05.2027	£	200	298	0,12	Antofagasta PLC		200	193	0,08
				(e)(g)				2,375 % fällig am 14.10.2030					
				NE Property BV	€	500	610	0,25	ATP Tower Holdings LLC		500	515	0,21
				1,875 % fällig am 09.10.2026				4,050 % fällig am 27.04.2026					
				New Metro Global Ltd.	\$	1.100	1.146	0,47	Axiata SPV2 Bhd.		300	296	0,12
				6,800 % fällig am 05.08.2023				2,163 % fällig am 19.08.2030					
				OEC Finance Ltd. (4,375 % bar oder 4,375 % PIK)		653	75	0,03	Baidu, Inc.		600	651	0,27
				4,375 % fällig am 25.10.2029 (b)				3,425 % fällig am 07.04.2030					
				OEC Finance Ltd. (5,250 % bar oder 5,250 % PIK)		379	44	0,02	BOC Aviation USA Corp.		1.100	1.109	0,46
				5,250 % fällig am 27.12.2033 (b)				1,625 % fällig am 29.04.2024					
				OEC Finance Ltd. (7,125 % bar oder 7,125 % PIK)		1.290	148	0,06	Braskem Netherlands Finance BV		1.100	1.160	0,48
				7,125 % fällig am 26.12.2046 (b)				4,500 % fällig am 10.01.2028					
				Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.		1.900	1.905	0,78	BRF S.A.		1.300	1.367	0,56
				1,832 % fällig am 10.09.2030 (g)				4,875 % fällig am 24.01.2030		300	309	0,13	
				Pakuwon Jati Tbk PT		900	942	0,39	5,750 % fällig am 21.09.2050				
				4,875 % fällig am 29.04.2028				Cable Onda S.A.		400	422	0,17	
				Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd.		700	724	0,30	4,500 % fällig am 30.01.2030				
				3,950 % fällig am 05.02.2023				Canacol Energy Ltd.		1.500	1.596	0,66	
				Powerlong Real Estate Holdings Ltd.		1.300	1.347	0,55	7,250 % fällig am 03.05.2025				
				5,950 % fällig am 30.04.2025				Celestial Dynasty Ltd.		500	521	0,21	
				QNB Finance Ltd.		900	943	0,39	4,250 % fällig am 27.06.2029				
				2,625 % fällig am 12.05.2025		1.548	1.653	0,68	Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK)				
				3,500 % fällig am 26.03.2024				10,000 % fällig am 09.11.2024		816	41	0,02	
				QNB Finansbank A/S		400	409	0,17	(b)				
				4,875 % fällig am 19.05.2022		500	543	0,22	Corp. GEO S.A.B. de C.V.		850	0	0,00
				6,875 % fällig am 07.09.2024		2.300	2.440	1,01	8,875 % fällig am 25.09.2014 ^				
				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				Coty, Inc.	€	500	597	0,25	
				5,250 % fällig am 23.05.2023 (g)				3,875 % fällig am 15.04.2026					
				Shinhan Bank Co. Ltd.		900	1.029	0,42	CSN Inova Ventures	\$	1.700	1.882	0,78
				4,500 % fällig am 26.03.2028		1.100	1.104	0,45	6,750 % fällig am 28.01.2028				
				Sovcombank Via SovCom Capital DAC		1.100	1.104	0,45	CSN Islands Corp.		100	101	0,04
				3,400 % fällig am 26.01.2025		739	724	0,30	7,000 % fällig am 23.09.2021 (e)				
				SPARC EM SPC Panama Metro Line SP				DAE Funding LLC		1.300	1.338	0,55	
				0,000 % fällig am 05.12.2022 (d)		500	509	0,21	5,000 % fällig am 01.08.2024				
				Sunac China Holdings Ltd.		600	590	0,24	Digicel International Finance Ltd.		145	152	0,06
				6,500 % fällig am 09.07.2023				8,750 % fällig am 25.05.2024					
				7,000 % fällig am 09.07.2025		300	325	0,13	Ecopetrol S.A.		2.100	2.537	1,05
				SURA Asset Management S.A.				6,875 % fällig am 29.04.2030		1.000	1.236	0,51	
				4,875 % fällig am 17.04.2024		400	470	0,19	7,375 % fällig am 18.09.2043				
				Trust Fibrá Uno		200	209	0,09	Embotelladora Andina S.A.		200	213	0,09
				6,390 % fällig am 15.01.2050				3,950 % fällig am 21.01.2050					
				Türkiye Is Bankasi A/S				Empresa Electrica Cochran SpA		256	265	0,11	
				6,125 % fällig am 25.04.2024		1.000	1.100	0,45	5,500 % fällig am 14.05.2027				
				Woori Bank				Energean Israel Finance Ltd.		400	410	0,17	
				4,750 % fällig am 30.04.2024 (g)		600	594	0,24	4,500 % fällig am 30.03.2024		500	513	0,21
				XP, Inc.				4,875 % fällig am 30.03.2026					
				3,250 % fällig am 01.07.2026 (a)		400	361	0,15	First Quantum Minerals Ltd.		900	982	0,40
				Yango Justice International Ltd.		200	185	0,08	6,875 % fällig am 15.10.2027				
				7,500 % fällig am 17.02.2025				Fomento Economico Mexicano S.A.B. de C.V.		€	500	580	0,24
				7,875 % fällig am 04.09.2024		600	613	0,25	4,375 % fällig am 10.05.2043	\$	900	1.073	0,44
				Yanlord Land HK Co. Ltd.				1,000 % fällig am 28.05.2033					
				5,125 % fällig am 20.05.2026		61.708	25,42		3,950 % fällig am 02.10.2026 (a)	€	500	592	0,24
								Fortune Star BVI Ltd.					
								3,950 % fällig am 02.10.2026 (a)	€	500	592	0,24	
								5,950 % fällig am 19.10.2025	\$	800	841	0,35	

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
Peru LNG SRL	\$ 700	\$ 606	0,25	FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				STAMMAKTIE				
5,375 % fällig am 22.03.2030				Citigroup Mortgage Loan Trust	\$ 444	\$ 315	0,13	ENERGIE				
Petrobras Global Finance BV	1.400	1.570	0,65	7,250 % fällig am 25.05.2036				Frontera Energy Corp. (c)	50.258	\$ 312	0,13	
5,600 % fällig am 03.01.2031	500	613	0,25	Countrywide Asset-Backed Certificates	59	59	0,02	FINANZWERTE				
7,250 % fällig am 17.03.2044				0,312 % fällig am 25.09.2037 ^				Hipotecaria Su Casita S.A. (c)	332.624	0	0,00	
Rio Oil Finance Trust	3.264	3.780	1,56	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust	162	124	0,05	BAUSTOFFE				
8,200 % fällig am 06.04.2028	131	146	0,06	0,282 % fällig am 25.04.2037				Petra Diamonds Ltd. (c)	16.570.078	336	0,14	
9,250 % fällig am 06.07.2024	439	520	0,21	JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.	1.100	1.077	0,44			648	0,27	
9,750 % fällig am 06.01.2027				1,067 % fällig am 25.12.2035				OPTIONSSCHEINE				
S.A. Global Sukuk Ltd.	1.000	1.014	0,42	NovaStar Mortgage Funding Trust	184	181	0,08	OAS S.A. - Exp. 21.01.2039 (h)	175.616	2	0,00	
2,694 % fällig am 17.06.2031				0,292 % fällig am 25.09.2037				Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 243.140	100,15	
Southern Gas Corridor CJSC	900	1.078	0,44	STAATSEMISSIONEN				INVESTMENTFONDS				
6,875 % fällig am 24.03.2026				Argentina Government International Bond				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	1.064	1.212	0,50	0,125 % fällig am 09.07.2030	18	6	0,00	PIMCO Select Funds plc -				
6,750 % fällig am 24.04.2033				0,125 % fällig am 09.07.2035	11	3	0,00	PIMCO US Dollar				
Turk Telekomunikasyon A/S	500	553	0,23	Colombia Government International Bond	1.000	1.094	0,45	Short-Term Floating				
6,875 % fällig am 28.02.2025				4,500 % fällig am 28.01.2026				NAV Fund (f)	300.535	2.994	1,23	
		25.969	10,69	Dominican Republic Government International Bond	1.300	1.300	0,54	PIMCO Specialty Funds				
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		203.851	83,96	5,300 % fällig am 21.01.2041				Ireland p.l.c. - PIMCO	25.272	339	0,14	
US-SCHATZOBIGATIONEN				Export-Credit Bank of Turkey	1.200	1.307	0,54	China Bond Fund (f)			3.333	1,37
U.S. Treasury Bonds				8,250 % fällig am 24.01.2024				BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
3,000 % fällig am 15.05.2045 (i)	8.600	10.145	4,18	Nigeria Government International Bond	200	207	0,09	PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar	1.000	102	0,04	
U.S. Treasury Notes				5,625 % fällig am 27.06.2022				Short Maturity UCITS ETF (f)				
1,875 % fällig am 31.01.2022 (i)	10.500	10.611	4,37	Oman Government International Bond	1.300	1.400	0,58	Summe Investmentfonds		\$ 3.435	1,41	
2,000 % fällig am 31.12.2021	1.000	1.010	0,42	6,250 % fällig am 25.01.2031								
		21.766	8,97	Provincia de Cordoba	1.518	1.040	0,43					
NON-AGENCY-MBS				5,000 % fällig am 01.06.2027 ^								
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates	711	710	0,29	Provincia de Entre Rios Argentina	155	108	0,04					
0,322 % fällig am 25.10.2035				5,000 % fällig am 08.08.2028 ^								
Citigroup Mortgage Loan Trust	424	406	0,17	Provincia de Neuquen	1.033	671	0,28					
3,206 % fällig am 25.08.2036				2,500 % fällig am 27.04.2030 ^								
Countrywide Alternative Loan Trust	65	63	0,02	Serbia Government International Bond	300	349	0,14					
0,733 % fällig am 20.12.2035				1,650 % fällig am 03.03.2033	€	300	0,14					
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust	44	43	0,02	South Africa Government International Bond	52.900	4.211	1,73					
3,093 % fällig am 25.11.2037				10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	52.900	4,211					
		1.222	0,50	Ukraine Government International Bond	\$	600	0,29					
				1,258 % fällig am 31.05.2040		300	0,13					
				7,750 % fällig am 01.09.2021		300	0,13					
						12.712	5,24					

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	25	\$ 21	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	16	(147)	(0,06)
				\$ (126)	(0,05)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (126)	(0,05)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	\$ 6.935	\$ (245)	(0,10)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 2.200	\$ (17)	(0,01)
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	5.300	62	0,03
				\$ 45	0,02

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,928 %	17.03.2026	CNY 32.300	\$ 36	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,750	21.06.2047	\$ 2.700	(475)	(0,20)
						\$ (439)	(0,18)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (639)	(0,26)

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIONEN**CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES**

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825 %	18.08.2021	2.300	\$ (3)	\$ 0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	200	0	0	0,00
BRC	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	1.200	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	300	0	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	800	(1)	(1)	0,00
DUB	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	2.200	(3)	0	0,00
GST	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.100	(1)	0	0,00
						\$ (12)	\$ (2)	0,00

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.12.2024	\$ 2.700	\$ 10	\$ 9	\$ 19	0,01	
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2023	2.000	31	(60)	(29)	(0,01)	
BPS	Colombia Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.700	(5)	5	0	0,00	
GST	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	2.400	34	(34)	0	0,00	
JPM	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.700	(45)	(13)	(58)	(0,03)	
MYC	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.700	(3)	(35)	(38)	(0,02)	
						\$ 22	\$ (128)	\$ (106)	(0,05)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BRC	America Movil S.A.B. de C.V.	1,000 %	20.12.2025	\$ 1.200	\$ (30)	\$ 38	\$ 8	0,00	
	QNB Finance Ltd.	1,000	20.06.2023	400	3	0	3	0,00	
CBK	Trust Fibra Uno	1,000	20.06.2022	100	(1)	0	(1)	0,00	
DUB	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.700	(31)	29	(2)	0,00	
						\$ (59)	\$ 67	\$ 8	0,00

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
GLM	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,493 %	17.06.2025	CNY 1.700	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
						\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	09.2021	\$ 1.414	CNY 9.092	\$ 0	\$ (14)	\$ (14)	(0,01)
BPS	07.2021	€ 501	\$ 608	13	0	13	0,01
	07.2021	£ 109	151	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 2.569	¥ 280.949	0	(38)	(38)	(0,02)
CBK	09.2021	ZAR 28.551	\$ 2.076	95	0	95	0,04
GLM	07.2021	\$ 291	BRL 1.464	1	0	1	0,00
	08.2021	BRL 1.464	\$ 290	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	\$ 120	HKD 933	0	0	0	0,00
	09.2021	ZAR 13.836	\$ 1.005	45	0	45	0,02
HUS	07.2021	€ 615	752	23	0	23	0,01
	07.2021	£ 415	589	15	0	15	0,01
	09.2021	CNH 10.469	1.629	17	0	17	0,01
MYI	07.2021	BRL 1.464	273	0	(18)	(18)	(0,01)
	07.2021	€ 260	311	3	0	3	0,00
	07.2021	\$ 59	€ 49	0	0	0	0,00
	09.2021	130	ZAR 1.864	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2021	€ 6.570	\$ 8.038	247	0	247	0,10
SSB	09.2021	ZAR 20.011	\$ 1.458	70	0	70	0,03
				\$ 529	\$ (72)	\$ 457	0,19

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2021	CHF 139	\$ 155	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	07.2021	\$ 5.930	CHF 5.320	0	(175)	(175)	(0,07)
BRC	07.2021	CHF 36	\$ 40	1	0	1	0,00
CBK	07.2021	5.222	5.672	24	0	24	0,01
	07.2021	\$ 5.943	CHF 5.329	0	(179)	(179)	(0,07)
	08.2021	5.677	5.222	0	(23)	(23)	(0,01)
GLM	07.2021	CHF 110	\$ 121	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 10	CHF 9	0	0	0	0,00
MYI	07.2021	5.775	5.203	0	(146)	(146)	(0,06)
SCX	07.2021	CHF 14	\$ 16	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	7	8	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 58	CHF 53	0	0	0	0,00
UAG	07.2021	CHF 106	\$ 118	2	0	2	0,00
				\$ 32	\$ (523)	\$ (491)	(0,20)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2021	\$ 22	€ 18	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2021	€ 35	\$ 42	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 56.563	€ 46.240	0	(1.726)	(1.726)	(0,71)
BRC	07.2021	€ 11	\$ 13	1	0	1	0,00
HUS	07.2021	75	90	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 86	€ 71	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07.2021	215	181	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2021	65.730	53.729	0	(2.013)	(2.013)	(0,83)
TOR	07.2021	65.730	53.729	0	(2.013)	(2.013)	(0,83)
				\$ 2	\$ (5.755)	\$ (5.753)	(2,37)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (5.889) (2,43)

Summe Anlagen

\$ 239.921 98,82

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 2.861 1,18

Nettvermögen

\$ 242.782 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
Invepar Holdings LLC 0,000 % fällig am 31.12.2049	16.11.2018	\$ 0	\$ 0	0,00
OAS Restructuring BVI Ltd. (0,250 % bar und 4,750 % PIK) 5,000 % fällig am 31.03.2035	16.11.2018	13	5	0,00
OAS S.A. - Exp. 21.01.2039	16.11.2018	5	2	0,00
		\$ 18	\$ 7	0,00

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 4.263 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 679 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 4.470 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 648	\$ 242.430	\$ 62	\$ 243.140
Investmentfonds	3.333	102	0	3.435
Finanzderivate ⁽³⁾	0	(6.653)	(1)	(6.654)
Summen	\$ 3.981	\$ 235.879	\$ 61	\$ 239.921

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 130	\$ 261.970	\$ 861	\$ 262.961
Investmentfonds	719	102	0	821
Pensionsgeschäfte	0	921	0	921
Finanzderivate ⁽³⁾	4	3.644	0	3.648
Summen	\$ 853	\$ 266.637	\$ 861	\$ 268.351

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettvermögens
BOS	0,050 %	17.06.2021	19.07.2021	\$ (1.324)	\$ (1.324)	(0,55)
GRE	0,070	18.06.2021	02.07.2021	(2.938)	(2.938)	(1,21)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (4.262)	(1,76)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (195)	\$ 0	\$ (195)
BPS	(1.751)	1.420	(331)
BRC	11	0	11
CBK	(84)	0	(84)
DUB	(2)	0	(2)
GLM	44	0	44
HUS	54	0	54
JPM	(58)	0	(58)
MYC	(38)	0	(38)
MYI	(163)	(60)	(223)
SCX	(1.766)	1.520	(246)
SSB	70	0	70
TOR	(2.013)	1.530	(483)
UAG	2	0	2

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	89,72	81,15
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	9,50	19,12
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,93	0,40
Investmentfonds	1,41	0,31
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,35
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,05)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,26)	(0,24)
Freiverkehrsfinanzderivate	(2,43)	1,63
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,76)	(1,73)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,89)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,49	0,31
Unternehmensanleihen und Wechsel	83,96	88,93
US-Schatzobligationen	8,97	8,76
Non-Agency-MBS	0,50	0,53
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,72	0,68
Staatsemissionen	5,24	1,39
Stammaktien	0,27	0,05
Optionsscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,02
Investmentfonds	1,41	0,31
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,35
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,05)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,10)	(0,15)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,02	k. A.
Zinsswaps	(0,18)	(0,09)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,05)	(0,08)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,00	(0,02)
Devisenterminkontrakte	0,19	(0,11)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,57)	1,85
Sonstige Aktiva und Passiva	1,18	(2,72)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERM- ÖGENS
ARGENTINIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
YPF S.A. 40,115 % fällig am 24.07.2021 ARS 1.071 \$ 6 0,00			
STAATSEMISSIONEN			
Argentina Government International Bond 0,125 % fällig am 09.07.2030 \$ 3.296 1.168 0,35 0,125 % fällig am 09.07.2035 673 203 0,06 0,125 % fällig am 09.07.2041 330 118 0,04 36,104 % fällig am 03.04.2022 ARS 2.480 14 0,00			
			1.503 0,45
Summe Argentinien			1.509 0,45
AUSTRALIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Santos Finance Ltd. 3,649 % fällig am 29.04.2031 \$ 1.700 1.742 0,52			
ÖSTERREICH UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Erste Group Bank AG 4,250 % fällig am 15.10.2027 (d)(f) € 800 1.018 0,31			
ASERBAIDSCHAN STAATSEMISSIONEN			
Azerbaijan Government International Bond 3,500 % fällig am 01.09.2032 \$ 300 312 0,09			
BAHAMAS STAATSEMISSIONEN			
Bahamas Government International Bond 6,000 % fällig am 21.11.2028 800 814 0,24			
WEISSRUSSLAND STAATSEMISSIONEN			
Belarus Government International Bond 6,200 % fällig am 28.02.2030 200 175 0,05 6,378 % fällig am 24.02.2031 300 261 0,08			
Summe Belarus			436 0,13
BERMUDAS UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aircastle Ltd. 2,850 % fällig am 26.01.2028 1.200 1.207 0,36			
BRASILIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco BTG Pactual S.A. 8,300 % fällig am 15.08.2024 BRL 10.000 2.017 0,61			
Banco Daycoval S.A. 4,250 % fällig am 13.12.2024 \$ 200 208 0,06			
Banco Votorantim S.A. 4,000 % fällig am 24.09.2022 300 310 0,09 4,500 % fällig am 24.09.2024 200 211 0,06			
Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais 5,333 % fällig am 15.02.2028 770 836 0,25			
BRF S.A. 4,875 % fällig am 24.01.2030 800 841 0,25			
Centrais Elétricas Brasileiras S.A. 3,625 % fällig am 04.02.2025 200 206 0,06			
CSN Inova Ventures 6,750 % fällig am 28.01.2028 800 886 0,27			
CSN Resources S.A. 4,625 % fällig am 10.06.2031 1.700 1.734 0,52			
Oi S.A. 0,000 % fällig am 25.02.2035 BRL 350 262 0,08			
Oi S.A. (10,000 % bar oder 12,000 % PIK) 10,000 % fällig am 27.07.2025 \$ 300 309 0,09			
Petrobras Global Finance BV 6,750 % fällig am 03.06.2050 900 1.054 0,32			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERM- ÖGENS
VALE OVERSEAS LTD.			
Vale Overseas Ltd. 6,250 % fällig am 10.08.2026 \$ 600 \$723 0,22 6,875 % fällig am 10.11.2039 600 840 0,25			
VALE S.A.			
29.12.2049 (d) BRL 17.000 2.012 0,60			
XP, Inc. 3,250 % fällig am 01.07.2026 (a) \$ 900 891 0,27			
			13.340 4,00
STAATSEMISSIONEN			
Brazil Government International Bond 12,500 % fällig am 05.01.2022 BRL 4.300 888 0,27			
Summe Brasilien			14.228 4,27
CAYMAN INSELN WANDELANLEIHEN & WECHSEL			
21Vianet Group, Inc. 0,000 % fällig am 01.02.2026 (b) \$ 1.000 865 0,26			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
China Mengniu Dairy Co. Ltd. 2,500 % fällig am 17.06.2030 600 600 0,18			
CIFI Holdings Group Co. Ltd. 4,375 % fällig am 12.04.2027 600 590 0,18			
Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,125 % fällig am 22.10.2025 800 805 0,24 3,875 % fällig am 22.10.2030 500 494 0,15 4,200 % fällig am 06.02.2026 500 521 0,16			
Fantasia Holdings Group Co. Ltd. 9,250 % fällig am 28.07.2023 400 325 0,10			
Greentown China Holdings Ltd. 5,650 % fällig am 13.07.2025 400 416 0,12			
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % fällig am 30.06.2024 300 284 0,08 9,750 % fällig am 28.09.2023 700 692 0,21 11,700 % fällig am 11.11.2025 200 189 0,06			
KWG Group Holdings Ltd. 6,300 % fällig am 13.02.2026 600 590 0,18			
Melco Resorts Finance Ltd. 5,375 % fällig am 04.12.2029 500 529 0,16			
MGM China Holdings Ltd. 4,750 % fällig am 01.02.2027 900 919 0,27			
Poinsettia Finance Ltd. 6,625 % fällig am 17.06.2031 900 872 0,26			
Powerlong Real Estate Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 30.04.2025 1.000 1.036 0,31			
S.A. Global Sukuk Ltd. 0,946 % fällig am 17.06.2024 700 700 0,21 1,602 % fällig am 17.06.2026 800 800 0,24 2,694 % fällig am 17.06.2031 800 811 0,24			
Seazen Group Ltd. 6,000 % fällig am 12.08.2024 500 521 0,16			
Sunac China Holdings Ltd. 6,500 % fällig am 09.07.2023 400 408 0,12 7,250 % fällig am 14.06.2022 200 205 0,06			
Tencent Holdings Ltd. 2,390 % fällig am 03.06.2030 400 399 0,12			
Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 15.01.2026 500 525 0,16 5,625 % fällig am 26.08.2028 500 523 0,16			
Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % fällig am 13.01.2026 1.100 1.119 0,33			
			14.873 4,46
Summe Cayman Inseln			15.738 4,72
CHILE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A. 4,700 % fällig am 07.05.2050 200 226 0,07			
VTR Comunicaciones SpA 5,125 % fällig am 15.01.2028 360 377 0,11			
Summe Chile			603 0,18

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERM- ÖGENS
CHINA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
New Metro Global Ltd. 7,500 % fällig am 16.12.2021 \$ 200 \$ 204 0,06			
Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 17.02.2025 1.100 993 0,30			
			1.197 0,36
STAATSEMISSIONEN			
China Government Bond 3,270 % fällig am 19.11.2030 CNY 21.600 3.389 1,02			
Summe China			4.586 1,38
KOLUMBIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Ecopetrol S.A. 6,875 % fällig am 29.04.2030 \$ 1.600 1.933 0,58			
Empresas Publicas de Medellin ESP 8,375 % fällig am 08.11.2027 COP 3.044.000 778 0,23			
			2.711 0,81
STAATSEMISSIONEN			
Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025 14.071.000 3.839 1,15			
Summe Kolumbien			6.550 1,96
COSTA RICA STAATSEMISSIONEN			
Costa Rica Government International Bond 5,625 % fällig am 30.04.2043 \$ 300 279 0,08			
DOMINIKANISCHE REPUBLIK STAATSEMISSIONEN			
Dominican Republic Government International Bond 4,875 % fällig am 23.09.2032 500 516 0,15 8,900 % fällig am 15.02.2033 DOP 87.100 1.606 0,48 9,750 % fällig am 05.06.2026 154.500 3.075 0,92 10,750 % fällig am 11.08.2028 1.400 29 0,01 10,750 % fällig am 08.11.2029 23.600 485 0,15			
Summe Dominikanische Republik			5.711 1,71
ECUADOR STAATSEMISSIONEN			
Ecuador Government International Bond 0,500 % fällig am 31.07.2030 \$ 4.000 3.450 1,04			
ÄGYPTEN STAATSEMISSIONEN			
Egypt Government International Bond 6,125 % fällig am 31.01.2022 200 205 0,06 6,375 % fällig am 11.04.2031 € 800 991 0,30 8,500 % fällig am 31.01.2047 \$ 1.600 1.673 0,50 14,605 % fällig am 08.09.2025 EGP 9.300 598 0,18			
Summe Ägypten			3.467 1,04
EL SALVADOR STAATSEMISSIONEN			
El Salvador Government International Bond 5,875 % fällig am 30.01.2025 \$ 1.200 1.113 0,33			
FRANKREICH UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BNP Paribas S.A. 4,625 % fällig am 25.02.2031 (d)(f) 800 835 0,25 6,750 % fällig am 14.03.2022 (d)(f) 200 207 0,06			
Societe Generale S.A. 7,375 % fällig am 13.09.2021 (d)(f) 400 404 0,12			
Summe Frankreich			1.446 0,43

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
DEUTSCHLAND				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				JAPAN			
Deutsche Bank AG				Toro European CLO DAC				Nissan Motor Co. Ltd.			
3,035 % fällig am 28.05.2032 (g)	\$ 700	\$ 713	0,22	0,650 % fällig am 15.04.2030	€ 600	\$ 712	0,21	4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 500	\$ 550	0,16
3,547 % fällig am 18.09.2031 (h)	1.100	1.172	0,35			7.343	2,20	4,810 % fällig am 17.09.2030	500	565	0,17
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				JORDANIEN			
2,125 % fällig am 09.07.2027	€ 900	1.142	0,34	Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				STAATSEMISSIONEN			
Summe Deutschland		3.027	0,91	5,950 % fällig am 15.04.2030 (f)	\$ 1.100	1.158	0,35	Jordan Government International Bond			
				6,625 % fällig am 14.10.2022	200	214	0,07	5,850 % fällig am 07.07.2030	900	940	0,28
GHANA				NON-AGENCY-MBS				KASACHSTAN			
STAATSEMISSIONEN				European Loan Conduit				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Ghana Government International Bond				1,000 % fällig am 17.02.2030	€ 300	357	0,11	Development Bank of Kazakhstan JSC			
8,875 % fällig am 07.05.2042	\$ 1.500	1.518	0,45	Summe Irland		11.884	3,57	4,125 % fällig am 10.12.2022	200	209	0,06
18,850 % fällig am 28.09.2023	GHS 6.200	1.091	0,33	INSEL MAN				Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.			
20,750 % fällig am 16.01.2023	6.100	1.094	0,33	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,250 % fällig am 15.08.2030	900	919	0,28
Summe Ghana		3.703	1,11	NE Property BV				Summe Kasachstan		1.128	0,34
				3,375 % fällig am 14.07.2027	1.200	1.584	0,48	KENIA			
GUATEMALA				ISRAEL				STAATSEMISSIONEN			
STAATSEMISSIONEN				Bank Leumi Le-Israel BM				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Guatemala Government International Bond				3,275 % fällig am 29.01.2031 (f)	\$ 900	923	0,28	FEL Energy SARL			
4,500 % fällig am 03.05.2026	\$ 400	440	0,13	Delek & Avner Tamar Bond Ltd.				5,750 % fällig am 01.12.2040	2.785	2.962	0,89
				5,412 % fällig am 30.12.2025	1.033	1.041	0,31	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.			
GUERNSEY, KANALINSELN				ITALIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Aerporti di Roma SpA				4,375 % fällig am 19.09.2022	200	208	0,06
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				1,750 % fällig am 30.07.2031	€ 700	866	0,26	Guara Norte SARL			
3,000 % fällig am 29.03.2025	€ 1.000	1.276	0,38	Atlantia SpA				5,198 % fällig am 15.06.2034	2.947	3.076	0,92
				1,875 % fällig am 13.07.2027	900	1.108	0,33	Lincoln Financing SARL			
HONGKONG				ELFENBEINKÜSTE				LUXEMBURG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Fortune Star BVI Ltd.				Republic Elfenbeinküste				FEL Energy SARL			
3,950 % fällig am 02.10.2026 (a)	700	829	0,25	TBD % fällig am 19.03.2027	1.000	1.183	0,35	5,750 % fällig am 01.12.2040	2.785	2.962	0,89
5,000 % fällig am 18.05.2026	\$ 800	813	0,24	STAATSEMISSIONEN				Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.			
GLP China Holdings Ltd.				Ivory Coast Government International Bond				4,375 % fällig am 19.09.2022	200	208	0,06
2,950 % fällig am 29.03.2026	1.100	1.116	0,34	5,750 % fällig am 31.12.2032	\$ 566	568	0,17	Guara Norte SARL			
ICBCIL Finance Co. Ltd.				6,375 % fällig am 03.03.2028	800	884	0,27	5,198 % fällig am 15.06.2034	2.947	3.076	0,92
3,650 % fällig am 05.03.2022	600	610	0,18	Summe Italien		3.860	1,16	Lincoln Financing SARL			
Summe Hongkong		3.368	1,01					3,625 % fällig am 01.04.2024	€ 400	481	0,15
				INDIEN				Petrorio Luxembourg SARL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				6,125 % fällig am 09.06.2026	\$ 1.000	1.024	0,31
Adani Transmission Ltd.				Israel Government International Bond				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
4,250 % fällig am 21.05.2036	1.683	1.719	0,52	3,800 % fällig am 13.05.2060	1.200	1.369	0,41	5,250 % fällig am 23.05.2023 (f)	1.600	1.697	0,51
Periama Holdings LLC				Summe Israel		5.751	1,73	Severstal OAO Via Steel Capital S.A.			
5,950 % fällig am 19.04.2026	200	217	0,07	IRLAND				5,900 % fällig am 17.10.2022	200	213	0,06
ReNew Power Pvt Ltd.				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Summe Luxemburg		9.661	2,90
5,875 % fällig am 05.03.2027	500	535	0,16	Black Diamond CLO DAC				MALAYSIA			
Shriram Transport Finance Co. Ltd.				0,860 % fällig am 20.01.2032	€ 500	593	0,18	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,400 % fällig am 13.03.2024	500	502	0,15	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				MAURITIUS			
5,700 % fällig am 27.02.2022	600	608	0,18	1,050 % fällig am 15.01.2031	500	592	0,17	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
TML Holdings Pte. Ltd.				Carlyle Euro CLO DAC				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,500 % fällig am 03.06.2024	200	208	0,06	0,700 % fällig am 15.01.2031	1.400	1.660	0,50	India Green Energy Holdings			
Summe Indien		3.789	1,14	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				5,375 % fällig am 29.04.2024	500	524	0,16
				0,750 % fällig am 15.11.2031	1.300	1.535	0,46	MTN Mauritius Investments Ltd.			
IRAK				IRLAND				MEXIKO			
STAATSEMISSIONEN				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Iraq Government International Bond				Black Diamond CLO DAC				Banco Santander Mexico S.A.			
5,800 % fällig am 15.01.2028	2.188	2.123	0,64	0,860 % fällig am 20.01.2032	€ 500	593	0,18	5,375 % fällig am 17.04.2025	600	682	0,20
				BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				Cibanco S.A. Ibm			
IRLAND				ISRAEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Black Diamond CLO DAC				Ivory Coast Government International Bond				4,962 % fällig am 18.07.2029	700	775	0,23
0,860 % fällig am 20.01.2032	€ 500	593	0,18	5,750 % fällig am 31.12.2032	\$ 566	568	0,17	Petroleos Mexicanos			
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				6,375 % fällig am 03.03.2028	800	884	0,27	1,875 % fällig am 21.04.2022 (h)	€ 2.400	2.859	0,86
1,050 % fällig am 15.01.2031	500	592	0,17	Summe Elfenbeinküste		2.635	0,79	6,375 % fällig am 23.01.2045	\$ 1.800	1.550	0,47
Carlyle Euro CLO DAC								6,840 % fällig am 23.01.2030	600	619	0,19
0,700 % fällig am 15.01.2031	1.400	1.660	0,50					7,650 % fällig am 24.11.2021	MXN 48.650	2.443	0,73
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC								7,690 % fällig am 23.01.2050	\$ 1.100	1.060	0,32
0,750 % fällig am 15.11.2031	1.300	1.535	0,46					Trust Fibra Uno			
Harvest CLO DAC								4,869 % fällig am 15.01.2030	400	441	0,13
0,650 % fällig am 26.06.2030	1.400	1.659	0,50					Summe Mexiko		10.429	3,13
OAK Hill European Credit Partners DAC											
0,740 % fällig am 20.10.2031	500	592	0,18								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
STAATSEMISSIONEN			
Mexico Government International Bond			
5,000 % fällig am 27.04.2051	\$ 800	\$ 91	0,27
7,750 % fällig am 13.11.2042	MXN 72.200	3.719	1,12
		4.630	1,39
Summe Mexiko		15.059	4,52

MONGOLEI			
STAATSEMISSIONEN			
Mongolia Government International Bond			
5,125 % fällig am 05.12.2022	\$ 2.200	2.299	0,69

NAMIBIA			
STAATSEMISSIONEN			
Namibia Government International Bond			
5,250 % fällig am 29.10.2025	800	863	0,26
5,500 % fällig am 03.11.2021	2.200	2.230	0,67
Summe Namibia		3.093	0,93

NIEDERLANDE			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Cairn CLO BV			
0,700 % fällig am 15.10.2031	€ 800	949	0,28

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ING Groep NV			
4,875 % fällig am 16.05.2029 (d)(f)	\$ 500	523	0,16
Kazakhstan Temir Zholy Finance BV			
6,950 % fällig am 10.07.2042	200	275	0,08
Prosus NV			
3,832 % fällig am 08.02.2051	1.300	1.215	0,36
Republic of Angola Via Avenir BV			
4,665 % fällig am 07.12.2023	2.600	2.564	0,77
7,660 % fällig am 01.07.2023	315	316	0,10
		4.893	1,47
Summe Niederlande		5.842	1,75

NIGERIA			
STAATSEMISSIONEN			
Nigeria Government International Bond			
5,625 % fällig am 27.06.2022	1.600	1.657	0,50
7,625 % fällig am 28.11.2047	500	501	0,15
Summe Nigeria		2.158	0,65

NORWEGEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aker BP ASA			
4,000 % fällig am 15.01.2031	500	550	0,17

OMAN			
STAATSEMISSIONEN			
Oman Government International Bond			
4,125 % fällig am 17.01.2023	500	515	0,15
6,500 % fällig am 08.03.2047	300	294	0,09
6,750 % fällig am 17.01.2048	1.600	1.597	0,48
Summe Oman		2.406	0,72

PAKISTAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd.			
5,625 % fällig am 05.12.2022	800	824	0,25

STAATSEMISSIONEN			
Pakistan Government International Bond			
8,875 % fällig am 08.04.2051	600	638	0,19
Summe Pakistan		1.462	0,44

PARAGUAY			
STAATSEMISSIONEN			
Paraguay Government International Bond			
5,400 % fällig am 30.03.2050	400	468	0,14

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
PERU			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco de Credito del Peru			
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 2.600	\$702	0,21
Peru LNG SRL			
5,375 % fällig am 22.03.2030	\$ 600	520	0,16
		1.222	0,37
Summe Peru		8.786	2,64

STAATSEMISSIONEN			
Peru Government International Bond			
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 700	200	0,06
6,350 % fällig am 12.08.2028	3.000	877	0,26
6,950 % fällig am 12.08.2031	5.300	1.554	0,47
8,200 % fällig am 12.08.2026	15.200	4.933	1,48
		7.564	2,27
Summe Peru		8.786	2,64

PHILIPPINEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Jollibee Worldwide Pte. Ltd.			
4,750 % fällig am 24.06.2030	\$ 200	213	0,07
Megaworld Corp.			
4,125 % fällig am 30.07.2027	1.000	1.073	0,32
Summe Philippinen		1.286	0,39

KATAR			
STAATSEMISSIONEN			
Qatar Government International Bond			
4,400 % fällig am 16.04.2050	500	610	0,18

RUMÄNIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
RCS & RDS S.A.			
3,250 % fällig am 05.02.2028	€ 300	358	0,11

STAATSEMISSIONEN			
Romania Government International Bond			
2,625 % fällig am 02.12.2040	400	471	0,14
4,625 % fällig am 03.04.2049	400	603	0,18
		1.074	0,32
Summe Rumänien		1.432	0,43

SAUDI-ARABIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Saudi Arabian Oil Co.			
3,250 % fällig am 24.11.2050	\$ 2.000	1.949	0,58

SERBIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Serbia Government International Bond			
1,500 % fällig am 26.06.2029	€ 800	957	0,29
3,125 % fällig am 15.05.2027	800	1.057	0,32
4,500 % fällig am 20.08.2032	RSD 39.300	440	0,13
Summe Serbien		2.454	0,74

SINGAPUR			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ABJA Investment Co. Pte. Ltd.			
5,450 % fällig am 24.01.2028	\$ 500	539	0,16
BOC Aviation Ltd.			
3,000 % fällig am 23.05.2022	1.100	1.116	0,34
LMIRT Capital Pte. Ltd.			
7,250 % fällig am 19.06.2024	700	730	0,22
		2.385	0,72

STAATSEMISSIONEN			
Singapore Government International Bond			
1,625 % fällig am 01.07.2031 (a)(h) SGD	800	598	0,18

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
3,375 % fällig am 01.09.2033 (h)	5.300	4.639	1,39
		5.237	1,57
Summe Singapur		7.622	2,29

SÜDAFRIKA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Eskom Holdings SOC Ltd.			
6,750 % fällig am 06.08.2023	\$ 200	\$ 209	0,06
Sasol Financing International Ltd.			
4,500 % fällig am 14.11.2022	800	822	0,25
SASOL Financing USA LLC			
4,375 % fällig am 18.09.2026	600	622	0,19
Transnet SOC Ltd.			
4,000 % fällig am 26.07.2022	900	919	0,27
		2.572	0,77

STAATSEMISSIONEN			
South Africa Government International Bond			
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 122.900	9.782	2,94
Summe Südafrika		12.354	3,71

SPANIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
6,000 % fällig am 15.01.2026 (d)(f)	€ 400	543	0,16

SRI LANKA			
STAATSEMISSIONEN			
Sri Lanka Government International Bond			
5,750 % fällig am 18.04.2023	\$ 1.000	749	0,22

SCHWEDEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Svenska Handelsbanken AB			
4,750 % fällig am 01.03.2031 (d)(f)	600	636	0,19

SCHWEIZ			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Credit Suisse Group AG			
6,375 % fällig am 21.08.2026 (d)(f)	800	892	0,27
7,500 % fällig am 11.12.2023 (d)(f)	200	222	0,07
UBS AG			
5,125 % fällig am 15.05.2024 (f)	500	552	0,16
UBS Group AG			
5,750 % fällig am 19.02.2022 (d)(f)	€ 200	245	0,07
7,125 % fällig am 10.08.2021 (d)(f)	\$ 700	705	0,21
Summe Schweiz		2.616	0,78

THAILAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
PTT Treasury Center Co. Ltd.			
3,700 % fällig am 16.07.2070	2.000	2.033	0,61

TÜRKEI			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Turkish Airlines Pass-Through Trust			
4,200 % fällig am 15.09.2028	573	538	0,16

STAATSEMISSIONEN			
Turkey Government International Bond			
11,000 % fällig am 24.02.2027	TRY 1.800	160	0,05
Summe Türkei		698	0,21

UGANDA			
STAATSEMISSIONEN			
Republic of Uganda Government International Bond			
14,250 % fällig am 22.06.2034	UGX 2.706.600	755	0,22
16,000 % fällig am 14.11.2030	1.154.900	356	0,11
17,000 % fällig am 03.04.2031	805.700	261	0,08
Summe Uganda		1.372	0,41

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
INVESTMENTFONDS				BÖRSENGEHADELTE FONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (e)	367.599	\$ 4.356	1,31		6.300	\$ 640	0,19
				Summe Investmentfonds		\$ 5.141	1,54
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	14.555	145	0,04				
						4.501	1,35

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHADELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2021	4	\$ 1	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	52	(35)	(0,01)
				\$ (34)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (34)	(0,01)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Boeing Co.	1,000 %	20.06.2023	\$ 500	\$ 1	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2026	€ 500	10	0,00
				\$ 11	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 3.700	\$ (7)	0,00
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	27.600	336	0,10
				\$ 329	0,10

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,345 %	03.01.2022	BRL 17.000	\$ (29)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,350	03.01.2022	113.000	(190)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,523	03.01.2022	74.100	(123)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,580	02.01.2025	10.000	(62)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,220	02.01.2025	4.600	(4)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,675	02.01.2023	14.500	(19)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,745	02.01.2025	10.500	(37)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,950	04.01.2027	8.300	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		7,598	02.01.2024	227.200	104	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI		8,570	04.01.2027	139.700	(328)	(0,10)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		8,615	02.01.2025	6.000	53	0,02
Zahlung ⁽³⁾	3-Month CAD-Bank Bill		1,530	05.06.2024	CAD 129.200	(92)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		2,690	24.07.2024	COP 7.257.000	103	0,03
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		2,740	24.07.2024	7.084.900	(97)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		3,100	26.11.2025	2.651.000	53	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,060	26.11.2025	14.071.000	131	0,04
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,110	23.03.2026	4.493.200	(56)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS		4,651	26.11.2025	2.624.800	(8)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		0,500	16.06.2026	\$ 16.500	74	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		0,750	16.12.2022	8.500	25	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		0,750	16.06.2031	9.300	(75)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,000	17.06.2022	5.400	4	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2025	7.900	(178)	(0,05)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,250	17.06.2025	400	(3)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,250	17.06.2030	3.070	(131)	(0,04)

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250 %	16.12.2050	\$ 1.500	\$ 202	0,06
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	6.800	(458)	(0,14)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	4.500	(261)	(0,08)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2021	17.800	(177)	(0,05)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.06.2024	7.100	296	0,09
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2024	270	(5)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	4.100	(153)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,752	15.09.2021	6.530	(70)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	1.800	179	0,05
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,271	21.06.2029	11.000	422	0,13
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,030	07.08.2025	ZAR 115.000	(156)	(0,05)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,757	14.04.2026	96.300	(17)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,665	09.01.2023	20.100	(55)	(0,02)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,670	13.12.2022	83.500	(193)	(0,06)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,070	09.12.2024	10.000	39	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,600	19.06.2024	40.000	147	0,04
Erhalt ⁽³⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	0,708	05.06.2024	AUD 136.400	188	0,06
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,700	24.11.2022	CLP 966.100	26	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,905	24.11.2023	1.293.300	76	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	0,975	03.04.2023	110.000	(4)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,070	07.04.2023	675.000	(20)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,070	10.12.2023	1.218.000	(67)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,080	10.12.2023	1.218.000	(67)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,090	10.12.2023	2.828.000	(154)	(0,05)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,183	27.03.2023	357.900	(9)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,190	19.03.2023	970.000	(23)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,200	27.03.2023	103.400	(3)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,345	11.06.2025	1.350.000	127	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,900	01.03.2023	565.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,947	23.11.2027	999.000	148	0,05
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,950	05.05.2026	1.239.600	(110)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,965	24.11.2027	851.000	125	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,020	30.04.2026	1.300.000	(109)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,110	01.03.2023	1.030.000	(3)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,120	01.03.2023	1.290.000	(5)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,183	04.12.2027	2.661.000	(347)	(0,10)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,360	22.01.2025	4.810.000	(99)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,640	01.03.2026	795.000	26	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	0,670	28.01.2023	CZK 328.600	157	0,05
Zahlung ⁽³⁾	6-Month CZK-PRIBOR	1,025	29.07.2030	35.800	(62)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,224	28.01.2031	68.900	(169)	(0,05)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,441	28.01.2023	164.100	5	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,575	26.03.2026	28.100	(14)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,815	28.01.2031	34.200	8	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	2,000	19.06.2024	26.100	(2)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	2,255	15.01.2023	122.200	(126)	(0,04)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	€ 1.500	3	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	2.300	1	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	1.700	8	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	15.12.2040	300	30	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR	0,670	12.07.2022	HUF 230.200	4	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	0,970	26.02.2022	1.577.700	(7)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	19.06.2024	1.427.600	(126)	(0,04)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,760	21.01.2030	380.000	81	0,02
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,958	19.03.2026	398.600	(19)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,250	28.01.2023	PLN 57.900	(99)	(0,03)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,770	28.01.2023	28.900	(14)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,110	12.01.2031	9.800	131	0,04
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,165	28.01.2031	12.000	150	0,05
Erhalt ⁽³⁾	6-Month PLN-WIBOR	1,215	29.07.2030	10.300	105	0,03
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,855	28.01.2031	6.000	17	0,01
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,933	17.01.2025	11.800	50	0,02
Erhalt ⁽³⁾	6-Month SGD-SOR	1,750	15.09.2031	SGD 7.300	(13)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	17.06.2024	MXN 51.500	(101)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,080	16.06.2025	16.400	(40)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,700	12.09.2030	35.400	(155)	(0,05)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,770	09.10.2030	196.200	827	0,25
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,850	19.08.2030	12.100	(46)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,875	16.08.2030	16.800	(62)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,880	16.08.2030	8.700	(32)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,920	16.08.2030	9.100	(32)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,330	09.06.2022	116.000	(53)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,383	30.08.2040	23.200	137	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,480	28.05.2040	54.500	291	0,09
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,520	03.08.2040	5.700	29	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,520	06.08.2040	8.100	42	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,530	04.12.2024	33.000	9	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,533	03.08.2040	10.900	55	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,538	09.06.2022	100.000	56	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,580	01.01.2025	29.700	10	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,580	03.08.2040	6.000	29	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,830	27.12.2029	19.900	(3)	0,00

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	7,675 %	04.06.2029	MXN 65.100	\$ 172	0,05
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	7,865	13.05.2024	50.500	101	0,03
						\$ (121)	(0,03)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 219	0,07

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Put – OTC USD versus BRL	BRL 5,000	10.12.2021	7.960	\$ 201	\$ 230	0,07
	Put – OTC USD versus RUB	RUB 71,800	10.09.2021	20.603	297	166	0,05
JPM	Put – OTC USD versus ILS	ILS 3,266	23.07.2021	5.200	107	36	0,01
MYI	Call – OTC USD versus INR	INR 84,850	27.07.2023	5.500	244	152	0,05
	Put – OTC USD versus INR	84,850	27.07.2023	5.500	244	334	0,10
	Put – OTC USD versus MXN	MXN 19,700	10.06.2022	20.603	444	309	0,09
					\$ 1.537	\$ 1.227	0,37

VERKAUFSOPTIONEN

DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC USD versus INR	INR 79,250	08.04.2022	7.450	\$ (175)	\$ (97)	(0,03)
	Put – OTC USD versus INR	79,250	08.04.2022	7.450	(278)	(315)	(0,09)
	Call – OTC USD versus INR	81,000	27.04.2022	353	(6)	(4)	0,00
CBK	Call – OTC USD versus CNH	CNH 6,704	13.04.2022	1.053	(22)	(12)	0,00
	Put – OTC USD versus CNH	6,704	13.04.2022	1.053	(22)	(30)	(0,01)
GLM	Put – OTC USD versus BRL	BRL 4,825	10.12.2021	7.960	(108)	(125)	(0,04)
	Put – OTC USD versus RUB	RUB 70,000	10.09.2021	20.603	(118)	(53)	(0,02)
JPM	Put – OTC USD versus ILS	ILS 3,236	23.07.2021	10.400	(159)	(26)	(0,01)
	Call – OTC USD versus INR	INR 80,000	27.01.2022	147	(2)	(1)	0,00
MYI	Put – OTC USD versus MXN	MXN 19,100	10.06.2022	20.603	(247)	(164)	(0,05)
UAG	Call – OTC USD versus INR	INR 81,000	02.05.2022	339	(5)	(3)	0,00
					\$ (1.142)	\$ (830)	(0,25)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.12.2024	\$1.800	\$ 27	\$ (15)	\$ 12	0,00
BRC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.000	16	(10)	6	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.700	(22)	22	0	0,00
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	100	(1)	0	(1)	0,00
GST	Colombia Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.000	(11)	11	0	0,00
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.000	(23)	(5)	(28)	(0,01)
HUS	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.100	(13)	(2)	(15)	0,00
JPM	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	3.200	63	(42)	21	0,01
					\$ 36	\$ (41)	\$ (5)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.06.2022	\$ 300	\$ (7)	\$ 9	\$ 2	0,00
BRC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	4.400	(673)	(217)	(890)	(0,27)
	Eskom Holdings SOC Ltd.	1,000	20.12.2021	1.100	(24)	17	(7)	0,00
	Nigeria Government International Bond	5,000	20.12.2021	200	11	(7)	4	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	QNB Finance Ltd.	1,000 %	20.06.2023	\$ 700	\$ 5	\$ 1	\$ 6	0,00
DUB	Trust Fibra Uno	1,000	20.06.2022	200	(1)	(1)	(2)	0,00
DUB	Egypt Government International Bond	5,000	20.06.2022	400	14	0	14	0,00
JPM	Banque Centrale de Tunisie International Bond	1,000	20.06.2022	200	(14)	3	(11)	0,00
JPM	Eskom Holdings SOC Ltd.	1,000	20.12.2021	1.300	(13)	5	(8)	0,00
					\$ (702)	\$ (190)	\$ (892)	(0,27)

- (1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.
- (2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	\$ 100	ARS 4.488	\$ 0	\$ 80	\$ 80	0,02

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,197 %	18.03.2025	KRW 10.794.000	\$ 0	\$ 123	\$ 123	0,04
	Zahlung ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	2,160	27.11.2022	MYR 1.414.400	0	(85)	(85)	(0,03)
	Erhalt ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	2,350	21.06.2023	1.457.400	0	256	256	0,08
BPS	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,420	23.01.2022	KRW 28.023.500	0	(113)	(113)	(0,03)
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,450	23.01.2025	6.910.400	0	(11)	(11)	0,00
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,670	16.06.2026	MYR 10.600	0	7	7	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,890	18.09.2029	THB 52.800	0	77	77	0,02
CBK	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,050	18.03.2027	73.000	0	1	1	3,00
DUB	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,710	28.05.2022	COP 7.002.200	10	27	37	0,01
GLM	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,193	18.03.2022	KRW 24.643.000	0	50	50	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,868	18.03.2025	THB 309.700	0	36	36	0,01
JPM	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,020	06.06.2024	CLP 770.000	0	6	6	0,00
MYC	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,270	18.03.2030	KRW 2.009.300	0	(71)	(71)	(0,02)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,816	18.03.2022	THB 370.900	0	(56)	(56)	(0,02)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,110	24.01.2022	490.900	0	121	121	0,04
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,265	24.01.2025	200.400	0	(131)	(131)	(0,04)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,310	21.01.2025	150.000	0	(107)	(107)	(0,03)
MYI	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,340	18.09.2029	MYR 3.500	0	25	25	0,01
SCX	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,430	06.03.2025	CNY 25.600	0	(38)	(38)	(0,01)
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,020	04.02.2025	26.000	0	(25)	(25)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,230	23.08.2024	MYR 6.500	0	(42)	(42)	(0,01)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,209	15.01.2025	THB 199.300	0	(117)	(117)	(0,04)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,310	27.08.2024	50.000	0	(33)	(33)	(0,01)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,428	13.12.2029	9.100	0	2	2	0,00
UAG	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,920	15.01.2025	CNY 43.900	0	61	61	0,02
						\$ 10	\$ (37)	\$ (27)	(0,01)

- (1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt Volatilität	Referenzeinheit	Volatilität Ausübungskurs	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	6,275 %	12.01.2022	\$ 16	\$ 0	\$ 29	\$ 29	0,01
JPM	Zahlung	USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	6,850	22.10.2021	5	0	10	10	0,00
	Zahlung	USD versus TWD 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	5,300	22.04.2022	5	0	(1)	(1)	0,00
						\$ 0	\$ 38	\$ 38	0,01

- (1) Varianz-Swap

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnung s-monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2021	INR	333.298	\$ 4.402	\$ 0	\$ (67)	(0,02)
	08.2021	€	19.484	23.653	526	0	0,16
	08.2021	\$	1.627	AUD 2.101	0	(50)	(0,02)
	08.2021		370	CNH 2.607	32	0	0,01
	08.2021		585	CZK 12.170	0	(19)	(0,01)
	08.2021		1.126	HUF 340.075	22	0	0,01
	08.2021		219	RUB 16.460	5	0	0,00
	09.2021	PHP	29.674	\$ 609	5	0	0,00
	09.2021	\$	2.301	CNY 14.802	0	(22)	(0,01)
	09.2021		6.572	IDR 94.724.120	0	(115)	(0,03)
	09.2021		1.092	KZT 476.112	8	0	0,00
	09.2021		172	MYR 711	0	(1)	0,00
	09.2021		12	PLN 46	0	0	0,00
	09.2021		451	RUB 32.926	0	(6)	0,00
	09.2021	ZAR	10.532	\$ 763	32	0	0,01
	11.2021	\$	1.915	RON 7.825	0	(42)	(0,01)
	04.2022		2.506	INR 195.886	37	0	0,01
BPS	07.2021		444	RUB 33.133	8	0	0,00
	08.2021	MXN	4.465	\$ 209	0	(14)	0,00
	08.2021	\$	1.246	HUF 354.714	0	(48)	(0,01)
	08.2021		1.714	¥ 187.600	0	(23)	(0,01)
	09.2021	IDR	7.003.219	\$ 480	3	0	0,00
	09.2021	INR	61.610	822	1	0	0,00
	09.2021	\$	5.025	MYR 20.861	0	(18)	(0,01)
	09.2021		1.794	THB 56.099	0	(44)	(0,01)
	10.2021	MXN	10.021	\$ 496	0	(2)	0,00
	11.2021	ILS	1.284	392	0	(3)	0,00
	11.2021	\$	657	MXN 13.257	0	(2)	0,00
	02.2022		260	VND 5.993.000	0	(1)	0,00
	06.2022		874	MXN 18.000	0	(14)	0,00
BRC	08.2021		4.110	CZK 85.425	0	(140)	(0,04)
	09.2021	MYR	52.100	\$ 12.574	67	0	0,02
	09.2021	\$	8	PLN 30	0	0	0,00
BSS	01.2022	BRL	2.108	\$ 361	0	(48)	(0,01)
CBK	07.2021		24.510	4.873	0	(12)	0,00
	07.2021	PEN	10.554	2.899	142	0	0,04
	07.2021	RSD	42.199	€ 358	0	(1)	0,00
	07.2021	\$	156	RUB 12.067	9	0	0,00
	08.2021	CNH	21.849	\$ 3.311	0	(58)	(0,02)
	08.2021	HUF	51.672	172	0	(3)	0,00
	08.2021	MXN	41.065	1.964	0	(90)	(0,03)
	08.2021	\$	4.857	BRL 24.510	11	0	0,00
	08.2021		200	RUB 15.006	4	0	0,00
	09.2021	CLP	425.018	\$ 591	8	0	0,00
	09.2021	PEN	24.427	6.458	62	0	0,02
	09.2021	\$	404	ZAR 5.530	0	(20)	(0,01)
	10.2021	PEN	13.337	\$ 3.552	71	(9)	0,02
	10.2021	\$	355	KES 39.081	0	(2)	0,00
	04.2022		142	CNH 952	2	0	0,00
	06.2022	ILS	23.300	\$ 7.191	0	0	0,00
	06.2022	\$	610	VND 14.019.630	0	(7)	0,00
DUB	09.2021		1.886	RUB 137.367	0	(24)	(0,01)
GLM	07.2021	DOP	90.444	\$ 1.577	0	(6)	0,00
	07.2021	MXN	2.950	148	1	0	0,00
	07.2021	\$	1.461	DOP 83.509	1	0	0,00
	07.2021		2.654	PEN 10.554	104	0	0,03
	07.2021		313	RUB 24.189	17	0	0,01
	08.2021	COP	3.523.054	\$ 925	0	(17)	(0,01)
	08.2021	DOP	7.492	127	0	(4)	0,00
	08.2021	PEN	10.554	2.656	0	(107)	(0,03)
	08.2021	\$	1.709	HUF 486.893	0	(65)	(0,02)
	08.2021		338	RUB 25.206	5	0	0,00
	09.2021	DOP	79.412	\$ 1.369	0	(11)	0,00
	09.2021	RUB	337.447	4.627	54	0	0,02
	09.2021	\$	6.269	PLN 23.331	15	(155)	(0,04)
	09.2021		574	RUB 42.100	0	(4)	0,00
	09.2021		310	TWD 8.495	0	(4)	0,00
	09.2021		103	ZAR 1.426	0	(4)	0,00
	09.2021	ZAR	7.102	\$ 515	22	0	0,01
	10.2021	DOP	92.615	1.606	4	0	0,00
	11.2021	\$	4.616	PEN 17.304	0	(89)	(0,03)
	12.2021	BRL	6.202	\$ 1.195	0	(14)	0,00
	12.2021	SGD	162	120	0	0	0,00
HUS	08.2021	€	3.211	3.922	110	0	0,03
	08.2021	£	4.138	5.850	133	0	0,04
	08.2021	¥	182.200	1.677	35	0	0,01
	08.2021	\$	1.665	CAD 2.019	0	(34)	(0,01)
	08.2021		450	RUB 33.863	11	0	0,00
	08.2021		1.350	UYU 59.468	9	0	0,00
	09.2021	MXN	61.151	\$ 2.908	0	(140)	(0,04)
	09.2021	\$	2.492	CNH 16.017	0	(26)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	09.2021	\$	KRW	2.451.289	\$	0	(0,01)	
	09.2021		PLN	55		0	0,00	
	09.2021		RUB	17.336		(2)	0,00	
	11.2021	ILS	\$	406		1	0,00	
	02.2022	ZAR		324		(10)	0,00	
IND	09.2021	MYR		4.457		40	0,01	
	06.2022	TWD		815		14	0,00	
	06.2024	\$	TWD	20.969		(10)	0,00	
JPM	07.2021		ILS	6.524		2	0,00	
	07.2021		TRY	40		0	0,00	
	08.2021	€	\$	3.497		88	0,03	
	08.2021	\$	CZK	20.220		(30)	(0,01)	
	09.2021		RUB	199.860		(33)	(0,01)	
	09.2021		UYU	25.078		3	0,00	
	10.2021	KES	\$	112		(8)	0,00	
	10.2021	\$	KES	38.702		(2)	0,00	
	10.2021		MXN	29.671		62	0,02	
	12.2021		PHP	13.534		(6)	0,00	
	01.2022	BRL	\$	70		(9)	0,00	
	02.2022	ZAR		251		(2)	0,00	
MYI	07.2021	€		5		0	0,00	
	07.2021	\$	INR	33.637		7	0,00	
	08.2021	€	\$	851		23	0,01	
	08.2021	\$	CZK	18.317		(29)	(0,01)	
	08.2021		EGP	27.901		13	0,00	
	09.2021		PLN	2.826		(16)	(0,01)	
	12.2021		BRL	6.200		13	0,00	
	06.2022	MXN	\$	3.090		53	0,02	
RBC	08.2021	CAD		182		0	0,00	
SCX	08.2021	EGP		247		(6)	0,00	
	08.2021	\$	CZK	6.098		(9)	0,00	
	08.2021		HUF	229.122		9	0,00	
	09.2021		MYR	8.075		(12)	0,00	
	10.2021	KES	\$	544		(37)	(0,01)	
	12.2021	\$	INR	326.724		(43)	(0,01)	
	01.2022	BRL	\$	429		(58)	(0,02)	
SOG	07.2021	\$	RUB	13.784		11	0,00	
	08.2021			18.818		6	0,00	
	09.2021	PLN	\$	74		1	0,00	
SSB	07.2021	\$	BRL	24.510		292	0,09	
	07.2021		MXN	2.330		1	0,00	
	08.2021	€	\$	1.683		51	0,01	
	09.2021	ZAR		7.724		369	0,11	
UAG	07.2021	MXN		178		0	0,00	
	07.2021	RUB		171		0	0,00	
	07.2021	\$	RUB	26.248		16	0,00	
	08.2021	AUD	\$	162		3	0,00	
	09.2021	\$	PLN	5.946		(12)	0,00	
	09.2021		RUB	17.127		(2)	0,00	
	06.2022		MXN	45.585		(38)	(0,01)	
				\$ 2.654		\$ (1.990)	\$ 664	0,20

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	\$	€	4	\$	0	0,00	
BPS	07.2021			93.171		(2.846)	(0,85)	
BRC	07.2021			19		(1)	0,00	
GLM	07.2021		BRL	185		934	1	
	08.2021	BRL	\$	934		185	0	
HUS	07.2021	€		24		29	0,00	
	07.2021	\$	€	97		81	0,00	
MYI	07.2021	BRL	\$	934		174	0,00	
	07.2021	\$	€	5		4	0,00	
RBC	07.2021			46.629		38.116	0	
SCX	07.2021			108.407		88.614	0	
				\$ 1		\$ (7.609)	\$ (7.608)	(2,28)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (7.353)	(2,21)	
Summe Anlagen						\$ 329.940	98,99	
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 3.371	1,01	
Nettovermögen						\$ 333.311	100,00	

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	3,035 %	28.05.2032	25.05.2021	\$ 700	\$ 713	0,22
JPMorgan Structured Products BV	3,550	29.12.2021	04.02.2021	599	593	0,18
JPMorgan Structured Products BV	3,650	14.10.2024	18.10.2019	857	858	0,26
JPMorgan Structured Products BV	11,730	11.03.2022	30.03.2021	472	481	0,14
JPMorgan Structured Products BV	14,910	14.10.2022	11.01.2021	114	116	0,03
Oracle Corp.	4,100	25.03.2061	05.04.2021 - 16.04.2021	1.980	2.111	0,63
Sunac China Holdings Ltd.	5,950	30.12.2021	11.01.2021	1.100	1.101	0,33
				\$ 5.822	\$ 5.973	1,79

(h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 5.187 als Sicherheiten verpfändet.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 4.040 und Barmittel in Höhe von USD 4.200 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 7.106 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 331.705	\$ 262	\$ 331.967
Investmentfonds	4.501	640	0	5.141
Finanzderivate ⁽³⁾	0	(7.166)	(2)	(7.168)
Summen	\$ 4.501	\$ 325.179	\$ 260	\$ 329.940

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 226.221	\$ 2.746	\$ 228.967
Investmentfonds	12.032	641	0	12.673
Pensionsgeschäfte	0	1.565	0	1.565
Finanzderivate ⁽³⁾	(6)	5.724	0	5.718
Summen	\$ 12.026	\$ 234.151	\$ 2.746	\$ 248.923

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	(0,200) %	19.05.2021	19.08.2021	€ (2.113)	\$ (2.505)	(0,75)
SCX	0,200	01.07.2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (4.579)	(4.579)	(1,37)
	0,250	01.07.2021	TBD ⁽¹⁾	(585)	(585)	(0,18)
SGY	0,350	28.04.2021	28.07.2021	(2.125)	(2.127)	(0,64)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (9.796)	(2,94)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 237	\$ 0	\$ 237
BPS	(3.043)	2.550	(493)
BRC	(955)	844	(111)
BSS	(48)	0	(48)
CBK	63	(360)	(297)
DUB	27	(50)	(23)
GLM	156	(80)	76
GST	(28)	0	(28)
HUS	40	0	40
IND	44	0	44
JPM	91	0	91
MYC	(244)	260	16
MYI	708	(760)	(52)
RBC	(1.428)	1.250	(178)
SCX	(3.729)	3.336	(393)
SOG	18	0	18
SSB	713	(610)	103
UAG	25	0	25

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	73,96	58,50
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,51	44,19
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,13	1,24
Investmentfonds	1,54	5,75
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,71
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,07	1,55
Freiverkehrsfinanzderivate	(2,21)	1,05
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(2,94)	(1,71)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Argentinien	0,45	0,80
Australien	0,52	k. A.
Österreich	0,31	0,23
Aserbaidschan	0,09	0,14
Bahamas	0,24	k. A.
Weissrussland	0,13	0,23
Bermudas	0,36	k. A.
Brasilien	4,27	4,04
Cayman Inseln	4,72	4,48
Chile	0,18	0,79
China	1,38	2,52
Kolumbien	1,96	4,02
Costa Rica	0,08	0,12
Kroatien	k. A.	1,14
Dominikanische Republik	1,71	3,40
Ecuador	1,04	k. A.
Ägypten	1,04	1,03
El Salvador	0,33	0,52
Frankreich	0,43	0,10
Georgia	k. A.	0,23
Deutschland	0,91	0,91
Ghana	1,11	1,20
Guatemala	0,13	0,20
Guernsey, Kanalinseln	0,38	0,59
Hongkong	1,01	0,74
Ungarn	k. A.	2,53
Indien	1,14	1,40
Indonesien	k. A.	0,28
Irak	0,64	k. A.
Irland	3,57	1,21
Insel Man	0,48	0,72
Israel	1,73	2,24
Italien	1,16	1,13
Elfenbeinküste	0,79	0,42
Japan	0,33	0,25
Jordanien	0,54	0,45
Kasachstan	0,34	0,53
Kenia	0,20	0,32

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Luxemburg	2,90	1,67
Malaysia	0,19	6,12
Mauritius	0,22	0,28
Mexiko	4,52	7,95
Mongolei	0,69	0,33
Namibia	0,93	1,03
Niederlande	1,75	0,58
Nigeria	0,65	0,65
Norwegen	0,17	0,25
Oman	0,72	1,86
Pakistan	0,44	k. A.
Paraguay	0,14	0,23
Peru	2,64	6,63
Philippinen	0,39	0,66
Katar	0,18	0,30
Rumänien	0,43	0,90
Russland	k. A.	1,94
Saudi-Arabien	0,58	0,92
Serbien	0,74	0,70
Singapur	2,29	0,32
Südafrika	3,71	2,31
Spanien	0,16	0,23
Sri Lanka	0,22	0,12
Supranational	k. A.	0,83
Schweden	0,19	0,29
Schweiz	0,78	0,44
Thailand	0,61	k. A.
Türkei	0,21	0,10
Uganda	0,41	k. A.
Ukraine	1,59	0,75
Vereinigte Arabische Emirate	0,57	0,90
Großbritannien	2,78	3,83
USA	14,14	19,01
Uruguay	k. A.	0,18
Jungferninseln (Britisch)	1,05	k. A.
Kurzfristige Instrumente	18,91	2,71
Investmentfonds	1,54	5,75
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,71
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,10	0,06
Zinsswaps	(0,03)	1,49
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,37	0,30
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,25)	(0,29)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,00	0,03
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,27)	(0,05)
Cross-Currency Swaps	0,02	0,09
Zinsswaps	(0,01)	(0,01)
Volatilitätsswaps	0,01	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,20	(0,45)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,28)	1,43
Sonstige Aktiva und Passiva	1,01	(12,99)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS					
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				TSCHECHISCHE REPUBLIK				MALAYSIA								
ARGENTINIEN				STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN								
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Czech Republic Government International Bond				Malaysia Government International Bond								
YPF S.A.				0,100 % fällig am 17.04.2022	CZK	35.500	1,645	5,33	4,160 % fällig am 15.07.2021	MYR	4.400	1,061	3,44			
40,115 % fällig am 24.07.2021	ARS	1.651	10	0,03												
STAATSEMISSIONEN				DOMINIKANISCHE REPUBLIK				MAURITIUS								
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								
Argentina Government International Bond				Dominican Republic Government International Bond				Greenko Solar Mauritius Ltd.								
0,125 % fällig am 09.07.2030		99	33	9,750 % fällig am 05.06.2026	DOP	31.800	633	2,05	5,950 % fällig am 29.07.2026		200	216	0,70			
0,125 % fällig am 09.07.2035		105	32	0,10												
			65	0,21	AGYPHEN				MEXIKO							
					STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
Summe Argentinien			75	0,24	Egypt Government International Bond				Petroleos Mexicanos							
					14,605 % fällig am 08.09.2025	EGP	3.100	199	0,65	7,650 % fällig am 24.11.2021	MXN	860	43	0,14		
BRASILIEN				FRANKREICH				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN								
Banco BTG Pactual S.A.				RCI Banque S.A.				Mexico Government International Bond								
4,500 % fällig am 10.01.2025		200	210	0,68	0,250 % fällig am 08.03.2023	€	28	33	0,11	7,500 % fällig am 03.06.2027		700	37	0,12		
Banco Votorantim S.A.								8,500 % fällig am 31.05.2029				500	28	0,09		
4,000 % fällig am 24.09.2022		200	207	0,67	GHANA									65	0,21	
CSN Resources S.A.					STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
7,625 % fällig am 13.02.2023		200	208	0,67	Ghana Government International Bond				Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.							
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.					20,750 % fällig am 16.01.2023	GHS	1.100	197	0,64	8,790 % fällig am 09.12.2014 ^		5.000	0	0,00		
0,000 % fällig am 02.08.2021 (c)(e)		23	0	0,00	UNGARN									43	0,14	
Oi S.A.					STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN							
0,000 % fällig am 25.02.2035	BRL	50	37	0,12	Hungarian Development Bank				Mexico Government International Bond							
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL					0,375 % fällig am 09.06.2026	€	100	119	0,39	7,500 % fällig am 03.06.2027		700	37	0,12		
9,850 % fällig am 16.07.2032		2.831	591	1,92	INDIEN				8,500 % fällig am 31.05.2029							
Vale Overseas Ltd.					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL										65	0,21
6,250 % fällig am 10.08.2026		\$	200	0,78	Shriram Transport Finance Co. Ltd.				Summe Mexiko							
Vale S.A.					5,700 % fällig am 27.02.2022		200	203	0,66				108	0,35		
0,000 % (e)	BRL	900	107	0,35	State Bank of India				NIGERIA							
XP, Inc.					4,000 % fällig am 24.01.2022		200	203	0,66	STAATSEMISSIONEN						
3,250 % fällig am 01.07.2026 (a)		\$	200	0,64	Summe Indien				Nigeria Government International Bond							
			1.799	5,83				406	1,32	5,625 % fällig am 27.06.2022						
Summe Brasilien					IRLAND				PERU							
					FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
CAYMAN INSELN				ISRAEL				RUSSLAND								
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN								
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.				Black Diamond CLO DAC				Russia Government International Bond								
5,625 % fällig am 24.10.2024		200	207	0,67	0,860 % fällig am 20.01.2032	€	100	119	0,39	7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB	3.300	47	0,15		
MAF Global Securities Ltd.					Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC					SAUDI-ARABIEN						
4,750 % fällig am 07.05.2024		200	218	0,71	0,750 % fällig am 15.11.2031		100	118	0,38	STAATSEMISSIONEN						
Odebrecht Drilling Norbe Ltd.					Harvest CLO DAC					Saudi Government International Bond						
6,350 % fällig am 01.12.2021 ^		1	1	0,00	0,650 % fällig am 26.06.2030		100	118	0,38	2,375 % fällig am 26.10.2021						
Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)					Summe Irland			355	1,15	SERBIEN						
7,350 % fällig am 01.12.2026 ^ (b)		49	25	0,08	ISRAEL				STAATSEMISSIONEN							
Sands China Ltd.					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
5,125 % fällig am 08.08.2025		200	224	0,73	Leviathan Bond Ltd.				Serbia Government International Bond							
			675	2,19	6,125 % fällig am 30.06.2025		100	110	0,36	4,500 % fällig am 20.08.2032						
Summe Cayman Inseln					STAATSEMISSIONEN				SINGAPUR							
					Israel Government International Bond				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
CHINA				ITALIEN				SUDAFRIKA								
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								
New Metro Global Ltd.				Banca Carige SpA				BOC Aviation Ltd.								
7,500 % fällig am 16.12.2021		200	204	0,66	0,957 % fällig am 25.05.2022	€	100	119	0,39	2,750 % fällig am 18.09.2022		200	204	0,66		
KOLUMBIEN				LUXEMBURG				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								
Empresas Publicas de Medellin ESP				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				Eskom Holdings SOC Ltd.								
7,625 % fällig am 10.09.2024	COP	540.000	146	0,48	5,250 % fällig am 23.05.2023 (g)		200	212	0,69	7,850 % fällig am 02.04.2026	ZAR	5.000	343	1,11		
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								
Colombian TES								Growthpoint Properties International Pty. Ltd.								
5,750 % fällig am 03.11.2027		4.242.000	1.089	3,53				5,872 % fällig am 02.05.2023		200	214	0,70				
Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter																
7,875 % fällig am 12.08.2024		12.000	4	0,01												
			1.093	3,54												
Summe Kolumbien			1.239	4,02												

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAATSEMISSIONEN				Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				JPMorgan Structured Products BV			
South Africa Government International Bond				0,152 % fällig am 25.10.2036	\$ 4	\$ 2	0,01	3,550 % fällig am 29.12.2021 (h)	€ 100	\$ 119	0,38
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 8.200	\$ 653	2,11								
Summe Südafrika		1.210	3,92			879	2,85			2.776	9,00
UGANDA STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				EGYPT TREASURY BILLS			
Republic of Uganda Government International Bond				DAE Funding LLC				12,930 % fällig am			
14,250 % fällig am 22.06.2034	UGX267.100	75	0,24	1,550 % fällig am 01.08.2024	200	200	0,65	17,08.2021 (c)(d)	EGP 1.300	82	0,26
16,000 % fällig am 14.11.2030	121.500	37	0,12	Rio Oil Finance Trust				12,949 % fällig am			
17,000 % fällig am 03.04.2031	80.000	26	0,09	9,250 % fällig am 06.07.2024	612	680	2,20	03.08.2021 (c)(d)	2.050	129	0,42
Summe Uganda		138	0,45			880	2,85			211	0,68
UKRAINE STAATSEMISSIONEN				NON-AGENCY-MBS				ISRAEL TREASURY BILLS			
Ukraine Government International Bond				Banc of America Mortgage Trust				0,006 % fällig am 08.06.2022 (c)(d)	ILS 500	153	0,50
7,750 % fällig am 01.09.2022	\$ 200	210	0,68	2,483 % fällig am 25.07.2034	1	1	0,01				
11,750 % fällig am 15.06.2022	UAH 1.100	41	0,13	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				JAPAN TREASURY BILLS			
17,000 % fällig am 11.05.2022	300	12	0,04	3,156 % fällig am 25.05.2047 ^	9	9	0,03	(0,105) % fällig am			
Summe Ukraine		263	0,85					23.08.2021 (c)(d)	¥160.000	1.442	4,67
USA FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Citigroup Mortgage Loan Trust				MALAYSIA TREASURY BILLS			
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				0,162 % fällig am 25.01.2037	3	3	0,01	1,798 % fällig am 24.12.2021 (c)(d)	MYR 80	19	0,06
1,142 % fällig am 25.12.2033	\$ 91	91	0,30	3,234 % fällig am 25.09.2037 ^	121	120	0,39	1,818 % fällig am 24.12.2021 (c)(d)	1.820	435	1,41
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust								1,824 % fällig am 24.12.2021 (c)(d)	900	215	0,70
1,092 % fällig am 25.10.2037	7	7	0,02	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust						669	2,17
2,267 % fällig am 25.01.2035	34	34	0,11	2,915 % fällig am 20.04.2035	1	1	0,00	U.S. TREASURY BILLS			
Citigroup Mortgage Loan Trust								0,013 % fällig am 21.09.2021 (c)(d)	\$ 900	900	2,92
0,152 % fällig am 25.07.2045	8	7	0,02	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				0,043 % fällig am 26.10.2021 (c)(d)	1.100	1.099	3,57
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				2,861 % fällig am 25.08.2035	4	3	0,01	0,061 % fällig am 02.09.2021 (c)(d)	1.800	1.800	5,83
0,332 % fällig am 25.02.2037	70	68	0,22	GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates				Summe kurzfristige Instrumente		9.250	29,99
1,217 % fällig am 25.11.2035	60	60	0,20	2,549 % fällig am 25.10.2033	1	1	0,00	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 26.961	87,42	
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				GSR Mortgage Loan Trust							
0,152 % fällig am 25.11.2036	2	1	0,00	2,927 % fällig am 25.01.2036 ^	1	1	0,00				
GSAMP Trust				IndyMac Mortgage Loan Trust							
0,182 % fällig am 25.01.2037	55	40	0,13	0,732 % fällig am 25.07.2045	36	32	0,11				
Home Equity Asset Trust				2,790 % fällig am 25.11.2037	90	87	0,28				
0,692 % fällig am 25.11.2032	4	4	0,01	2,880 % fällig am 25.12.2034	4	4	0,01				
HSI Asset Loan Obligation Trust				Lehman XS Trust							
0,152 % fällig am 25.12.2036	2	1	0,00	0,282 % fällig am 25.09.2046	148	149	0,48				
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				Residential Accredit Loans, Inc. Trust							
0,857 % fällig am 25.01.2035	23	23	0,08	1,023 % fällig am 25.10.2037	63	61	0,20				
0,887 % fällig am 25.03.2034	67	66	0,21	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust							
Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust				6,000 % fällig am 25.10.2036	5	5	0,02				
1,442 % fällig am 25.02.2033	22	22	0,07	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
New Century Home Equity Loan Trust				3,031 % fällig am 25.02.2037 ^	9	9	0,03				
0,272 % fällig am 25.05.2036	14	13	0,04			686	2,23				
Option One Mortgage Loan Trust				Summe USA		2.445	7,93				
0,232 % fällig am 25.03.2037	292	224	0,73	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE COMMERCIAL PAPER							
Saxon Asset Securities Trust				Sunac China Holdings Ltd.							
0,402 % fällig am 25.09.2037	18	18	0,06	5,950 % fällig am 30.12.2021 (h)	200	200	0,65				
Soundview Home Loan Trust				KURZFRISTIGE SCHULDITITEL							
0,172 % fällig am 25.06.2037	5	4	0,01	China Government International Bond							
0,262 % fällig am 25.07.2037	77	72	0,23	2,890 % fällig am 19.11.2021	CNY 2.300	357	1,16				
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				Federal Home Loan Bank							
0,312 % fällig am 25.10.2037	158	119	0,39	0,008 % fällig am 27.08.2021 (c)(d)	\$ 1.900	1.900	6,16				
				0,010 % fällig am 25.08.2021 (c)(d)	400	400	1,30				

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Boeing Co.	1,000 %	20.06.2023	\$ 100	\$ 0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	4,000 %	03.01.2022	BRL 1.700	\$ 1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,100	02.01.2023	4.500	(23)	(0,07)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,100	02.01.2024	400	2	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,150	02.01.2023	8.000	44	0,14
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,250	02.01.2023	3.500	5	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,660	02.01.2025	3.300	(32)	(0,10)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,863	02.01.2023	5.000	(7)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,020	04.01.2027	1.500	17	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,050	02.01.2025	4.700	5	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,140	04.01.2027	7.800	(38)	(0,12)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,250	04.01.2027	700	5	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,520	04.01.2027	10.200	63	0,20
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,950	04.01.2027	800	8	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,960	04.01.2027	6.500	(2)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,195	02.01.2023	3.600	(2)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,260	02.01.2023	1.400	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,310	02.01.2024	1.000	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,775	02.01.2024	1.700	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,800	04.01.2027	900	6	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,325	04.01.2027	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,355	04.01.2027	400	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,450	04.01.2027	300	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,675	04.01.2027	1.700	(25)	(0,08)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,600	04.01.2027	2.700	(69)	(0,22)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,240	04.01.2027	500	(6)	(0,02)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	1,860	07.05.2025	CNY 1.700	4	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,000	02.02.2023	COP 9.125.800	62	0,20
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,148	25.09.2022	5.927.600	2	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,155	29.09.2022	806.700	(3)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,630	24.07.2024	1.748.000	26	0,08
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,650	24.07.2024	2.178.000	31	0,10
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,740	24.07.2024	4.110.000	(56)	(0,18)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,750	24.07.2024	2.024.100	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,995	24.11.2025	1.281.000	27	0,09
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,080	13.01.2026	922.300	(18)	(0,06)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,125	15.01.2026	386.000	8	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,145	11.05.2023	3.203.210	(7)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,975	23.06.2027	216.900	4	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,040	13.01.2031	1.002.000	34	0,11
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,155	15.01.2031	1.175.400	(3)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,200	18.09.2030	2.296.200	(16)	(0,05)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,410	03.11.2027	2.822.000	39	0,13
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,495	10.10.2024	244.300	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,655	11.05.2026	1.344.458	6	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,175	28.05.2027	1.045.600	(1)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	17.06.2022	\$ 1.800	(35)	(0,11)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2021	2.200	(20)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2024	180	(4)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2021	2.000	13	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2022	900	(7)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2022	4.800	(52)	(0,17)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,375	20.10.2026	ZAR 5.900	13	0,04
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,601	09.06.2026	900	(1)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,680	08.06.2026	2.400	(2)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,410	11.02.2023	1.500	3	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,700	24.11.2022	CLP 53.800	2	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,290	05.11.2025	123.100	14	0,05
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,582	02.02.2026	40.000	(4)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,640	12.01.2026	293.300	28	0,09
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,684	04.06.2027	231.400	(35)	(0,11)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,715	04.06.2027	46.200	(7)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,935	10.03.2025	288.700	16	0,05
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,950	05.05.2026	318.600	(29)	(0,09)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,020	30.04.2026	335.000	(29)	(0,09)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,080	01.06.2030	62.000	(14)	(0,05)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,110	01.06.2030	20.000	(5)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,270	15.03.2026	682.000	(42)	(0,14)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,480	24.11.2030	140.000	26	0,09
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,545	05.02.2026	88.000	(3)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,565	27.11.2030	35.000	(7)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,585	27.11.2030	35.000	(7)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,640	01.03.2026	326.000	12	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,680	12.01.2031	325.000	(52)	(0,17)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,000	14.06.2026	436.000	12	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,120	05.02.2030	29.000	(3)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,215	14.01.2030	143.000	11	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,245	15.03.2031	188.000	18	0,06
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,520	14.06.2028	13.800	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,900	14.06.2031	224.000	8	0,03
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,575	26.03.2026	CZK 700	0	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,260 %	12.03.2022	PLN 2.700	\$ 0	0,00	
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,980	09.06.2030	300	5	0,02	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,145	13.02.2023	MXN 49.000	69	0,22	
Zahlung ⁽³⁾	28-Day MXN-TIIE	4,290	16.02.2023	10.900	(11)	(0,04)	
Zahlung ⁽³⁾	28-Day MXN-TIIE	4,300	16.02.2023	16.700	(17)	(0,06)	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,340	12.02.2024	34.000	(79)	(0,26)	
Zahlung ⁽³⁾	28-Day MXN-TIIE	4,515	17.08.2022	23.900	(15)	(0,05)	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,530	15.11.2022	14.600	(14)	(0,05)	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,540	21.02.2024	3.300	7	0,02	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,680	16.03.2023	19.000	(20)	(0,07)	
Zahlung ⁽³⁾	28-Day MXN-TIIE	4,700	25.08.2022	33.700	(19)	(0,06)	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,730	06.02.2026	3.600	(13)	(0,04)	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,830	22.07.2025	1.400	4	0,01	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,840	19.02.2025	2.700	7	0,02	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,850	19.02.2025	3.700	10	0,03	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,880	07.11.2025	20.100	(64)	(0,21)	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,900	22.03.2023	8.300	7	0,02	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,920	10.04.2023	5.800	5	0,02	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,943	12.02.2026	2.300	8	0,02	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,950	12.02.2026	3.500	11	0,04	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,120	29.09.2025	8.200	(5)	(0,02)	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,282	29.03.2023	19.600	11	0,04	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,325	09.06.2023	14.300	9	0,03	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,510	21.01.2031	4.800	(25)	(0,08)	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,520	21.03.2024	21.000	19	0,06	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,520	01.01.2031	4.000	21	0,07	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,575	01.11.2030	11.500	57	0,18	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,605	26.03.2024	500	0	0,00	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,610	03.07.2030	4.100	19	0,06	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,650	22.03.2024	11.000	(8)	(0,03)	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,800	06.04.2026	5.000	(8)	(0,03)	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,893	05.06.2025	9.200	9	0,03	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,980	12.02.2031	1.300	(5)	(0,02)	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,990	12.02.2031	3.000	(11)	(0,03)	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,360	22.03.2023	12.300	9	0,03	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,463	18.05.2040	800	4	0,01	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,510	09.12.2021	18.500	7	0,02	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,600	26.02.2030	3.900	15	0,05	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,630	31.03.2031	1.500	2	0,01	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,670	19.06.2026	400	0	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,678	29.05.2031	8.600	(3)	(0,01)	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,715	30.05.2031	3.500	(3)	(0,01)	
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,720	19.06.2026	300	0	0,00	
Zahlung	CPURNSA	2,307	23.02.2031	\$ 400	(13)	(0,04)	
Zahlung	CPURNSA	2,326	22.02.2031	300	(9)	(0,03)	
						\$ (119)	(0,39)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (119)	(0,39)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
GLM	Put – OTC USD versus BRL	BRL 5,000	10.12.2021	264	\$ 6	\$ 8	0,03
	Call – OTC USD versus BRL	5,800	15.02.2022	324	16	6	0,02
	Put – OTC USD versus RUB	71,800	10.09.2021	683	10	5	0,02
JPM	Put – OTC USD versus CNH	CNH 6,250	18.02.2022	670	1	0	0,00
MYI	Put – OTC EUR versus HUF	HUF 350,000	21.09.2021	283	2	3	0,01
	Put – OTC USD versus BRL	BRL 5,400	22.07.2021	304	8	23	0,07
	Call – OTC USD versus MXN	MXN 20,500	27.07.2021	600	3	3	0,01
	Put – OTC USD versus MXN	19,700	10.06.2022	683	15	10	0,03
					\$ 61	\$ 58	0,19

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

VERKAUFSOPTIONEN

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC USD versus INR	INR 81,000	27.04.2022	33	\$ (1)	\$ 0	0,00
GLM	Put – OTC USD versus BRL	BRL 4,825	10.12.2021	264	(4)	(4)	(0,01)
	Put – OTC USD versus BRL	5,000	15.02.2022	324	(8)	(10)	(0,03)
	Call – OTC USD versus BRL	6,300	15.02.2022	324	(9)	(3)	(0,01)
	Put – OTC USD versus RUB	RUB 70,000	10.09.2021	683	(4)	(2)	(0,01)
JPM	Call – OTC USD versus INR	INR 80,000	27.01.2022	14	0	0	0,00
MYI	Put – OTC EUR versus HUF	HUF 343,000	21.09.2021	566	(1)	(2)	(0,01)
	Put – OTC USD versus BRL	BRL 5,300	22.07.2021	608	(11)	(35)	(0,11)
	Put – OTC USD versus MXN	MXN 19,100	10.06.2022	683	(8)	(6)	(0,02)
UAG	Call – OTC USD versus INR	INR 81,000	02.05.2022	32	0	0	0,00
	Call – OTC USD versus TRY	TRY 12,000	27.10.2021	100	(5)	(1)	0,00
					\$ (51)	\$ (63)	(0,20)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Eskom Holdings SOC Ltd.	1,000 %	20.12.2021	\$ 100	\$ (2)	\$ 1	\$ (1)	0,00
	QNB Finance Ltd.	1,000	20.06.2023	100	1	0	1	0,00
FBF	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2021	100	(9)	9	0	0,00
UAG	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	100	0	1	1	0,00
					\$ (10)	\$ 11	\$ 1	0,00

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282% basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	\$ 60	ARS 2.693	\$ 0	\$ 48	\$ 48	0,15
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,333 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	30.50.2024	170	7.557	(1)	130	129	0,42
						\$ (1)	\$ 178	\$ 177	0,57

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Referenzeinheit	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,170 %	25.01.2023	COP 55.400	\$ 0	\$ 1	\$ 1	0,00
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,265	14.06.2029	CLP 11.100	0	(1)	(1)	0,00
SCX	Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,880	17.09.2024	CNY 1.000	0	(1)	(1)	0,00
						\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00

VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Referenzeinheit	Volatilität	Ausübungs-kurs	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	USD versus MXN 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	14,400 %		24.11.2021	\$ 1	\$ 0	\$ 3	\$ 3	0,01
CBK	Zahlung	USD versus MXN 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	15,100		05.11.2021	1	0	4	4	0,01
	Zahlung	USD versus ZAR 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	16,600		05.11.2021	1	0	2	2	0,01
DUB	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	6,425		05.11.2021	2	0	5	5	0,02
GLM	Zahlung	USD versus BRL 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	18,300		05.11.2021	1	0	1	1	0,00
	Zahlung	USD versus BRL 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	18,825		23.11.2021	1	0	1	1	0,00
JPM	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	6,350		24.11.2021	2	0	5	5	0,02
	Zahlung	USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	6,850		22.10.2021	1	0	1	1	0,00
	Zahlung	USD versus RUB 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	15,700		03.11.2021	1	0	4	4	0,01
	Zahlung	USD versus TWD 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	5,300		22.04.2022	1	0	0	0	0,00

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt Volatilität	Referenzeinheit	Volatilität Ausübungs- kurs	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
MYI	Zahlung	USD versus RUB 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	15,500 %	23.11.2021	\$ 1	\$ 0	\$ 4	\$ 4	0,01
	Zahlung	USD versus ZAR 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	16,000	24.11.2021	1	0	2	2	0,01
						\$ 0	\$ 32	\$ 32	0,10

(1) Varianz-Swaps

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	09.2021	PHP	5.692	\$ 117	\$ 1	\$ 0	0,00
BOA	07.2021	€	148	180	5	0	0,01
	07.2021	MXN	877	44	0	0	0,00
	07.2021	MYR	1.400	344	7	0	0,02
	07.2021	RUB	4.376	60	0	0	0,00
	07.2021	\$	175	MXN 3.471	0	(1)	0,00
	07.2021		146	PEN 567	2	0	0,01
	07.2021		47	RUB 3.427	0	(1)	0,00
	07.2021		1.115	THB 34.913	0	(25)	(0,08)
	08.2021	HUF	5.398	\$ 18	0	0	0,00
	08.2021	\$	500	CZK 10.414	0	(16)	(0,05)
	08.2021		141	HUF 42.250	2	0	0,01
	08.2021		63	RUB 4.744	1	0	0,00
	09.2021	PHP	2.729	\$ 56	0	0	0,00
	09.2021	\$	2.517	CNY 16.190	0	(24)	(0,08)
	09.2021		93	INR 6.857	0	(2)	(0,01)
	09.2021		49	KZT 21.364	0	0	0,00
	09.2021		553	PLN 2.080	0	(7)	(0,02)
	09.2021		248	RUB 18.073	0	(3)	(0,01)
	09.2021	ZAR	601	\$ 44	2	2	0,01
	11.2021	\$	578	RON 2.364	0	(13)	(0,04)
BPS	02.2022	ZAR	488	\$ 31	0	(2)	(0,01)
	07.2021	COP	320.369	86	1	0	0,00
	07.2021	€	101	123	3	0	0,01
	07.2021	TRY	363	43	2	0	0,01
	07.2021	\$	28	BRL 142	0	0	0,00
	07.2021		32	€ 27	0	0	0,00
	07.2021		178	MXN 3.530	0	(1)	0,00
	07.2021		1.065	MYR 4.400	0	(6)	(0,02)
	07.2021		376	RUB 28.066	7	7	0,02
	08.2021	COP	67.903	\$ 18	0	0	0,00
	08.2021	HUF	72.292	243	0	(1)	0,00
	08.2021	\$	139	AUD 178	0	(5)	(0,02)
	08.2021		329	HUF 93.643	0	(13)	(0,04)
	09.2021	IDR	483.714	\$ 33	0	0	0,00
	09.2021	INR	12.738	170	0	0	0,00
	09.2021	KRW	356.126	314	0	(1)	0,00
	09.2021	\$	1.463	MYR 6.082	0	(3)	(0,01)
	09.2021		270	THB 8.458	0	(6)	(0,02)
	11.2021		78	MXN 1.570	0	0	0,00
BRC	06.2022		29	597	0	0	0,00
	07.2021		87	BRL 462	5	5	0,01
	07.2021		21	TRY 174	0	(1)	0,00
	08.2021		2.265	MXN 46.950	84	84	0,28
	09.2021	MYR	6.942	\$ 1.677	11	11	0,04
	09.2021	THB	477	15	0	0	0,00
	09.2021	\$	263	MYR 1.092	0	(1)	0,00
	09.2021		247	PLN 939	0	0	0,00
BSS	07.2021	CLP	1.008.897	\$ 1.359	0	(27)	(0,09)
	09.2021	\$	39	UYU 1.773	1	0	0,00
CBK	07.2021	BRL	301	\$ 61	1	1	0,00
	07.2021	MXN	3.649	185	2	2	0,01
	07.2021	PEN	894	245	11	11	0,04
	07.2021	RSD	6.335	€ 54	0	0	0,00
	07.2021	THB	16.967	\$ 544	14	14	0,05
	07.2021	\$	250	MXN 5.012	1	0	0,00
	07.2021		30	RUB 2.309	2	2	0,01
	07.2021		213	THB 6.660	0	(5)	(0,02)
	08.2021	¥	160.000	\$ 1.471	29	29	0,09
	08.2021	\$	61	BRL 301	0	(1)	0,00
	08.2021		767	HUF 230.539	12	12	0,04
	08.2021		369	PEN 1.345	0	(17)	(0,05)
	08.2021		58	RUB 4.325	1	0	0,00
	08.2021		543	THB 16.967	0	(14)	(0,05)
	08.2021	UYU	2.655	\$ 60	0	(1)	0,00
	09.2021	CLP	34.057	45	0	(2)	(0,01)
	09.2021	INR	1.147	15	0	0	0,00
	09.2021	PEN	8.274	2.220	55	55	0,18
	09.2021	PHP	585	12	0	0	0,00
	09.2021	TWD	3.598	130	0	0	0,00
	09.2021	\$	97	KZT 42.316	1	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2021	ZAR	\$ 2.326	\$ 167	\$ 6	\$ 0	0,02
	10.2021	\$	718	PEN 2.763	5	0	0,01
	12.2021		272	999	0	(10)	(0,03)
	01.2022	ILS	9.166	\$ 2.873	52	0	0,16
	01.2022	\$	162	PEN 587	0	(8)	(0,03)
	02.2022		71	ZAR 1.087	3	0	0,01
	02.2022	ZAR	1.099	\$ 69	0	(5)	(0,02)
	03.2022	\$	799	PEN 2.942	0	(31)	(0,10)
	06.2022	ILS	500	\$ 154	0	0	0,00
DUB	08.2021	COP	195.636	52	0	0	0,00
	09.2021	\$	62	RUB 4.516	0	(1)	0,00
GLM	07.2021	BRL	860	\$ 170	0	(1)	(0,01)
	07.2021	DOP	2.693	45	0	(2)	(0,01)
	07.2021	RUB	11.374	156	1	0	0,00
	07.2021	TRY	155	19	1	0	0,00
	07.2021	\$	404	MXN 8.065	1	(1)	0,00
	07.2021		60	RUB 4.629	3	0	0,01
	07.2021		30	TRY 248	0	(1)	0,00
	08.2021	COP	4.093.699	\$ 1.082	4	(16)	(0,04)
	08.2021	\$	16	COP 59.690	0	0	0,00
	08.2021		35	HUF 10.018	0	(1)	0,00
	08.2021		488	RUB 35.808	2	(3)	0,00
	09.2021	DOP	7.918	\$ 137	0	0	0,00
	09.2021	MYR	574	138	0	0	0,00
	09.2021	PHP	10.419	214	2	0	0,01
	09.2021	PLN	136	36	0	0	0,00
	09.2021	RUB	11.158	153	2	0	0,01
	09.2021	\$	16	HKD 123	0	0	0,00
	09.2021		134	KZT 58.156	0	0	0,00
	09.2021		491	PLN 1.859	0	(3)	(0,01)
	09.2021		315	RUB 23.071	0	(2)	(0,01)
	09.2021		2.109	TWD 57.786	0	(26)	(0,08)
	09.2021	ZAR	2.188	\$ 159	7	0	0,02
	10.2021	DOP	23.438	404	0	(1)	0,00
	11.2021	RON	103	25	0	0	0,00
	11.2021	\$	32	PEN 119	0	(1)	0,00
	12.2021	BRL	208	\$ 40	0	0	0,00
	12.2021	SGD	252	187	0	0	0,00
	02.2022	\$	132	BRL 730	9	0	0,03
	02.2022		35	ZAR 544	2	0	0,01
	02.2022	ZAR	890	\$ 58	0	(2)	(0,01)
HUS	04.2022	CZK	35.515	1.618	0	(28)	(0,09)
	07.2021	€	156	190	5	0	0,01
	07.2021	MXN	4.268	207	0	(7)	(0,02)
	07.2021	\$	332	€ 279	0	(2)	(0,01)
	07.2021		556	ILS 1.805	0	(2)	(0,01)
	07.2021		61	TRY 519	0	(1)	(0,01)
	08.2021	COP	194.936	\$ 52	0	0	0,00
	08.2021	\$	139	CAD 169	0	(3)	(0,01)
	08.2021		68	COP 252.625	1	(1)	0,00
	08.2021		130	RUB 9.759	3	0	0,01
	09.2021	CNY	1.433	\$ 220	0	(1)	0,00
	09.2021	IDR	1.152.815	79	0	0	0,00
	09.2021	MXN	4.609	219	0	(11)	(0,03)
	09.2021	PLN	900	237	0	0	0,00
	09.2021	THB	3.266	103	1	0	0,00
	09.2021	TWD	529	19	0	0	0,00
	09.2021	\$	1.419	CLP 1.043.246	11	0	0,03
	09.2021		368	CNH 2.368	0	(4)	(0,01)
	09.2021		1.270	IDR 18.282.013	0	(24)	(0,08)
	09.2021		3.425	KRW 3.815.908	0	(50)	(0,16)
	09.2021		64	PEN 236	0	(2)	(0,01)
	09.2021		562	PLN 2.134	3	(4)	0,00
	09.2021		130	RUB 9.516	0	(1)	0,00
	11.2021	CNH	2.300	\$ 345	0	(8)	(0,02)
	12.2021	PEN	2.439	659	21	0	0,07
	01.2022	BRL	302	53	0	(6)	(0,02)
	01.2022	\$	309	ILS 1.000	0	(1)	0,00
	02.2022	ZAR	105	\$ 7	0	0	0,00
IND	08.2021	\$	46	CZK 959	0	(1)	(0,01)
	09.2021	MYR	200	\$ 48	0	0	0,00
	09.2021	\$	428	CLP 309.063	0	(4)	(0,01)
	02.2022	ZAR	869	\$ 57	0	(2)	(0,01)
	06.2022	TWD	2.182	82	1	0	0,00
JPM	06.2024	\$	82	TWD 2.110	0	(1)	0,00
	07.2021	MXN	3.452	\$ 170	0	(3)	(0,01)
	07.2021	\$	295	BRL 1.501	4	0	0,01
	07.2021		1.351	CLP 1.008.897	35	0	0,11
	07.2021		187	MXN 3.744	0	0	0,00
	07.2021		998	TRY 8.805	1	0	0,00
	08.2021	CAD	98	\$ 80	1	0	0,00
	08.2021	COP	3.660	1	0	0	0,00
	08.2021	\$	572	CZK 11.932	0	(18)	(0,06)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	08.2021	\$	183 EGP	2.936	\$ 1	0	0,00	
	08.2021		50 UAH	1.378	0	0	0,00	
	08.2021		176 UYU	7.730	0	0	0,00	
	09.2021	CLP	1.008.897 \$	1.349	0	(35)	(0,11)	
	09.2021	INR	6.278	84	0	0	0,00	
	09.2021	TWD	2.455	89	0	0	0,00	
	09.2021	\$	91 RUB	6.635	0	(1)	0,00	
	09.2021		63 ZAR	905	0	0	0,00	
	09.2021	ZAR	599 \$	41	0	0	0,00	
	12.2021	\$	702 PHP	33.886	0	(16)	(0,05)	
	02.2022	ZAR	113 \$	7	0	0	0,00	
MYI	07.2021	BRL	6.807	1.352	1	(6)	(0,02)	
	07.2021	ILS	94	29	0	0	0,00	
	07.2021	\$	109 BRL	568	5	0	0,02	
	07.2021		84 PEN	321	0	0	0,00	
	07.2021		30 RUB	2.273	1	0	0,00	
	08.2021	EGP	1.306 \$	80	0	(2)	(0,01)	
	08.2021	\$	1.348 BRL	6.807	6	(1)	0,01	
	08.2021		260 CZK	5.427	0	(8)	(0,03)	
	08.2021		23 EGP	369	0	0	0,00	
	08.2021		162 HUF	46.355	0	(5)	(0,02)	
	09.2021	HUF	10.295 €	29	0	0	0,00	
	09.2021	MYR	58 \$	14	0	0	0,00	
	09.2021	PLN	634	166	0	0	0,00	
	09.2021	\$	35 KZT	15.054	0	0	0,00	
	09.2021		145 PLN	536	0	(4)	(0,01)	
	10.2021		14 TRY	138	1	0	0,00	
	12.2021		40 BRL	208	0	0	0,00	
	06.2022	MXN	2.098 \$	102	2	0	0,01	
	11.2022	ILS	2.700	840	4	0	0,01	
RYL	09.2021	INR	1.878	25	0	0	0,00	
	09.2021	\$	26 KZT	11.310	0	0	0,00	
	02.2022	ZAR	831 \$	54	0	(3)	(0,01)	
SCX	07.2021	BRL	75	15	0	0	0,00	
	07.2021	€	995	1.217	38	0	0,12	
	07.2021	MYR	3.000	722	0	0	0,00	
	07.2021	PEN	1.371	344	0	(14)	(0,04)	
	07.2021	\$	46 RUB	3.311	0	(1)	0,00	
	08.2021	AUD	203 \$	154	2	0	0,01	
	08.2021	EGP	2.000	123	0	(3)	(0,01)	
	08.2021	\$	178 CZK	3.701	0	(6)	(0,02)	
	08.2021		57 PEN	218	0	0	0,00	
	09.2021		34 CNH	217	0	0	0,00	
	09.2021		146 MYR	603	0	(1)	0,00	
	09.2021		345 PEN	1.371	14	0	0,05	
	09.2021		7 PLN	26	0	0	0,00	
	12.2021		2.605 INR	195.604	0	(26)	(0,08)	
	12.2021		2.544 SGD	3.368	0	(41)	(0,13)	
SOG	07.2021	RUB	1.689 \$	23	0	0	0,00	
	07.2021	\$	71 RUB	5.326	2	0	0,01	
	08.2021		72	5.423	2	0	0,01	
	09.2021	PLN	56 \$	15	0	0	0,00	
	12.2021	PHP	1.432	29	0	0	0,00	
SSB	07.2021	BRL	888	167	0	(10)	(0,03)	
	07.2021	\$	1.058 BRL	5.603	60	0	0,19	
	07.2021		273 PEN	1.050	1	0	0,00	
	09.2021	CNH	227 \$	35	0	0	0,00	
TOR	07.2021	\$	8 €	7	0	0	0,00	
	08.2021	HUF	19.822 \$	66	0	(1)	0,00	
	08.2021	\$	115 CZK	2.400	0	(3)	(0,01)	
	02.2022	ZAR	180 \$	12	0	0	0,00	
UAG	07.2021	RUB	11.595	158	0	0	0,00	
	07.2021	\$	131 BRL	655	1	(1)	0,00	
	07.2021		273 RUB	20.144	4	(2)	0,01	
	08.2021	AUD	179 \$	137	3	0	0,01	
	08.2021	CAD	72	58	0	0	0,00	
	08.2021	CZK	2.616	122	0	0	0,00	
	09.2021	\$	128 RUB	9.401	0	(1)	0,00	
	10.2021	TRY	138 \$	14	0	(1)	0,00	
	06.2022	\$	73 MXN	1.502	0	(1)	0,00	
					\$ 598	\$ (692)	\$ (94)	(0,30)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 110	0,36	
Summe Anlagen						\$ 29.874	96,86	
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 968	3,14	
Nettovermögen						\$ 30.842	100,00	

Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
JPMorgan Structured Products BV	3,550 %	29.12.2021	04.02.2021	\$ 120	\$ 119	0,38
Sunac China Holdings Ltd.	5,950	30.12.2021	11.01.2021	200	200	0,65
				\$ 320	\$ 319	1,03

Barmittel in Höhe von USD 270 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 26.924	\$ 37	\$ 26.961
Investmentfonds	627	2.295	0	2.922
Finanzderivate ⁽³⁾	0	(9)	0	(9)
Summen	\$ 627	\$ 29.210	\$ 37	\$ 29.874

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 22.834	\$ 100	\$ 22.934
Investmentfonds	1.612	1.556	0	3.168
Pensionsgeschäfte	0	7.136	0	7.136
Finanzderivate ⁽³⁾	0	322	0	322
Summen	\$ 1.612	\$ 31.848	\$ 100	\$ 33.560

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 1	\$ 0	\$ 1
BOA	(72)	0	(72)
BPS	(23)	0	(23)
BRC	98	0	98
BSS	(26)	0	(26)
CBK	107	0	107
DUB	4	(40)	(36)
GLM	125	(10)	115
HUS	(83)	0	(83)
IND	(7)	0	(7)
JPM	(21)	0	(21)
MYI	(4)	0	(4)
RYL	(3)	0	(3)
SCX	(39)	0	(39)
SOG	4	0	4
SSB	51	0	51
TOR	(4)	0	(4)
UAG	2	0	2

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	54,53	32,27
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	31,27	36,16
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,62	1,98
Investmentfonds	9,47	9,73
Pensionsgeschäfte	k. A.	21,91
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,39)	(1,07)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,36	2,06

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Argentinien	0,24	0,83
Brasilien	5,83	3,67
Cayman Inseln	2,19	0,69
Chile	k. A.	4,36
China	0,66	0,63
Kolumbien	4,02	3,21
Tschechische Republik	5,33	k. A.
Dominikanische Republik	2,05	2,73
Ägypten	0,65	1,24
Frankreich	0,11	0,11
Ghana	0,64	0,54
Hongkong	k. A.	1,24
Ungarn	0,39	0,23
Indien	1,32	0,63
Irland	1,15	k. A.
Israel	10,69	2,64
Italien	0,39	0,38
Luxemburg	0,69	0,94
Malaysia	3,44	k. A.
Mauritius	0,70	0,67
Mexiko	0,35	0,47
Nigeria	0,17	k. A.
Peru	1,20	2,17
Katar	0,40	0,39
Russland	0,15	0,16
Saudi-Arabien	0,65	k. A.
Serbien	0,21	0,20
Singapur	0,66	k. A.
Südafrika	3,92	4,99
Supranational	k. A.	0,62
Uganda	0,45	k. A.
Ukraine	0,85	0,31
Großbritannien	k. A.	0,43
USA	7,93	7,52
Uruguay	k. A.	0,24
Kurzfristige Instrumente	29,99	28,17
Investmentfonds	9,47	9,73
Pensionsgeschäfte	k. A.	21,91
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	(0,39)	(1,07)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,19	0,11
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Devisenoptionen	(0,20)	(0,07)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	0,03
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Cross-Currency Swaps	0,57	0,59
Zinsswaps	0,00	0,00
Volatilitätsswaps	0,10	0,02
Devisenterminkontrakte	(0,30)	1,37
Sonstige Aktiva und Passiva	3,14	(3,04)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO ESG Income Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS					
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				INDUSTRIEWERTE				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN								
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				US-SCHATZPAPIERE				US-SCHATZPAPIERE								
BANKEN UND FINANZEN				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				US-SCHATZPAPIERE								
Acef Holding S.C.A. 0,750 % fällig am 14.06.2028	€	100	118	1,91	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3,000 % fällig am 01.09.2029	€	100	118	1,91	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.11.2059	\$	199	222	3,60		
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.05.2022 (c)(d)		200	247	4,01	Boise Cascade Co. 4,875 % fällig am 01.07.2030	\$	30	32	0,52	US-SCHATZPAPIERE						
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028		100	117	1,90	Gap, Inc. 8,625 % fällig am 15.05.2025		40	44	0,71	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b) 1,375 % fällig am 15.02.2044			46	63	1,03	
CaixaBank S.A. 0,750 % fällig am 26.05.2028		100	119	1,93	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 8,875 % fällig am 15.05.2027		30	35	0,57	NON-AGENCY-MBS						
1,500 % fällig am 03.12.2026	£	100	139	2,25	Marks & Spencer PLC 4,500 % fällig am 10.07.2027	£	100	148	2,40	1211 Avenue of the Americas Trust 4,280 % fällig am 10.08.2035			100	106	1,72	
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	€	100	119	1,93	NextEra Energy Operating Partners LP 3,875 % fällig am 15.10.2026	\$	30	32	0,52	Banc of America Funding Trust 6,479 % fällig am 25.10.2036			87	86	1,40	
CTP NV 1,250 % fällig am 21.06.2029		100	117	1,90	Nokia Oyj 3,125 % fällig am 15.05.2028	€	100	132	2,14	Liberty Street Trust 4,501 % fällig am 10.02.2036			100	109	1,77	
Cyrusone Europe Finance DAC 1,125 % fällig am 26.05.2028		100	118	1,91	NXP BV 2,500 % fällig am 11.05.2031	\$	50	50	0,81	Residential Accredit Loans, Inc. Trust 0,472 % fällig am 25.12.2036			98	94	1,52	
EQT AB 0,875 % fällig am 14.05.2031		100	118	1,91	Renewable Energy Group, Inc. 5,875 % fällig am 01.06.2028		100	105	1,70	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 0,737 % fällig am 25.04.2035			97	95	1,54	
Equinix, Inc. 2,500 % fällig am 15.05.2031	\$	50	51	0,83	Verallia S.A. 1,625 % fällig am 14.05.2028	€	100	120	1,95	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 2,611 % fällig am 25.11.2036 ^			115	115	1,87	
HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026		25	25	0,41	VeriSign, Inc. 2,700 % fällig am 15.06.2031	\$	100	102	1,66							
3,750 % fällig am 15.09.2030		30	30	0,49	Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	€	100	120	1,95	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE						
Host Hotels & Resorts LP 3,500 % fällig am 15.09.2030		40	42	0,68	Weir Group PLC 2,200 % fällig am 13.05.2026	\$	200	201	3,26	Argent Securities Trust 0,392 % fällig am 25.06.2036			126	100	1,62	
Hudson Pacific Properties LP 3,950 % fällig am 01.11.2027		50	55	0,89					1.269	20,59	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 1,217 % fällig am 25.02.2035			100	100	1,62
KB Kookmin Card Co. Ltd. 1,500 % fällig am 13.05.2026		200	199	3,23	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN								126	103	1,67	
Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032		40	40	0,65	Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031		30	30	0,48	BNC Mortgage Loan Trust 0,452 % fällig am 25.10.2036			126	103	1,67	
NE Property BV 3,375 % fällig am 14.07.2027	€	100	132	2,14	Leeward Renewable Energy Operations LLC 4,250 % fällig am 01.07.2029 (a)		50	51	0,83	Countrywide Asset-Backed Certificates 0,232 % fällig am 25.06.2047 ^			89	85	1,38	
OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027	\$	26	26	0,42	Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031		50	50	0,81	GSAMP Trust 0,992 % fällig am 25.11.2035 ^			100	98	1,59	
Starwood Property Trust, Inc. 3,625 % fällig am 15.07.2026 (a)		30	30	0,49	TerraForm Power Operating LLC 4,250 % fällig am 31.01.2023		30	31	0,50	Structured Asset Securities Corp. Trust 6,762 % fällig am 25.05.2031			96	91	1,48	
ZF Finance GmbH 2,000 % fällig am 06.05.2027	€	100	120	1,95	Vodafone Group PLC 5,125 % fällig am 04.06.2081		13	13	0,21							
				1.962	31,83					207	3,35					
				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel				3.438	55,77							

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	3	\$ 3	0,05
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 3	0,05

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	15.09.2026	£ 180	\$ 0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	\$ 150	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	100	0	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	40	(2)	(0,03)
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 451	(1)	(0,01)
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	360	1	0,01
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	55	0	0,00
					\$ (2)	(0,04)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (2)	(0,04)

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIONEN

DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call – OTC USD versus CAD	CAD 1,265	11.02.2022	25	\$ 0	\$ 0	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015 %	14.07.2021	50	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	14.07.2021	50	0	0	0,00
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	10.08.2021	50	(1)	(1)	(0,02)
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	10.08.2021	50	(1)	0	0,00
							\$ (2)	\$ (1)	(0,02)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	\$ 102,344	05.08.2021	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,609	05.08.2021	200	(1)	(1)	(0,02)
					\$ (1)	\$ (1)	(0,02)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 25	BRL 135	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,03
	07.2021	7	MXN 136	0	0	0	0,00
	08.2021	€ 907	\$ 1.101	26	0	26	0,40
	08.2021	£ 99	140	3	0	3	0,05
	08.2021	\$ 60	CAD 73	0	(1)	(1)	(0,02)
BPS	09.2021	IDR 1.163.729	\$ 81	1	0	1	0,02
	08.2021	£ 2	3	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 50	AUD 64	0	(3)	(3)	(0,03)
BRC	11.2021	50	MXN 1.002	0	0	0	0,00
	08.2021	€ 100	\$ 119	1	0	1	0,01
GLM	07.2021	BRL 215	43	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 20	BRL 101	0	0	0	0,00
	08.2021	43	215	0	0	0	0,00
HUS	02.2022	CAD 6	\$ 5	0	0	0	0,00
	08.2021	€ 311	379	10	0	10	0,16
MSB	08.2021	£ 93	131	3	0	3	0,05
	08.2021	\$ 4	BRL 20	0	0	0	0,00
MYI	07.2021	BRL 20	\$ 4	0	0	0	0,00
	07.2021	€ 1	1	0	0	0	0,00
UAG	08.2021	103	125	3	0	3	0,05
	08.2021	\$ 7	AUD 9	0	0	0	0,00
	08.2021	€ 99	\$ 121	3	0	3	0,05
				\$ 51	\$ (4)	\$ 47	0,77

ABGESICHERTE DEISENTERMIKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Class R AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	AUD 448	\$ 337	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,02
	07.2021	\$ 101	AUD 131	0	(3)	(3)	(0,05)
	08.2021	337	448	0	(1)	(1)	(0,02)
BPS	07.2021	63	81	0	(2)	(2)	(0,03)
MYI	07.2021	AUD 190	\$ 144	1	0	1	0,02
	07.2021	\$ 355	AUD 466	0	(5)	(5)	(0,07)
	08.2021	144	190	0	(1)	(1)	(0,02)
SCX	07.2021	113	151	0	0	0	0,00
SOG	07.2021	266	352	0	(2)	(2)	(0,04)
SSB	07.2021	113	151	0	0	0	0,00
				\$ 2	\$ (14)	\$ (12)	(0,19)

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 201	CHF 180	\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	(0,10)
CBK	07.2021	CHF 172	\$ 187	2	0	2	0,01
	07.2021	\$ 179	CHF 160	0	(6)	(6)	(0,09)
	08.2021	187	172	0	(1)	(1)	(0,01)
MYI	07.2021	175	158	0	(4)	(4)	(0,07)
SSB	07.2021	18	16	0	(1)	(1)	(0,01)
				\$ 2	\$ (19)	\$ (17)	(0,27)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 8	€ 7	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2021	80	65	0	(2)	(2)	(0,04)
BRC	07.2021	90	73	0	(3)	(3)	(0,04)
MYI	07.2021	6	5	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	93	76	0	(3)	(3)	(0,05)
				\$ 0	\$ (8)	\$ (8)	(0,13)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	£ 55	\$ 76	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	07.2021	\$ 85	£ 60	0	(2)	(2)	(0,03)
MYI	07.2021	£ 55	\$ 76	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	63	88	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 85	£ 60	0	(2)	(2)	(0,04)
	08.2021	88	63	0	0	0	0,00
SOG	07.2021	232	164	0	(6)	(6)	(0,09)
SSB	07.2021	£ 118	\$ 163	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 88	£ 63	0	0	0	0,00
UAG	07.2021	85	60	0	(2)	(2)	(0,03)
				\$ 0	\$ (12)	\$ (12)	(0,19)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklasse Institutional SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 112	\$ 84	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2021	\$ 84	SGD 112	0	0	0	0,00
BRC	07.2021	84	112	0	(1)	(1)	(0,02)
MYI	07.2021	SGD 112	\$ 84	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 84	SGD 112	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	84	112	0	(1)	(1)	(0,02)
SOG	07.2021	84	112	0	(1)	(1)	(0,02)
				\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	(0,06)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (7) (0,11)

Summe Anlagen

\$ 4.978 80,76

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 1.186 19,24

Nettovermögen

\$ 6.164 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von USD 61 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 4.984	\$ 0	\$ 4.984
Finanzderivate ⁽³⁾	0	(6)	0	(6)
Summen	\$ 0	\$ 4.978	\$ 0	\$ 4.978

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 20	\$ 0	\$ 20
BPS	(7)	0	(7)
BRC	(3)	0	(3)
CBK	(5)	0	(5)
GLM	(2)	0	(2)
HUS	13	0	13
MYC	(1)	0	(1)
MYI	(6)	0	(6)
SAL	(1)	0	(1)
SCX	(6)	0	(6)
SOG	(9)	0	(9)
SSB	(1)	0	(1)
UAG	1	0	1

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%) ⁽¹⁾
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	46,39	k. A.
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	29,64	k. A.
Sonstige übertragbare Wertpapiere	4,83	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,05	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,04)	k. A.
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,11)	k. A.

⁽¹⁾ Der Low Duration Income Fund wurde am 29. April 2021 aufgelegt.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	% DES			BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS													
				PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS																					
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE																											
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG																											
Hilton Worldwide Finance LLC 1,842 % fällig am 22.06.2026	\$	214	€	179	0,01	1,375 % fällig am 03.09.2026 1,625 % fällig am 20.01.2027 1,750 % fällig am 16.12.2021 2,222 % fällig am 18.09.2024 4,250 % fällig am 14.10.2021	€	7.400	€	7.673	0,27	€	3.400	€	2.897	0,10											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL																											
BANKEN UND FINANZEN																											
Aircastle Ltd. 5,500 % fällig am 15.02.2022		400		347	0,01	Dexia Credit Local S.A. 0,000 % fällig am 29.05.2024 (c) 0,000 % fällig am 21.01.2028 (c) 0,010 % fällig am 22.01.2027 0,500 % fällig am 17.01.2025	€	14.600	14.764	0,53	Metropolitan Life Global Funding 0,900 % fällig am 08.06.2023 Morgan Stanley 0,168 % fällig am 08.11.2022 Nasdaq, Inc. 0,875 % fällig am 13.02.2030	€	9.100	9.120	0,33	5.900	6.001	0,21									
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	€	9.000		9.293	0,33	EUROFIMA 0,010 % fällig am 23.06.2028 Europäische Investitionsbank 0,000 % fällig am 28.09.2028 (c) Europäische Union 0,000 % fällig am 06.07.2026 (b)(c) 0,000 % fällig am 04.07.2029 (c) 0,000 % fällig am 04.07.2031 (c) 0,200 % fällig am 04.06.2036 0,250 % fällig am 22.04.2036 0,300 % fällig am 04.11.2050 0,450 % fällig am 02.05.2046 0,700 % fällig am 06.07.2051 (b) 0,750 % fällig am 04.01.2047	€	4.300	4.313	0,15	Natwest Group PLC 2,000 % fällig am 08.03.2023 2,500 % fällig am 22.03.2023 New York Life Global Funding 2,900 % fällig am 17.01.2024 Nexti SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026 NN Group NV 4,500 % fällig am 15.01.2026 (f)	€	10.300	10.765	0,38	900	913	0,03	10.300	10.765	0,38						
American Tower Corp. 2,250 % fällig am 15.01.2022	\$	300		256	0,01	Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028 Ford Motor Credit Co. LLC 1,068 % fällig am 12.10.2021 1,744 % fällig am 19.07.2024 2,748 % fällig am 14.06.2024 General Motors Financial Co., Inc. 0,012 % fällig am 26.03.2022 Goldman Sachs Group, Inc. 0,084 % fällig am 09.09.2022 0,466 % fällig am 30.04.2024 0,875 % fällig am 21.01.2030	€	8.500	8.565	0,31	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050 1,000 % fällig am 01.10.2053 1,500 % fällig am 01.10.2050 2,000 % fällig am 01.10.2047 2,000 % fällig am 01.10.2050 Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	€	5.000	4.469	0,16	€	9.550	9.520	0,34	€	1.800	1.759	0,06				
Annington Funding PLC 1,650 % fällig am 12.07.2024	€	1.100		1.150	0,04	Fab Sukuk Co. Ltd. 0,000 % fällig am 05.03.2023 Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028 Ford Motor Credit Co. LLC 1,068 % fällig am 12.10.2021 1,744 % fällig am 19.07.2024 2,748 % fällig am 14.06.2024 General Motors Financial Co., Inc. 0,012 % fällig am 26.03.2022 Goldman Sachs Group, Inc. 0,084 % fällig am 09.09.2022 0,466 % fällig am 30.04.2024 0,875 % fällig am 21.01.2030	\$	1.500	1.330	0,05	Nytkredit Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2043 1,000 % fällig am 01.10.2050 1,000 % fällig am 01.10.2053 1,500 % fällig am 01.10.2037 1,500 % fällig am 01.10.2047 1,500 % fällig am 01.10.2050 1,500 % fällig am 01.10.2053 2,000 % fällig am 01.10.2047 2,000 % fällig am 01.10.2050 2,500 % fällig am 01.10.2036 2,500 % fällig am 01.10.2047	€	600	608	0,02	DKK	9.611	1.233	0,04	DKK	935.137	119.984	4,29				
Arroundtown S.A. 2,000 % fällig am 02.11.2026		300		323	0,01	HSBC Holdings PLC 0,162 % fällig am 27.09.2022 2,175 % fällig am 27.06.2023 6,250 % fällig am 23.03.2023 (f)(h) 6,500 % fällig am 20.05.2024	€	2.400	2.039	0,07	Realkredit Danmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050 1,500 % fällig am 01.10.2053 1,500 % fällig am 01.10.2037 1,500 % fällig am 01.10.2047 1,500 % fällig am 01.10.2050 QNB Finance Ltd. 1,176 % fällig am 02.05.2022 RCI Banque S.A. 0,125 % fällig am 14.03.2022	€	400	458	0,02	€	5.700	5.718	0,20	DKK	71	10	0,00				
Atrium European Real Estate Ltd. 3,000 % fällig am 11.09.2025		3.300		3.578	0,13	ING Groep NV 4,875 % fällig am 16.05.2029 (f)(h) JAB Holdings BV 2,000 % fällig am 18.05.2028 2,500 % fällig am 17.04.2027 2,500 % fällig am 25.06.2029 Jyske Realkredit A/S 0,375 % fällig am 01.07.2024 0,375 % fällig am 01.10.2050 1,000 % fällig am 01.10.2037 1,500 % fällig am 01.10.2050 2,000 % fällig am 01.10.2047 2,000 % fällig am 01.10.2050	€	4.200	4.192	0,15	Realkredit Denmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050 1,500 % fällig am 01.10.2053 1,500 % fällig am 01.10.2037 1,500 % fällig am 01.10.2047 1,500 % fällig am 01.10.2050 QNB Finance Ltd. 1,176 % fällig am 02.05.2022 RCI Banque S.A. 0,125 % fällig am 14.03.2022	€	60.697	7.677	0,27	€	26.905	3.439	0,12	€	1.800	1.759	0,06				
Balder Finland Oyj 0,055 % fällig am 14.06.2023		6.400		6.410	0,23	KBC Group NV 4,250 % fällig am 24.10.2025 (f)(h) Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028 (c) 0,000 % fällig am 15.06.2029 (c) 5,000 % fällig am 19.03.2024 LeasePlan Corp. NV 1,000 % fällig am 02.05.2023 1,375 % fällig am 07.03.2024	€	27.200	26.693	0,95	Realkredit Danmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050 1,500 % fällig am 01.10.2053 1,500 % fällig am 01.10.2037 1,500 % fällig am 01.10.2047 1,500 % fällig am 01.10.2050 QNB Finance Ltd. 1,176 % fällig am 02.05.2022 RCI Banque S.A. 0,125 % fällig am 14.03.2022	€	11.135	1.533	0,05	€	7.300	6.187	0,22	€	7.300	7.315	0,26				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h)		1.200		1.299	0,05	Merlin Properties Socimi S.A. 2,375 % fällig am 23.05.2022	€	1.100	1.001	0,04	SMBC Aviation Capital Finance DAC 2,650 % fällig am 15.07.2021 Societe Generale S.A. 1,250 % fällig am 15.02.2024 Standard Chartered PLC 0,750 % fällig am 03.10.2023 Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 0,465 % fällig am 30.05.2024 Temasek Financial Ltd. 0,500 % fällig am 01.03.2022	€	11.135	1.533	0,05	€	7.300	6.187	0,22	€	200	169	0,01				
Banco Santander S.A. 4,375 % fällig am 14.01.2026 (f)(h) 6,250 % fällig am 11.09.2021 (f)(h)		5.200		5.383	0,19		€	1.000	1.013	0,04	UBS AG 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) UBS Group AG 0,157 % fällig am 20.09.2022 1,250 % fällig am 17.04.2025 4,125 % fällig am 24.09.2025 5,750 % fällig am 19.02.2022 (f)(h) UniCredit SpA 1,000 % fällig am 18.01.2023 3,127 % fällig am 03.06.2032 Volkswagen Bank GmbH 1,250 % fällig am 01.08.2022 Volkswagen Financial Services NV 1,875 % fällig am 03.12.2024	€	6.600	6.795	0,24	€	5.700	5.718	0,20	€	5.550	5.036	0,18	€	4.000	4.069	0,15
Bank of America Corp. 0,161 % fällig am 25.04.2024 0,244 % fällig am 04.05.2023		900		906	0,03		€	3.000	3.01	0,01		€	5.550	5.036	0,18	€	4.000	4.069	0,15								
Bank of China Ltd. 0,950 % fällig am 21.09.2023	\$	10.350		8.778	0,31		€	2.400	2.641	0,09		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
Bank of Ireland Group PLC 1,375 % fällig am 29.08.2023	€	4.300		4.435	0,16		€	2.400	2.641	0,09		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h)	\$	15.000		13.800	0,49		€	300	301	0,01		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
Barclays PLC 3,125 % fällig am 17.01.2024 7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(h)	€	8.700		10.691	0,38		€	14.700	14.713	0,53		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 2,200 % fällig am 24.07.2025	€	2.600		2.780	0,10		€	9.000	9.094	0,33		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
CaixaBank S.A. 6,750 % fällig am 13.06.2024 (f)(h)		2.000		2.260	0,08		€	5.600	5.712	0,20		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
China Construction Bank Europe S.A. 0,000 % fällig am 28.06.2024 (c)		12.000		11.993	0,43		€	14.700	14.713	0,53		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
Citigroup, Inc. 0,750 % fällig am 26.10.2023 1,500 % fällig am 24.07.2026 2,700 % fällig am 27.10.2022 4,412 % fällig am 31.03.2031	\$	2.400		2.447	0,09		€	9.000	9.094	0,33		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
Cooperative Rabobank UA 4,625 % fällig am 29.12.2025 (f)(h)	€	3.800		4.182	0,15		€	5.600	5.712	0,20		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031 1,625 % fällig am 23.04.2027 2,125 % fällig am 04.10.2024 2,750 % fällig am 12.05.2026 2,750 % fällig am 22.01.2028	€	6.500		6.349	0,23		€	14.700	14.713	0,53		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
Credit Suisse AG 1,000 % fällig am 07.06.2023 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	€	1.300		1.330	0,05		€	17.741	2.445	0,09		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
Credit Suisse Group AG 4,194 % fällig am 01.04.2031 7,250 % fällig am 12.09.2025 (f)(h) 7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h)	€	2.500		2.374	0,08		€	17.741	2.445	0,09		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	€	3.200		3.189	0,11		€	17.741	2.445	0,09		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
CyrusOne LP 1,450 % fällig am 22.01.2027		5.300		5.409	0,19		€	17.741	2.445	0,09		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
Dell Bank International DAC 0,625 % fällig am 17.10.2022		13.400		13.548	0,48		€	17.741	2.445	0,09		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								
Deutsche Bank AG 0,259 % fällig am 16.05.2022 0,750 % fällig am 17.02.2027 1,250 % fällig am 08.09.2021		7.000		7.031	0,25		€	17.741	2.445	0,09		€	5.700	5.718	0,20	€	4.000	4.069	0,15								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
Vonovia Finance BV 5,000 % fällig am 02.10.2023	\$ 500	€ 459	0,02	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 2,375 % fällig am 24.06.2022	\$ 200	€ 172	0,01	Avon Finance No. 2 PLC 0,949 % fällig am 20.09.2048	€ 6.243	€ 7.297	0,26
Wells Fargo & Co. 1,741 % fällig am 04.05.2030	€ 2.500	2.698	0,10	Syngenta Finance NV 1,875 % fällig am 02.11.2021	€ 900	901	0,03	Banc of America Funding Trust 0,693 % fällig am 20.05.2047	\$ 82	70	0,00
		820.776	29,36	TDI Infrastructure SASU 2,500 % fällig am 07.04.2026	800	869	0,03	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 2,292 % fällig am 25.07.2033	5	5	0,00
				Teleperformance 1,875 % fällig am 02.07.2025	300	320	0,01	2,410 % fällig am 25.10.2035	40	35	0,00
				Tesco PLC 6,125 % fällig am 24.02.2022	€ 75	91	0,00	2,611 % fällig am 25.07.2036	336	208	0,01
				Time Warner Cable LLC 4,000 % fällig am 01.09.2021	\$ 700	590	0,02	3,257 % fällig am 25.08.2035 ^	55	45	0,00
				Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	€ 2.300	2.290	0,08	Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust 2,986 % fällig am 26.12.2046 ^	€ 84	63	0,00
				Virgin Media Secured Finance PLC 5,000 % fällig am 15.04.2027	€ 2.100	2.546	0,09	Bluestep Mortgage Securities DAC 0,188 % fällig am 10.08.2066	€ 568	568	0,02
				Zimmer Biomet Holdings, Inc. 1,414 % fällig am 13.12.2022	€ 3.100	3.172	0,11	Business Mortgage Finance PLC 0,000 % fällig am 15.08.2040	195	195	0,01
				2,750 % fällig am 03.07.2023	€ 3.100	2.656	0,10	Canada Square Funding PLC 1,149 % fällig am 17.10.2051	€ 8.301	9.723	0,35
				3,150 % fällig am 01.04.2022	\$ 3.100	2.656	0,10	Canterbury Finance PLC 1,050 % fällig am 16.05.2057	3.020	3.533	0,13
				3,550 % fällig am 01.04.2025	200	183	0,01	1,219 % fällig am 16.05.2056	110	129	0,01
						114.858	4,11	Chase Mortgage Finance Trust 3,101 % fällig am 25.01.2036	€ 2.943	2.392	0,09
								6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	103	60	0,00
								Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates 0,650 % fällig am 16.01.2057	€ 3.570	4.171	0,15
								Ciel No. 1 PLC 1,134 % fällig am 12.06.2046	2.333	2.729	0,10
								Citigroup Mortgage Loan Trust 2,376 % fällig am 25.03.2034	\$ 2	2	0,00
								2,520 % fällig am 25.11.2035	44	37	0,00
								Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 3,343 % fällig am 25.08.2035 ^	521	447	0,02
								Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates	680	550	0,02
								2,351 % fällig am 25.09.2035 ^			
								Countrywide Alternative Loan Trust 0,302 % fällig am 25.07.2046	159	128	0,00
								0,432 % fällig am 25.11.2036	0	0	0,00
								0,542 % fällig am 25.09.2035 ^	1.690	948	0,03
								0,751 % fällig am 20.11.2035	383	310	0,01
								1,116 % fällig am 25.12.2035	5	4	0,00
								3,288 % fällig am 25.06.2037 ^	77	59	0,00
								5,250 % fällig am 25.06.2035 ^	5	4	0,00
								6,000 % fällig am 25.03.2036 ^	231	134	0,01
								6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	335	204	0,01
								Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0,672 % fällig am 25.04.2035	149	119	0,00
								0,732 % fällig am 25.03.2035	205	154	0,01
								0,832 % fällig am 25.02.2035	191	150	0,01
								2,575 % fällig am 25.04.2035	119	89	0,00
								2,871 % fällig am 20.05.2036 ^	59	51	0,00
								Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 0,282 % fällig am 25.08.2047	3.986	3.190	0,11
								Dilosk RMBS DAC 0,197 % fällig am 20.02.2060	€ 4.301	4.325	0,16
								Durham Mortgages B PLC 0,688 % fällig am 31.03.2054	€ 3.152	3.669	0,13
								Dutch Property Finance BV 0,091 % fällig am 28.04.2051	€ 4.484	4.493	0,16
								0,124 % fällig am 28.07.2058	3.300	3.312	0,12
								European Loan Conduit 1,000 % fällig am 17.02.2030	5.295	5.318	0,19
								Eurosail PLC 0,000 % fällig am 13.03.2045	1.597	1.588	0,06
								0,244 % fällig am 10.12.2044	€ 299	346	0,01
								Feldspar PLC 0,781 % fällig am 15.09.2045	173	201	0,01
								Finsbury Square PLC 0,849 % fällig am 16.03.2070	7.979	9.331	0,33
								1,052 % fällig am 16.06.2069	3.030	3.542	0,13
								1,059 % fällig am 16.12.2069	5.531	6.487	0,23
								1,079 % fällig am 16.09.2069	4.725	5.537	0,20
								1,349 % fällig am 16.06.2070	4.518	5.320	0,19
								First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust 2,933 % fällig am 25.03.2035	\$ 38	25	0,00
								Great Hall Mortgages PLC 0,000 % fällig am 18.03.2039	€ 421	419	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S) €	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S) €	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S) €	% DES NETTO-VERMÖGENS	
0,230 % fällig am 18.06.2038	£ 128	148	0,01	Trinity Square PLC				1,200 % fällig am 21.09.2029				
0,255 % fällig am 18.06.2039	\$ 97	80	0,00	0,899 % fällig am 15.07.2059	£10.100	€	11,786	0,42	Castle Park CLO DAC			
GSR Mortgage Loan Trust				Tudor Rose Mortgages PLC				0,462 % fällig am 15.01.2028	473	474	0,02	
2,927 % fällig am 25.01.2036 ^	6	5	0,00	1,299 % fällig am 20.06.2048	4.389		5,133	0,18	Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC			
HarborView Mortgage Loan Trust				Twin Bridges PLC				0,269 % fällig am 15.12.2029	6.400	6.446	0,23	
2,200 % fällig am 19.05.2033	4	3	0,00	1,299 % fällig am 12.12.2054	6.920		8,169	0,29	Contego CLO BV			
Hawksmoor Mortgages PLC				Uropa Securities PLC				0,770 % fällig am 15.10.2030	3.750	3.751	0,13	
1,099 % fällig am 25.05.2053	£15.564	18.223	0,65	0,284 % fällig am 10.06.2059	506		576	0,02	Contego CLO DAC			
IndyMac Mortgage Loan Trust				0,434 % fällig am 10.06.2059	130		147	0,01	0,640 % fällig am 23.01.2030	4.600	4.591	0,16
0,282 % fällig am 25.09.2046	\$ 733	580	0,02	0,634 % fällig am 10.06.2059	102		116	0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates			
2,836 % fällig am 25.11.2035 ^	102	84	0,00	0,834 % fällig am 10.06.2059	109		124	0,00	0,232 % fällig am 25.06.2035	\$ 5.362	4.271	0,15
Jubilee Place BV				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				0,312 % fällig am 25.06.2047	4.761	3.895	0,14	
0,463 % fällig am 17.10.2057	€ 3.667	3.711	0,13	2,924 % fällig am 25.05.2037 ^	\$ 865		727	0,03	0,352 % fällig am 25.11.2037	2.100	1.659	0,06
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				4,558 % fällig am 25.07.2036	181	155	0,01	
1,149 % fällig am 12.06.2057	£ 3.682	4.327	0,16	0,866 % fällig am 25.02.2047 ^	3.340		2.586	0,09	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
Mansard Mortgages PLC				Wells Fargo Alternative Loan Trust				0,932 % fällig am 25.10.2047	1.700	1.421	0,05	
0,731 % fällig am 15.12.2049	1.500	1.743	0,06	2,705 % fällig am 25.07.2037 ^	43		34	0,00	CVC Cordatus Loan Fund DAC			
Mars SRL								0,650 % fällig am 21.07.2030	€24.200	24.213	0,87	
0,761 % fällig am 25.10.2050	€ 210	211	0,01					0,650 % fällig am 15.10.2031	3.400	3.407	0,12	
MASTR Asset Securitization Trust				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Ellington Loan Acquisition Trust				
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	\$ 125	91	0,00	Accunia European CLO DAC				1,142 % fällig am 25.05.2037	\$ 3.860	3.275	0,12	
Miravet SARL				0,950 % fällig am 15.07.2030	€ 7.300		7,304	0,26	FACT Master S.A.			
0,307 % fällig am 26.05.2065	€ 6.647	6.667	0,24	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				0,000 % fällig am 20.11.2025	€ 2.779	2.777	0,10	
Newgate Funding PLC				0,242 % fällig am 25.07.2036	\$ 566		228	0,01	First Franklin Mortgage Loan Trust			
1,081 % fällig am 15.12.2050	£ 310	357	0,01	AlbaCore EURO CLO DAC				0,252 % fällig am 25.11.2036	\$ 357	298	0,01	
Paragon Mortgages PLC				1,530 % fällig am 18.07.2031	€ 6.000		6,019	0,22	Grosvenor Place CLO BV			
1,099 % fällig am 15.05.2045	3.640	4.276	0,15	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				0,720 % fällig am 30.10.2029	€ 3.300	3.303	0,12	
Polaris PLC				0,797 % fällig am 25.01.2036	\$ 1.882		1,586	0,06	Harvest CLO DAC			
1,300 % fällig am 27.05.2057	7.580	8.905	0,32	Aqueduct European CLO DAC				0,379 % fällig am 15.11.2028	380	380	0,01	
Precise Mortgage Funding PLC				0,640 % fällig am 20.07.2030	€ 5.700		5,709	0,20	0,630 % fällig am 18.11.2029	1.642	1.645	0,06
1,249 % fällig am 12.12.2055	4.100	4.842	0,17	Arbour CLO DAC				0,640 % fällig am 15.10.2031	5.600	5.596	0,20	
Primrose Residential				0,580 % fällig am 15.03.2029	569		569	0,02	0,650 % fällig am 26.06.2030	5.700	5.694	0,20
0,200 % fällig am 24.03.2061	€ 6.758	6.757	0,24	Ares European CLO DAC				0,760 % fällig am 15.07.2031	5.400	5.416	0,19	
Residential Accredited Loans, Inc. Trust				0,660 % fällig am 15.10.2030	4.700		4,697	0,17	0,960 % fällig am 20.10.2031	4.300	4.295	0,15
0,412 % fällig am 25.03.2047	\$ 1.441	1.167	0,04	0,780 % fällig am 15.10.2031	15.300		15,300	0,55	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
0,452 % fällig am 25.07.2036 ^	1.420	640	0,02	Asset-Backed Funding Certificates Trust				0,362 % fällig am 25.07.2036	\$ 98	72	0,00	
0,452 % fällig am 25.06.2046	343	94	0,00	1,092 % fällig am 25.06.2037	\$ 88		69	0,00	Jubilee CLO BV			
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	63	52	0,00	Aurium CLO DAC				0,252 % fällig am 15.12.2029	€ 7.792	7.768	0,28	
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	454	373	0,01	0,670 % fällig am 16.04.2030	€ 6.100		6,100	0,22	0,295 % fällig am 12.07.2028	3.953	3.949	0,14
Residential Asset Securitization Trust				0,680 % fällig am 13.10.2029	4.302		4,305	0,15	Laurelin DAC			
5,750 % fällig am 25.02.2036	1.579	1.263	0,05	Auto ABS French Leases				0,720 % fällig am 20.10.2031	6.000	5.995	0,22	
Residential Mortgage Securities PLC				0,022 % fällig am 28.05.2030	339		339	0,01	Lehman XS Trust			
1,281 % fällig am 20.09.2065	£ 415	484	0,02	0,700 % fällig am 29.06.2033	8.900		9,004	0,32	6,500 % fällig am 25.06.2046	\$ 2.998	2.532	0,09
1,299 % fällig am 20.06.2070	6.170	7.264	0,26	Babson Euro CLO BV				Long Beach Mortgage Loan Trust				
Resloc UK PLC				0,281 % fällig am 25.10.2029	2.703		2,701	0,10	0,392 % fällig am 25.05.2036	2.448	1.413	0,05
0,000 % fällig am 15.12.2043	€ 1.012	985	0,04	Bain Capital Euro DAC				0,392 % fällig am 25.06.2036	5.460	2.905	0,10	
Ripon Mortgages PLC				0,740 % fällig am 20.01.2032	4.800		4,795	0,17	Madison Park Euro Funding DAC			
0,881 % fällig am 20.08.2056	£10.766	12.569	0,45	Barings Euro CLO BV				0,750 % fällig am 15.01.2032	€ 7.900	7.911	0,28	
RMAC PLC				0,680 % fällig am 27.07.2030	2.147		2,149	0,08	Man GLG Euro CLO DAC			
0,784 % fällig am 12.06.2046	204	238	0,01	1,050 % fällig am 27.07.2030	189		190	0,01	0,680 % fällig am 15.10.2030	3.100	3.105	0,11
RMAC Securities PLC				Bavarian Sky S.A.				0,870 % fällig am 15.01.2030	11.394	11.391	0,41	
0,234 % fällig am 12.06.2044	77	87	0,00	0,145 % fällig am 20.05.2027	3.835		3,864	0,14	MASTR Asset-Backed Securities Trust			
0,254 % fällig am 12.06.2044	1.376	1.555	0,06	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				0,242 % fällig am 25.10.2036	\$ 3.301	1.238	0,04	
SapphireOne Mortgages FCT				1,892 % fällig am 25.07.2035	\$ 979		826	0,03	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
0,000 % fällig am 27.06.2061	€ 4.195	4.202	0,15	Black Diamond CLO DAC				0,342 % fällig am 25.07.2036	459	345	0,01	
Silverstone Master Issuer PLC				0,650 % fällig am 03.10.2029	€ 3.054		3,055	0,11	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
0,799 % fällig am 21.01.2070	£ 6.831	8.033	0,29	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				0,232 % fällig am 25.12.2036	3.158	1.628	0,06	
Southern Pacific Financing PLC				0,650 % fällig am 15.07.2030	3.400		3,409	0,12	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
0,264 % fällig am 10.06.2043	25	29	0,00	0,720 % fällig am 15.01.2031	4.600		4,594	0,16	0,242 % fällig am 25.07.2036	689	558	0,02
Southern Pacific Securities PLC				0,910 % fällig am 15.01.2033	2.000		1,988	0,07	0,707 % fällig am 25.02.2036	26	22	0,00
0,384 % fällig am 10.03.2044	958	1.111	0,04	1,050 % fällig am 15.01.2031	100		100	0,00	NovaStar Mortgage Funding Trust			
Storm BV				BNPP AM Euro CLO BV				0,292 % fällig am 25.09.2037	791	656	0,02	
0,062 % fällig am 22.01.2064	€ 1.300	1.304	0,05	0,650 % fällig am 15.10.2031	1.050		1,046	0,04	0,797 % fällig am 25.01.2036	328	276	0,01
Stratton Mortgage Funding PLC				Bumper UK Finance PLC				OAK Hill European Credit Partners DAC				
0,901 % fällig am 25.09.2051	£ 4.800	5.607	0,20	0,550 % fällig am 20.12.2030	£ 4.700		5,489	0,20	0,720 % fällig am 21.02.2030	€33.075	33.116	1,19
0,948 % fällig am 20.07.2060	15.948	18.652	0,67	Cairn CLO BV				Palmer Square European Loan Funding DAC				
0,949 % fällig am 12.03.2052	7.565	8.852	0,32	0,670 % fällig am 20.10.2028	€ 490		492	0,02	0,870 % fällig am 15.02.2030	8.393	8.406	0,30
Structured Asset Mortgage Investments Trust				0,790 % fällig am 25.07.2029	4.930		4,935	0,18	1,150 % fällig am 15.01.2030	5.492	5.511	0,20
0,472 % fällig am 25.06.2036	\$ 96	82	0,00	Carlyle Euro CLO DAC				PCL Funding PLC				
0,593 % fällig am 19.07.2035	5	4	0,00	1,110 % fällig am 15.08.2032	900		900	0,03	1,100 % fällig am 15.09.2024	£ 3.700	4.334	0,16
0,793 % fällig am 19.12.2034	88	74	0,00	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				Penta CLO BV				
0,793 % fällig am 19.02.2035	101	84	0,00	0,730 % fällig am 21.09.2029	537		537	0,02	0,790 % fällig am 04.08.2028	€ 795	796	0,03
1,979 % fällig am 25.02.2036 ^	361	302	0,01	0,750 % fällig am 15.11.2031	4.600		4,580	0,16	Pepper Iberia Unsecured DAC			
Towd Point Mortgage Funding PLC								0,000 % fällig am 07.04.2028	2.232	2.237	0,08	
0,049 % fällig am 20.05.2045	£ 9.299	10.878	0,39					Purple Master Credit Cards				
1,111 % fällig am 20.10.2051	12.732	14.910	0,53					0,147 % fällig am 25.05.2034	6.300	6.368	0,23	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Silver Arrow S.A. 0,145 % fällig am 20.11.2030	€ 4.208	€ 4.217	0,15	0,750 % fällig am 31.07.2022	ILS 5.350	€ 1.395	0,05	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
0,149 % fällig am 15.02.2027	2.473	2.491	0,09	5,500 % fällig am 31.01.2022	€ 63.800	17.047	0,61	COMMERCIAL PAPER			
SLC Student Loan Trust 1,022 % fällig am 25.11.2042	\$ 1.268	1.076	0,04	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,250 % fällig am 15.03.2028	€ 79.900	79.090	2,83	Nomura Bank International PLC (0,375) % fällig am 14.10.2021	€ 8.000	€ 8.009	0,29
SLM Student Loan Trust 0,000 % fällig am 25.10.2039	€ 589	581	0,02	0,400 % fällig am 15.05.2030 (e)	25.450	27.498	0,98	(0,365) % fällig am 15.11.2021	3.600	3.605	0,13
Sorrento Park CLO DAC 0,409 % fällig am 16.11.2027	292	292	0,01	1,300 % fällig am 15.05.2028 (e)	12.546	14.297	0,51	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 0,051 % fällig am 10.09.2021	16.000	16.006	0,57
Soundview Home Loan Trust 0,342 % fällig am 25.10.2036	\$ 6.200	5.097	0,18	2,150 % fällig am 01.03.2072	16.600	16.253	0,58			27.620	0,99
Tikehau CLO BV 0,880 % fällig am 07.12.2029	€ 7.053	7.059	0,25	2,800 % fällig am 01.03.2067	35.500	42.013	1,50	ISRAEL TREASURY BILLS			
Toro European CLO DAC 0,650 % fällig am 15.04.2030	13.500	13.499	0,48	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029 (e)	¥ 3.446.777	26.933	0,96	(0,052) % fällig am 06.10.2021 (c)(d)	ILS 12.000	3.105	0,11
0,900 % fällig am 15.10.2030	8.419	8.431	0,30	Mexico Government International Bond 2,659 % fällig am 24.05.2031	\$ 9.700	8.011	0,29	(0,041) % fällig am 02.03.2022 (c)(d)	9.900	2.562	0,09
Turbo Finance 9 PLC 0,880 % fällig am 20.08.2028	£ 6.100	7.150	0,26	Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050 (c)(i)	€ 8.900	8.267	0,30	(0,034) % fällig am 05.01.2022 (c)(d)	6.100	1.578	0,06
Vendome Funding CLO DAC 1,860 % fällig am 20.07.2031	€ 7.000	7.007	0,25	Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 28.01.2032	7.700	7.805	0,28	(0,031) % fällig am 02.02.2022 (c)(d)	13.600	3.519	0,13
Voya Euro CLO DAC 0,750 % fällig am 15.10.2030	3.200	3.203	0,12	Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 6.900	5.856	0,21	(0,030) % fällig am 02.03.2022 (c)(d)	6.800	1.760	0,06
		372.218	13,32	Slovenia Government International Bond 1,000 % fällig am 06.03.2028	€ 12.200	13.208	0,47	(0,028) % fällig am 30.11.2021 (c)(d)	56.400	14.597	0,52
STAATSEMISSIONEN				5,250 % fällig am 18.02.2024	\$ 21.451	20.333	0,73	(0,020) % fällig am 02.02.2022 (c)(d)	26.200	6.780	0,24
Auckland Council 1,000 % fällig am 19.01.2027	1.300	1.383	0,05	South Korea Government International Bond 0,000 % fällig am 16.09.2025 (c)	€ 4.400	4.429	0,16	(0,020) % fällig am 02.03.2022 (c)(d)	8.000	2.070	0,08
Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035	1.600	2.128	0,08	Spain Government International Bond 0,000 % fällig am 31.05.2024 (c)	260	263	0,01	0,000 % fällig am 06.04.2022 (c)(d)	25.000	6.469	0,23
4,900 % fällig am 15.09.2021	12.700	12.833	0,46	0,500 % fällig am 31.10.2031	13.400	13.428	0,48	0,010 % fällig am 02.03.2022 (c)(d)	13.300	3.441	0,12
Belgium Government International Bond 1,600 % fällig am 22.06.2047	18.000	21.269	0,76	0,800 % fällig am 30.07.2027	23.500	24.731	0,88			45.881	1,64
Caisse Francaise de Financement Local 0,000 % fällig am 25.02.2025	9.600	9.651	0,35	1,000 % fällig am 31.10.2050	14.200	12.845	0,46	Summe kurzfristige Instrumente		73.500	2,63
Export-Import Bank of China 0,300 % fällig am 06.03.2022	4.000	4.010	0,14	1,250 % fällig am 31.10.2030	23.600	25.563	0,91	Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 2.527.477	90,41	
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.05.2072	6.700	5.181	0,19	1,400 % fällig am 30.04.2028	10.600	11.586	0,41				
0,750 % fällig am 25.05.2052	26.900	25.720	0,92	1,400 % fällig am 30.07.2028	58.900	64.482	2,31	AKTIEN			
Israel Government International Bond 0,000 % fällig am 22.07.2022 (c)	14.300	14.347	0,51	1,450 % fällig am 31.10.2027	52.800	57.784	2,07	INVESTMENTFONDS			
0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS 92.700	23.989	0,86	1,450 % fällig am 30.04.2029	23.300	25.650	0,92	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
				1,450 % fällig am 31.10.2071	8.450	7.457	0,27	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (g)	2.271.000	222.034	7,94
				1,950 % fällig am 30.04.2026	28.300	31.316	1,12	Summe Investmentfonds	€ 222.034	7,94	
				2,150 % fällig am 31.10.2025	80.100	88.745	3,17				
						776.796	27,79				
				VORZUGSWERTPAPIERE							
				Nationwide Building Society 10,250 %	9.139	2.002	0,07				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
RYL	(1,000) %	30.06.2021	01.07.2021	€ 8.500	Austria Government International Bond 2,100 % fällig am 20.09.2117	€ (8.525)	€ 8.500	€ 8.500	0,30
				5.600	European Union 0,000 % fällig am 04.07.2031	(5.618)	5.600	5.600	0,20
Summe Pensionsgeschäfte						€ (14.143)	€ 14.100	€ 14.100	0,50

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)**

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	407	€ (371)	(0,01)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 171,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	08.2021	198	(71)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2021	2.962	382	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	946	2.191	0,08
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	777	613	0,02
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	301	1.117	0,04
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	2.657	1.654	0,06
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	546	2	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	33	(50)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	407	464	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Bond Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 171,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	08.2021	198	€ 162	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2021	731	189	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	1.942	(460)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	1.227	888	0,03
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	323	(532)	(0,02)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	52	205	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	707	(5.497)	(0,20)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	825	(978)	(0,04)
				€ (92)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (92)	0,00

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.12.2027	€ 100	€ 1	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2022	\$ 200	(20)	0,00
				€ (19)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 700	€ 1	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	2.800	7	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 1.300	3	0,00
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	2.500	3	0,00
				€ 14	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2031	£ 35.600	€ 109	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	300	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2036	€ 20.400	215	0,01
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	4.100	(8)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	5.200	(48)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	124.100	(152)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	28.500	(699)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,165	19.01.2022	\$ 23.800	(528)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,180	19.01.2022	8.400	(185)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,200	21.01.2022	22.800	(499)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	3,400	15.12.2024	£ 105.500	901	0,03
Zahlung	UKRPI	3,473	15.08.2025	24.200	(255)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	34.600	(475)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	3,513	15.12.2029	19.200	32	0,00
					€ (1.593)	(0,06)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ (1.598)	(0,06)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,195 %	02.11.2022	11.660	€ 7	€ 1.444	0,05
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	14.640	943	1.810	0,07
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	10.600	990	1.862	0,07
BRC	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	6.760	426	836	0,03
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,009	10.03.2022	12.100	953	664	0,03
GLM	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,009	10.03.2022	12.100	798	664	0,02
JPM	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	8.500	773	1.493	0,05
MYC	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,007	24.08.2021	147.300	438	53	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	11.200	702	1.398	0,05
							€ 6.030	€ 10.224	0,37

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	3.800	€ 18	€ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	1.800	14	6	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	6.000	28	19	0,00
					€ 60	€ 25	0,00

VERKAUFSoPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONEN AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.08.2021	9.200	€ (7)	€ (2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	11.000	(10)	(1)	0,00
BPS	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	11.600	(11)	(2)	0,00
BRC	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	7.800	(5)	(5)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	7.800	(8)	(2)	0,00
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	5.900	(3)	(3)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	5.900	(7)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	13.200	(12)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	9.800	(9)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	40.900	(46)	(10)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	16.200	(15)	(3)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	12.000	(11)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	5.700	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	17.100	(15)	(9)	0,00
CBK	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	7.000	(6)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	9.200	(7)	(2)	0,00
DUB	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	21.800	(14)	(13)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	21.800	(22)	(6)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	43.900	(37)	(9)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	14.100	(13)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	20.000	(18)	(3)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	14.300	(15)	(5)	0,00
FBF	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	4.000	(3)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	9.600	(8)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	14.000	(12)	(3)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	8.600	(7)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	7.500	(6)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	8.600	(7)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	9.900	(11)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	12.900	(11)	(1)	0,00
						€ (361)	€ (92)	0,00

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call – OTC USD versus CAD	CAD 1,265	11.02.2022	505	€ (4)	€ (5)	0,00
GLM	Call – OTC USD versus CAD	1,265	11.02.2022	17.897	(161)	(187)	(0,01)
					€ (165)	€ (192)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Bond Fund (Forts.)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variable Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,002 %	26.05.2023	226.100 €	(970) €	(802)	(0,03)
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,002	26.05.2023	226.100	(971)	(755)	(0,03)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	35.000	0	(1.324)	(0,05)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	43.990	(923)	(1.671)	(0,06)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	31.800	(967)	(1.823)	(0,07)
BRC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	20.310	(420)	(772)	(0,03)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,008	10.03.2022	32.700	(947)	(697)	(0,02)
DUB	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	32.470	(188)	(17)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	248.200	(325)	(99)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,008	10.03.2022	32.800	(791)	(699)	(0,02)
JPM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	500	(3)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	25.500	(760)	(1.462)	(0,05)
MYC	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,006	24.08.2021	294.600	(383)	(21)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	2.900	(18)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	44.530	(267)	(24)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	33.600	(700)	(1.271)	(0,05)
RYL	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,001	24.03.2022	657.300	(890)	(149)	(0,01)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,001	24.03.2022	657.300	(890)	(1.211)	(0,04)
							€ (10.413)	€ (12.797)	(0,46)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GSC	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,227	07.07.2021	1.700	€ (7)	€ (2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,023	07.09.2021	5.400	(28)	(17)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,023	07.09.2021	5.400	(20)	(25)	0,00
JPM	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	10.500	(29)	(15)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	3.600	(18)	(6)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,047	07.07.2021	3.300	(10)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	104,047	07.07.2021	3.300	(5)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	12.000	(31)	(14)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	3.500	(5)	(5)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,695	07.09.2021	3.200	(8)	(4)	0,00
					€ (161)	€ (88)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	\$ 200	€ (8)	€ 8	€ 0	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	21.500	(839)	735	(104)	0,00
					€ (847)	€ 743	€ (104)	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2021	€	860 £	739	€ 0	€ 0	0,00
	08.2021	\$	5 RUB	370	0	0	0,00
	08.2021		25 SEK	217	0	0	0,00
	09.2021	CNY	12.677 \$	1.971	16	16	0,00
	09.2021	PLN	62	16	0	0	0,00
	09.2021	\$	14 RUB	1.028	0	0	0,00
	04.2022	DKK	801.916 €	107.784	0	(32)	0,00
BPS	07.2021	€	21.768 \$	26.375	472	0	0,02
	07.2021	\$	3.261 €	2.740	0	(10)	0,00
	08.2021	€	1.093 £	947	9	9	0,00
	11.2021	ILS	8.803 \$	2.710	3	3	0,00
	02.2022	CAD	127	105	2	2	0,00
	04.2022	€	1.055 DKK	7.850	0	0	0,00
BRC	08.2021		1.155 £	990	0	(2)	0,00
	08.2021	¥	3.550.300 €	26.761	0	(198)	(0,01)
	09.2021	PLN	41 \$	11	0	0	0,00
	04.2022	DKK	44.600 €	5.993	0	(4)	0,00
	07.2022		143.225	19.248	0	(6)	0,00
CBK	07.2021	\$	4 RUB	282	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	08.2021	£	675	€	783	€	0	0,00
	08.2021	\$	434	MXN	9.083	€	17	0,00
	08.2021		4	RUB	337	€	0	0,00
	10.2021	ILS	12.004	\$	3.629	€	(50)	0,00
	11.2021		132.933		40.577	€	(283)	(0,01)
	01.2022		38.648		12.005	€	103	0,00
	02.2022		39.112		11.994	€	(63)	0,00
	03.2022		31.204		9.499	€	(96)	0,00
	04.2022	€	6.545	DKK	48.680	€	0	0,00
	04.2022	ILS	25.000	\$	7.637	€	(58)	0,00
	08.2022		4.869		1.473	€	(26)	0,00
GLM	07.2021	€	2.838		3.366	€	0	0,00
	07.2021	\$	7	RUB	566	€	0	0,00
	08.2021	AUD	20.917	€	13.280	€	48	0,00
	08.2021	€	25.197	NOK	255.310	€	(196)	(0,01)
	08.2021	£	256.050	€	297.994	€	(32)	0,00
	08.2021	NOK	123.755		12.166	€	47	0,00
	08.2021	NZD	46.400		27.457	€	148	0,01
	08.2021	SEK	144.995		14.318	€	(3)	0,00
	08.2021	\$	1.173	NZD	1.670	€	(6)	0,00
	08.2021		6	RUB	471	€	0	0,00
	08.2021		7.692	SEK	66.738	€	96	0,00
	09.2021	PLN	65	\$	17	€	0	0,00
	09.2021	\$	11	RUB	791	€	0	0,00
	02.2022	CAD	4.360	\$	3.605	€	71	0,00
HUS	03.2022	ILS	6.802		2.070	€	(21)	0,00
	08.2021	CHF	7.288	€	6.664	€	13	0,00
	08.2021	€	26.095	AUD	40.934	€	(200)	(0,01)
	08.2021	\$	10	RUB	760	€	0	0,00
	09.2021	KRW	174.417	\$	157	€	2	0,00
	09.2021	PLN	74		19	€	0	0,00
	09.2021	\$	17.699	CNH	113.742	€	(152)	(0,01)
	09.2021		15.643	IDR	225.185.683	€	(246)	(0,01)
	09.2021		7	RUB	541	€	0	0,00
	01.2022	ILS	29.761	\$	9.110	€	(55)	0,00
	04.2022	DKK	1.055.986	€	141.913	€	(63)	0,00
JPM	04.2022	€	2.589	DKK	19.265	€	2	0,00
	07.2021		3.711	\$	4.542	€	119	0,01
	07.2021	\$	799	ILS	2.594	€	(2)	0,00
	08.2021	CAD	19.361	€	13.099	€	(74)	0,00
	08.2021	€	1.235	£	1.057	€	(5)	0,00
	08.2021	£	929	€	1.086	€	5	0,00
	08.2021	\$	31.372	NZD	44.651	€	(147)	(0,01)
	08.2021		24.182	SEK	209.402	€	263	0,01
	11.2021	ILS	9.703	\$	2.997	€	11	0,00
	01.2022		6.016		1.851	€	(1)	0,00
	04.2022	DKK	98.166	€	13.196	€	(2)	0,00
	04.2022	€	12.588	DKK	93.655	€	4	0,00
	07.2022		18.813		139.900	€	(6)	0,00
MYI	08.2022	ILS	558	\$	172	€	0	0,00
	07.2021	€	8.473		10.194	€	123	0,00
	07.2021	\$	4	RUB	278	€	0	0,00
	08.2021	€	25.600	CAD	37.748	€	82	0,00
	08.2021		2.190	£	1.883	€	2	0,00
	04.2022	DKK	21.085	€	2.834	€	(1)	0,00
RBC	08.2021	CAD	4.926		3.340	€	(11)	0,00
	08.2021	€	2.663	£	2.296	€	9	0,00
RYL	07.2022		447	DKK	3.325	€	0	0,00
SCX	07.2021	\$	447.852	€	366.081	€	(11.567)	(0,41)
	08.2021	£	18.515		21.516	€	(35)	0,00
SOG	07.2021	\$	4	RUB	322	€	0	0,00
	08.2021		6		422	€	0	0,00
SSB	08.2021	€	6.654	CHF	7.247	€	(41)	0,00
UAG	07.2021	\$	12	RUB	913	€	0	0,00
	08.2021	€	2.211	£	1.900	€	0	0,00
						€	1.757	
						€	(13.709)	
						€	(11.952)	
								(0,43)

ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BRC	07.2021	€	16.479	CHF	18.112	€	44	0,00
CBK	07.2021		93.363		102.259	€	0	0,00
HUS	07.2021		96.503		105.645	€	(77)	0,00
JPM	07.2021	CHF	112.009	€	102.206	€	(128)	(0,01)
	08.2021	€	102.226	CHF	112.009	€	25	0,00
RBC	07.2021		4		4	€	0	0,00
SSB	07.2021	CHF	362	€	330	€	(26)	0,00
						€	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
UAG	07.2021 07.2021	€ 98.992 76	CHF 108.495 83	€ 0 0	€ (17) 0	€ (17) 0	0,00 0,00
				€ 69	€ (248)	€ (179)	(0,01)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ (15.155)	(0,54)
Summe Anlagen						€ 2.746.766	98,25
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 48.935	1,75
Nettovermögen						€ 2.795.701	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 8.266 und Barmittel in Höhe von EUR 6.669 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 27.299 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 2.527.477	€ 0	€ 2.527.477
Investmentfonds	0	222.034	0	222.034
Pensionsgeschäfte	0	14.100	0	14.100
Finanzderivate ⁽³⁾	5.115	(21.960)	0	(16.845)
Summen	€ 5.115	€ 2.741.651	€ 0	€ 2.746.766

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 3.215.431	€ 18.384	€ 3.233.815
Investmentfonds	43.025	273.839	0	316.864
Pensionsgeschäfte	0	147.655	0	147.655
Finanzderivate ⁽³⁾	1.291	14.271	(11)	15.551
Summen	€ 44.316	€ 3.651.196	€ 18.373	€ 3.713.885

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	€ (19)	€ 0	€ (19)
BPS	(790)	1.000	210
BRC	(172)	77	(95)
CBK	(503)	602	99
DUB	(55)	230	175
FBF	(6)	0	(6)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
GLM	€ (137)	€ (260)	€ (397)
GSC	(44)	0	(44)
GST	(107)	99	(8)
HUS	(817)	910	93
JPM	176	(460)	(284)
MYC	135	(1.270)	(1.135)
MYI	206	0	206
RBC	(2)	0	(2)
RYL	(1.360)	1.466	106
SCX	(11.602)	10.471	(1.131)
SSB	(58)	0	(58)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,10	75,39
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	6,10	23,55
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,21	0,76
Investmentfonds	7,94	9,77
Pensionsgeschäfte	0,50	4,55
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,06)	0,18
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,54)	0,26

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,01	0,01
Unternehmensanleihen und Wechsel	34,36	32,91
US-Regierungsbehörden	0,24	15,12
US-Schatzobligationen	1,84	1,43
Non-Agency-MBS	10,15	8,77
Forderungsbesicherte Wertpapiere	13,32	12,56
Staatsemissionen	27,79	24,20
Vorzugswertpapiere	0,07	0,06
Kurzfristige Instrumente	2,63	4,64
Investmentfonds	7,94	9,77
Pensionsgeschäfte	0,50	4,55
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,00	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,06)	0,18
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	0,37	0,23
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Devisenoptionen	(0,01)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,46)	(0,21)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,43)	0,27
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,01)	0,00
Sonstige Aktiva und Passiva	1,75	(14,50)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Credit Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG											
Altice France S.A. 3,000 % fällig am 02.02.2026	€ 4.851	€ 4.783	0,47	Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 1.100	€ 1.091	0,11	FCE Bank PLC 0,869 % fällig am 13.09.2021	€ 2.100	€ 2.103	0,20
4,155 % fällig am 14.08.2026	\$ 489	412	0,04	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 1,250 % fällig am 26.04.2027	5.800	5.933	0,57	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 07.12.2022	1.100	1.095	0,11
Charter Communications Operating LLC 1,860 % fällig am 01.02.2027	3.351	2.807	0,27	BMW International Investment BV 0,750 % fällig am 08.03.2024	£ 500	585	0,06	0,157 % fällig am 01.12.2024	200	195	0,02
Dell International LLC 2,000 % fällig am 19.09.2025	746	630	0,06	BNP Paribas S.A. 0,250 % fällig am 13.04.2027	€ 9.000	8.944	0,87	2,386 % fällig am 17.02.2026	1.400	1.456	0,14
Hilton Worldwide Finance LLC 1,842 % fällig am 22.06.2026	3.240	2.713	0,26	0,500 % fällig am 04.06.2026	5.400	5.486	0,53	3,021 % fällig am 06.03.2024	300	315	0,03
INEOS Finance PLC 2,500 % fällig am 01.04.2024	€ 4.749	4.729	0,46	1,323 % fällig am 13.01.2027	\$ 700	584	0,06	3,550 % fällig am 07.10.2022	\$ 3.000	2.601	0,25
				2,125 % fällig am 23.01.2027	€ 1.600	1.728	0,17	5,596 % fällig am 07.01.2022	500	431	0,04
				4,400 % fällig am 14.08.2028	\$ 1.000	973	0,09	GA Global Funding Trust 1,625 % fällig am 15.01.2026	200	171	0,02
				4,705 % fällig am 10.01.2025	16.300	15.006	1,45	General Motors Financial Co., Inc. 0,012 % fällig am 26.03.2022	€ 500	501	0,05
				BPCE S.A. 0,500 % fällig am 15.09.2027	€ 8.400	8.440	0,82	2,200 % fällig am 01.04.2024	600	634	0,06
				1,000 % fällig am 01.04.2025	8.900	9.206	0,89	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,875 % fällig am 20.06.2022	3.300	3.389	0,33
		16.074	1,56	CA Immobilien Anlagen AG 0,875 % fällig am 05.02.2027	900	906	0,09	3,000 % fällig am 29.03.2025	2.400	2.583	0,25
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
BANKEN UND FINANZEN											
Acef Holding S.C.A. 0,750 % fällig am 14.06.2028	400	399	0,04	1,000 % fällig am 27.10.2025	700	716	0,07	Goldman Sachs Group, Inc. 0,082 % fällig am 26.09.2023	2.000	2.006	0,19
ADLER Group S.A. 2,750 % fällig am 13.11.2026	800	812	0,08	CaixaBank S.A. 0,750 % fällig am 10.07.2026	4.600	4.702	0,46	1,375 % fällig am 15.05.2024	18.700	19.198	1,86
AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % fällig am 14.08.2024	\$ 1.800	1.588	0,15	CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % fällig am 21.01.2028	500	496	0,05	2,000 % fällig am 27.07.2023	5.600	5.846	0,57
AIB Group PLC 1,500 % fällig am 29.03.2023	€ 1.500	1.542	0,15	CIMIC Finance Ltd. 1,500 % fällig am 28.05.2029	2.800	2.847	0,28	2,125 % fällig am 30.09.2024	3.200	3.416	0,33
alstria office REIT-AG 1,500 % fällig am 23.06.2026	2.800	2.942	0,28	Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,125 % fällig am 22.10.2023	\$ 1.500	1.273	0,12	Guardian Life Global Funding 1,100 % fällig am 23.06.2025	\$ 100	85	0,01
Altarea S.C.A. 1,875 % fällig am 17.01.2028	7.200	7.465	0,72	4,750 % fällig am 17.01.2023	200	173	0,02	Hamburg Commercial Bank AG 0,750 % fällig am 23.11.2023	€ 3.400	3.437	0,33
AMCO – Asset Management Co. SpA 2,625 % fällig am 13.02.2024	5.500	5.873	0,57	CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	€ 1.900	1.856	0,18	HSBC Holdings PLC 0,309 % fällig am 13.11.2026	100	100	0,01
American Tower Corp. 0,875 % fällig am 21.05.2029	3.600	3.633	0,35	1,625 % fällig am 23.04.2027	700	721	0,07	1,589 % fällig am 24.05.2027	\$ 6.500	5.496	0,53
1,000 % fällig am 15.01.2032	1.500	1.507	0,15	2,750 % fällig am 12.05.2026	800	872	0,08	3,973 % fällig am 22.05.2030	9.700	9.162	0,89
Annington Funding PLC 1,650 % fällig am 12.07.2024	400	418	0,04	4,750 % fällig am 08.03.2023	\$ 4.300	3.874	0,38	4,292 % fällig am 12.09.2026	1.700	1.596	0,15
Aroundtown S.A. 0,000 % fällig am 16.07.2026 (a)	1.500	1.466	0,14	Credit Agricole S.A. 1,907 % fällig am 16.06.2026	3.200	2.753	0,27	Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023	4.000	2.572	0,25
0,375 % fällig am 23.09.2022	2.800	2.817	0,27	Credit Suisse Group AG 1,250 % fällig am 17.07.2025	€ 8.500	8.731	0,85	IMMOFINANZ AG 2,625 % fällig am 27.01.2023	€ 2.000	2.063	0,20
1,500 % fällig am 28.05.2026	5.000	5.260	0,51	2,997 % fällig am 14.12.2023	\$ 3.150	2.744	0,27	ING Groep NV 3,000 % fällig am 18.02.2026	€ 4.400	5.550	0,54
2,000 % fällig am 02.11.2026	3.700	3.980	0,39	3,091 % fällig am 14.05.2032	5.700	4.962	0,48	Intesa Sanpaolo SpA 3,125 % fällig am 14.07.2022	\$ 7.100	6.144	0,60
3,250 % fällig am 18.07.2027	£ 400	508	0,05	3,869 % fällig am 12.01.2029	2.100	1.952	0,19	4,000 % fällig am 23.09.2029	1.400	1.297	0,13
ASR Nederland NV 5,000 % fällig am 30.09.2024 (c)	€ 1.700	1.935	0,19	4,194 % fällig am 10.04.2031	400	379	0,04	5,710 % fällig am 15.01.2026	2.800	2.672	0,26
Atrium European Real Estate Ltd. 3,000 % fällig am 11.09.2025	2.800	3.036	0,29	4,282 % fällig am 09.01.2028	6.000	5.632	0,55	JAB Holdings BV 1,625 % fällig am 30.04.2025	€ 4.200	4.432	0,43
3,625 % fällig am 17.10.2022	1.900	1.966	0,19	Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 5.200	5.398	0,52	1,750 % fällig am 25.06.2026	1.100	1.176	0,11
Atrium Finance Issuer BV 2,625 % fällig am 05.09.2027	300	325	0,03	CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	3.500	3.488	0,34	JPMorgan Chase & Co. 2,750 % fällig am 24.08.2022	1.700	1.762	0,17
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025	\$ 800	695	0,07	1,250 % fällig am 21.06.2029	1.100	1.088	0,11	4,203 % fällig am 23.07.2029	\$ 6.200	6.013	0,58
3,950 % fällig am 01.07.2024	100	90	0,01	Cyrusone Europe Finance DAC 1,125 % fällig am 26.05.2028	800	796	0,08	Jyske Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK 9.436	1.211	0,12
Balder Finland Oyj 1,000 % fällig am 20.01.2029	€ 2.400	2.366	0,23	CyrusOne LP 1,450 % fällig am 22.01.2027	200	204	0,02	1,000 % fällig am 01.10.2050	60.627	7.823	0,76
1,375 % fällig am 24.05.2030	1.800	1.800	0,17	Deutsche Bank AG 0,750 % fällig am 17.02.2027	4.600	4.632	0,45	1,500 % fällig am 01.10.2037	44.655	5.681	0,55
Banca Carige SpA 0,957 % fällig am 25.05.2022	1.800	1.808	0,18	1,000 % fällig am 19.11.2025	100	102	0,01	1,500 % fällig am 01.10.2050	329	46	0,00
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % fällig am 28.04.2025	4.800	4.884	0,47	1,375 % fällig am 03.09.2026	1.500	1.524	0,15	Kojamo Oyj 1,500 % fällig am 19.06.2024	€ 500	519	0,05
3,625 % fällig am 24.09.2024	300	313	0,03	1,625 % fällig am 20.01.2027	5.900	6.208	0,60	LeasePlan Corp. NV 0,750 % fällig am 03.10.2022	3.500	3.543	0,34
Banco de Sabadell S.A. 1,125 % fällig am 27.03.2025	100	102	0,01	1,750 % fällig am 17.01.2028	600	636	0,06	1,000 % fällig am 02.05.2023	7.400	7.564	0,73
1,125 % fällig am 11.03.2027	700	720	0,07	1,875 % fällig am 22.12.2028	€ 300	349	0,03	Liberty Mutual Finance Europe DAC 1,750 % fällig am 27.03.2024	400	418	0,04
1,750 % fällig am 29.06.2023	1.100	1.120	0,11	2,129 % fällig am 24.11.2026 (f)	\$ 400	342	0,03	Lloyds Banking Group PLC 1,875 % fällig am 15.01.2026	€ 3.500	4.179	0,40
Bank of America Corp. 0,808 % fällig am 09.05.2026	600	617	0,06	2,222 % fällig am 18.09.2024	€ 2.700	2.339	0,23	2,250 % fällig am 16.10.2024	5.100	6.191	0,60
1,776 % fällig am 04.05.2027	1.000	1.077	0,10	2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 2.000	2.194	0,21	3,500 % fällig am 01.04.2026	€ 100	113	0,01
Bank of China Ltd. 0,884 % fällig am 24.06.2023	\$ 2.800	2.376	0,23	2,625 % fällig am 12.02.2026	€ 2.000	2.194	0,21	Logicor Financing SARL 2,250 % fällig am 13.05.2025	8.100	8.688	0,84
Bank of Ireland Group PLC 1,000 % fällig am 25.11.2025	€ 2.600	2.673	0,26	3,035 % fällig am 28.05.2032 (f)	\$ 200	172	0,02	3,250 % fällig am 13.11.2028	2.500	2.911	0,28
1,375 % fällig am 29.08.2023	2.600	2.682	0,26	3,547 % fällig am 18.09.2031	3.500	3.145	0,30	Merlin Properties Socimi S.A. 1,375 % fällig am 01.06.2030	2.100	2.087	0,20
Barclays PLC 2,375 % fällig am 06.10.2023	£ 3.000	3.572	0,35	3,700 % fällig am 30.05.2024	400	362	0,04	1,750 % fällig am 26.05.2025	2.800	2.956	0,29
3,125 % fällig am 17.01.2024	6.600	8.111	0,79	Digital Euro Finco LLC 2,625 % fällig am 15.04.2024	€ 2.600	2.784	0,27	2,375 % fällig am 13.07.2027	2.500	2.731	0,26
3,375 % fällig am 02.04.2025	€ 1.400	1.526	0,15	Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust 5,125 % fällig am 30.11.2024	\$ 167	142	0,01	Metropolitan Life Global Funding 0,375 % fällig am 09.04.2024	6.600	6.704	0,65
				Equitable Financial Life Global Funding 0,600 % fällig am 16.06.2028	€ 3.900	3.914	0,38	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,013 % fällig am 30.05.2023	784	791	0,08
				Euroclear Bank S.A. 0,125 % fällig am 07.07.2025	2.200	2.216	0,21	0,680 % fällig am 26.01.2023	1.700	1.726	0,17
				0,500 % fällig am 10.07.2023	600	609	0,06	0,980 % fällig am 09.10.2023	1.100	1.130	0,11
				Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	7.100	7.812	0,76				

BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES		
	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS		PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS		PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
Morgan Stanley				UniCredit SpA				DAE Funding LLC			
1,000 % fällig am 02.12.2022	€ 6.000	€ 6.111	0,59	2,200 % fällig am 22.07.2027	€ 6.700	€ 7.130	0,69	1,550 % fällig am 01.08.2024	\$ 1.400	€ 1.180	0,11
1,342 % fällig am 23.10.2026	6.300	6.623	0,64	2,569 % fällig am 22.09.2026	\$ 1.600	1.369	0,13	1,625 % fällig am 15.02.2024	1.500	1.285	0,12
1,875 % fällig am 30.03.2023	1.900	1.971	0,19	6,572 % fällig am 14.01.2022	700	609	0,06	2,625 % fällig am 20.03.2025	800	688	0,07
Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal				Vesteda Finance BV	€ 2.150	2.211	0,21	3,375 % fällig am 20.03.2028	900	778	0,08
0,625 % fällig am 21.06.2027	700	697	0,07	2,500 % fällig am 27.10.2022				Dell International LLC			
National Australia Bank Ltd.				Volkswagen Bank GmbH				4,900 % fällig am 01.10.2026	400	390	0,04
0,350 % fällig am 07.09.2022	6.700	6.765	0,66	1,250 % fällig am 10.06.2024	2.300	2.386	0,23	6,020 % fällig am 15.06.2026	1.800	1.823	0,18
Nationwide Building Society				1,875 % fällig am 31.01.2024	3.800	3.987	0,39	Diageo Finance PLC			
4,363 % fällig am 01.08.2024	\$ 5.700	5.159	0,50	2,500 % fällig am 31.07.2026	600	668	0,06	0,250 % fällig am 22.10.2021	€ 10.381	10.397	1,01
Natwest Group PLC				Volkswagen Financial Services AG				Energy Transfer LP			
1,750 % fällig am 02.03.2026	€ 5.339	5.630	0,55	0,875 % fällig am 12.04.2023	5.600	5.698	0,55	4,500 % fällig am 15.04.2024	\$ 100	92	0,01
2,000 % fällig am 08.03.2023	4.200	4.263	0,41	1,500 % fällig am 01.10.2024	1.400	1.467	0,14	Eurofins Scientific SE			
2,000 % fällig am 04.03.2025	6.000	6.311	0,61	Volkswagen Financial Services NV				2,125 % fällig am 25.07.2024	€ 931	987	0,10
2,500 % fällig am 22.03.2023	1.400	1.463	0,14	1,625 % fällig am 30.11.2022	£ 300	354	0,03	Flex Ltd.			
NE Property BV				Volkswagen Leasing GmbH				3,750 % fällig am 01.02.2026	\$ 700	646	0,06
3,375 % fällig am 14.07.2027	6.000	6.678	0,65	0,000 % fällig am 19.07.2024 (a)	€ 700	700	0,07	5,000 % fällig am 15.02.2023	100	90	0,01
Nissan Motor Acceptance Corp.				1,375 % fällig am 20.01.2025	2.400	2.512	0,24	Fonterra Co-operative Group Ltd.			
2,000 % fällig am 09.03.2026	\$ 1.000	849	0,08	2,625 % fällig am 15.01.2024	5.100	5.450	0,53	0,750 % fällig am 08.11.2024	€ 2.800	2.879	0,28
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				Vonovia Finance BV				Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide			
0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK 9.421	1.207	0,12	0,625 % fällig am 09.07.2026	6.000	6.138	0,59	1,625 % fällig am 09.07.2024	3.700	3.830	0,37
1,000 % fällig am 01.10.2050	106.861	13.761	1,33	WEA Finance LLC				2,125 % fällig am 09.07.2027	3.500	3.745	0,36
1,000 % fällig am 01.10.2053	48.923	6.206	0,60	3,750 % fällig am 17.09.2024	\$ 2.100	1.896	0,18	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.			
1,500 % fällig am 01.10.2037	201	28	0,00	Wells Fargo & Co.				2,949 % fällig am 24.01.2024	5.500	5.791	0,56
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	1,338 % fällig am 04.05.2025	€ 2.100	2.178	0,21	General Electric Co.			
2,500 % fällig am 01.10.2047	19	3	0,00	1,625 % fällig am 02.06.2025	12.400	13.140	1,27	5,250 % fällig am 07.12.2028	£ 4.100	5.964	0,58
Nykredit Realkredit A/S				1,741 % fällig am 04.05.2030	500	540	0,05	IMCD NV			
0,250 % fällig am 13.01.2026	€ 6.400	6.406	0,62	2,000 % fällig am 27.04.2026	1.200	1.302	0,13	2,500 % fällig am 26.03.2025	€ 902	946	0,09
0,375 % fällig am 17.01.2028	200	198	0,02	WPC Eurobond BV				Imperial Brands Finance PLC			
0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK 9.512	1.220	0,12	1,350 % fällig am 15.04.2028	2.600	2.693	0,26	1,125 % fällig am 14.08.2023	3.100	3.165	0,31
1,000 % fällig am 01.10.2050	94.713	12.249	1,19	2,250 % fällig am 09.04.2026	3.200	3.476	0,34	Informa PLC			
1,000 % fällig am 01.10.2053	50.041	6.350	0,62	Yorkshire Building Society				1,250 % fällig am 22.04.2028	4.000	4.077	0,39
1,500 % fällig am 01.10.2037	377	52	0,01	0,625 % fällig am 21.09.2025	4.400	4.508	0,44	Ingenico Group S.A.			
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00					1,625 % fällig am 13.09.2024	10.600	11.060	1,07
2,500 % fällig am 01.10.2036	50	7	0,00					InterContinental Hotels Group PLC			
2,500 % fällig am 01.10.2047	4	1	0,00	INDUSTRIEWERTE				2,125 % fällig am 14.03.2027	5.700	6.149	0,60
Pacific Life Global Funding				AA Bond Co. Ltd.				Las Vegas Sands Corp.			
1,200 % fällig am 24.06.2025	\$ 200	169	0,02	2,875 % fällig am 31.07.2043	£ 1.986	2.325	0,23	2,900 % fällig am 25.06.2025	\$ 1.050	923	0,09
Park Aerospace Holdings Ltd.				4,875 % fällig am 31.07.2043	2.600	3.228	0,31	Mitchells & Butlers Finance PLC			
5,250 % fällig am 15.08.2022	200	176	0,02	AbbVie, Inc.				0,569 % fällig am 15.12.2030	509	408	0,04
Peugeot Invest				1,250 % fällig am 01.06.2024	€ 2.900	3.002	0,29	5,965 % fällig am 15.12.2025	£ 22	27	0,00
1,875 % fällig am 30.10.2026	€ 1.200	1.264	0,12	Abertis Infraestructuras S.A.				6,013 % fällig am 15.12.2030	117	151	0,01
QNB Finance Ltd.				1,625 % fällig am 15.07.2029	1.100	1.158	0,11	Mondi Finance PLC			
1,256 % fällig am 12.02.2022	\$ 7.100	6.013	0,58	2,250 % fällig am 29.03.2029	10.300	11.306	1,10	1,500 % fällig am 15.04.2024	€ 1.700	1.767	0,17
1,375 % fällig am 26.01.2026	300	252	0,02	3,375 % fällig am 27.11.2026	£ 1.300	1.643	0,16	Motability Operations Group PLC			
Realkredit Danmark A/S				ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.				0,375 % fällig am 03.01.2026	3.100	3.156	0,31
2,500 % fällig am 01.04.2036	DKK 4	1	0,00	1,375 % fällig am 17.06.2025	€ 1.300	1.319	0,13	0,875 % fällig am 14.03.2025	800	829	0,08
2,500 % fällig am 01.04.2047	11	2	0,00	Aker BP ASA				Nissan Motor Co. Ltd.			
Sagax AB				1,125 % fällig am 12.05.2029	1.800	1.805	0,17	2,652 % fällig am 17.03.2026	4.200	4.581	0,44
1,125 % fällig am 30.01.2027	€ 2.000	2.045	0,20	Altria Group, Inc.				3,201 % fällig am 17.09.2028	600	680	0,07
2,000 % fällig am 17.01.2024	500	522	0,05	1,000 % fällig am 15.02.2023	500	508	0,05	Organon Finance LLC			
2,250 % fällig am 13.03.2025	2.400	2.553	0,25	Atlantia SpA				2,875 % fällig am 30.04.2028	500	508	0,05
Sagax Euro Mtn NL BV				Babcock International Group PLC				Petroleos Mexicanos			
0,750 % fällig am 26.01.2028	1.000	993	0,10	1,375 % fällig am 13.09.2027	1.700	1.731	0,17	4,750 % fällig am 26.02.2029	1.800	1.789	0,17
1,000 % fällig am 17.05.2029	900	898	0,09	1,875 % fällig am 05.10.2026	£ 2.500	2.915	0,28	4,875 % fällig am 21.02.2028	1.700	1.729	0,17
Santander UK Group Holdings PLC				Bayer AG				6,750 % fällig am 21.09.2047	\$ 2.900	2.167	0,21
0,312 % fällig am 27.03.2024	2.500	2.525	0,24	0,050 % fällig am 12.01.2025	€ 1.800	1.797	0,17	Philip Morris International, Inc.			
2,896 % fällig am 15.03.2032	\$ 4.200	3.653	0,35	0,375 % fällig am 06.07.2024	600	607	0,06	0,125 % fällig am 03.08.2026	€ 2.600	2.592	0,25
3,625 % fällig am 14.01.2026	£ 10.000	12.814	1,24	0,375 % fällig am 12.01.2029	1.600	1.570	0,15	2,750 % fällig am 19.03.2025	3.100	3.417	0,33
SELP Finance SARL				0,625 % fällig am 12.07.2031	1.000	968	0,09	Poste Italiane SpA			
1,250 % fällig am 25.10.2023	€ 5.700	5.853	0,57	0,750 % fällig am 06.01.2027	2.400	2.447	0,24	0,500 % fällig am 10.12.2028	3.000	2.978	0,29
Sirius Real Estate Ltd.				BEL S.A.				RCS & RDS S.A.			
1,125 % fällig am 22.06.2026	700	698	0,07	1,500 % fällig am 18.04.2024	3.900	4.019	0,39	2,500 % fällig am 05.02.2025	500	501	0,05
Societe Generale S.A.				Bureau Veritas S.A.				Rockies Express Pipeline LLC			
0,875 % fällig am 22.09.2028	1.800	1.830	0,18	1,250 % fällig am 07.09.2023	5.300	5.430	0,53	3,600 % fällig am 15.05.2025	\$ 100	86	0,01
1,792 % fällig am 09.06.2027	\$ 200	168	0,02	Centene Corp.				Ryanair DAC			
Standard Chartered PLC				4,250 % fällig am 15.12.2027	\$ 200	178	0,02	0,875 % fällig am 25.05.2026	€ 2.200	2.210	0,21
1,214 % fällig am 23.03.2025 (f)	200	169	0,02	4,625 % fällig am 15.12.2029	500	464	0,04	Sabine Pass Liquefaction LLC			
3,785 % fällig am 21.05.2025	1.300	1.179	0,11	Chanel Ceres PLC				5,625 % fällig am 01.03.2025	\$ 2.100	2.025	0,20
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 700	706	0,07	5,875 % fällig am 30.06.2026	100	100	0,01
1,474 % fällig am 08.07.2025	600	511	0,05	1,000 % fällig am 31.07.2031	600	603	0,06	Saudi Arabian Oil Co.			
UBS AG				Cie Plastic Omnium S.A.				1,250 % fällig am 24.11.2023	500	426	0,04
7,625 % fällig am 17.08.2022 (e)	1.700	1.542	0,15	1,250 % fällig am 26.06.2024	3.700	3.767	0,36	SEB S.A.			
UBS Group AG				Conti-Gummi Finance BV				1,500 % fällig am 31.05.2024	€ 3.800	3.934	0,38
1,250 % fällig am 17.04.2025	€ 15.400	15.941	1,54	1,125 % fällig am 25.09.2024	6.000	6.202	0,60	Swedish Match AB			
								0,875 % fällig am 26.02.2027	900	908	0,09
								1,200 % fällig am 10.11.2025	3.600	3.708	0,36

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 3.600	€ 4.014	0,39	Jubilee Place BV 0,463 % fällig am 17.10.2057	€ 917	€ 928	0,09	Jubilee CLO BV 0,252 % fällig am 15.12.2029	€ 1.775	€ 1.770	0,17	
4,441 % fällig am 24.04.2023	\$ 500	445	0,04	Landmark Mortgage Securities PLC 0,364 % fällig am 17.04.2044	€ 1.089	1.223	0,12	Man GLG Euro CLO 0,900 % fällig am 15.10.2032	950	951	0,09	
4,892 % fällig am 24.04.2025	4.700	4.396	0,43	Miravet SARL 0,307 % fällig am 26.05.2065	€ 2.528	2.535	0,25	OAK Hill European Credit Partners DAC 0,720 % fällig am 21.02.2030	2.394	2.397	0,23	
TDF Infrastructure SASU 2,875 % fällig am 19.10.2022	€ 6.800	7.009	0,68	Mulcair Securities DAC 0,461 % fällig am 24.04.2071	1.638	1.644	0,16	Palmer Square European Loan Funding DAC 0,870 % fällig am 15.02.2030	1.224	1.226	0,12	
Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	1.700	1.693	0,16	Newgate Funding PLC 0,052 % fällig am 15.12.2050	234	233	0,02	Penta CLO BV 0,790 % fällig am 04.08.2028	221	221	0,02	
1,289 % fällig am 30.01.2023	3.900	3.967	0,38	RMAC Securities PLC 0,234 % fällig am 12.06.2044	€ 111	126	0,01	Sorrento Park CLO DAC 0,409 % fällig am 16.11.2027	186	186	0,02	
Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % fällig am 26.03.2028	1.200	1.199	0,12	Southern Pacific Financing PLC 0,244 % fällig am 10.03.2044	42	48	0,00	St Paul's CLO DAC 0,850 % fällig am 25.04.2030	300	300	0,03	
Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	900	908	0,09	0,264 % fällig am 10.06.2043	11	13	0,00	Tikehau CLO BV 0,600 % fällig am 04.08.2028	528	528	0,05	
Worley U.S. Finance Sub Ltd. 0,875 % fällig am 09.06.2026	700	700	0,07	Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	5.300	6.198	0,60	Toro European CLO DAC 0,900 % fällig am 15.10.2030	3.524	3.529	0,34	
Zimmer Biomet Holdings, Inc. 2,425 % fällig am 13.12.2026	200	222	0,02	Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,793 % fällig am 19.12.2034	\$ 89	75	0,01					
		194.999	18,90	Towd Point Mortgage Funding PLC 1,111 % fällig am 20.10.2051	€ 2.197	2.573	0,25				50,099	4,85
				Twin Bridges PLC 0,899 % fällig am 12.03.2055	2.800	3.284	0,32					
											28.057	2,72
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN												
CNPC Global Capital Ltd. 1,125 % fällig am 23.06.2023	\$ 2.400	2.029	0,20	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE								
Engie S.A. 2,875 % fällig am 10.10.2022	1.700	1.477	0,14	Accunia European CLO DAC 0,950 % fällig am 15.07.2030	€ 3.400	3.402	0,33	STAATSEMISSIONEN				
Galp Energia SGPS S.A. 2,000 % fällig am 15.01.2026	€ 2.000	2.108	0,20	Aqueduct European CLO DAC 0,640 % fällig am 20.07.2030	1.300	1.302	0,13	Indonesia Government International Bond 0,900 % fällig am 14.02.2027	300	304	0,03	
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029	\$ 1.800	1.491	0,14	Ares European CLO DAC 1,120 % fällig am 21.10.2033	6.600	6.610	0,64	1,450 % fällig am 18.09.2026	100	104	0,01	
3,000 % fällig am 29.06.2027	400	343	0,03	Babson Euro CLO BV 0,281 % fällig am 25.10.2029	1.152	1.151	0,11	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,800 % fällig am 23.06.2030	\$ 600	518	0,05	
Global Switch Holdings Ltd. 1,500 % fällig am 31.01.2024	€ 900	930	0,09	Barings Euro CLO BV 0,680 % fällig am 27.07.2030	2.021	2.022	0,20	Qatar Government International Bond 3,375 % fällig am 14.03.2024	1.700	1.540	0,15	
Pacific Gas & Electric Co. 1,367 % fällig am 10.03.2023	\$ 200	169	0,02	Bastille Euro CLO DAC 1,150 % fällig am 15.01.2034	2.700	2.721	0,26	3,875 % fällig am 23.04.2023	2.600	2.330	0,23	
2,100 % fällig am 01.08.2027	100	82	0,01	Black Diamond CLO DAC 0,650 % fällig am 03.10.2029	646	646	0,06	Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033	€ 400	398	0,04	
3,150 % fällig am 01.01.2026	100	87	0,01	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 0,650 % fällig am 15.07.2030	500	501	0,05	2,375 % fällig am 19.04.2027	500	548	0,05	
3,300 % fällig am 15.03.2027 ^	100	87	0,01	Bosphorus CLO DAC 1,010 % fällig am 12.12.2032	1.900	1.904	0,18	4,625 % fällig am 03.04.2049	1.500	1.906	0,18	
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	300	266	0,02	Cairn CLO BV 0,790 % fällig am 25.07.2029	2.430	2.433	0,24	Saudi Government International Bond 2,875 % fällig am 04.03.2023	\$ 200	175	0,02	
3,450 % fällig am 01.07.2025	100	88	0,01	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,730 % fällig am 21.09.2029	238	239	0,02	4,000 % fällig am 17.04.2025	3.700	3.450	0,33	
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	100	89	0,01	1,200 % fällig am 21.09.2029	179	179	0,02				11.273	1,09
3,750 % fällig am 15.02.2024 ^	100	89	0,01	Contego CLO BV 0,770 % fällig am 15.10.2030	500	500	0,05					
3,750 % fällig am 01.07.2028	100	88	0,01	Contego CLO DAC 0,640 % fällig am 23.01.2030	2.100	2.096	0,20	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
4,250 % fällig am 01.08.2023	100	89	0,01	CVC Cordatus Loan Fund DAC 0,650 % fällig am 21.07.2030	4.400	4.402	0,43	KURZFRISTIGE SCHULDITITEL				
4,650 % fällig am 01.08.2028	200	186	0,02	GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 1,550 % fällig am 20.07.2031	5.200	5.209	0,50	Pacific Gas and Electric Co. 1,531 % fällig am 15.11.2021	4.900	4.141	0,40	
Petrobras Global Finance BV 6,250 % fällig am 14.12.2026	€ 200	268	0,02	Grosvenor Place CLO BV 0,720 % fällig am 30.10.2029	2.016	2.018	0,20	ARGENTINA TREASURY BILLS				
State Grid Overseas Investment Ltd. 0,797 % fällig am 05.08.2026	€ 1.900	1.942	0,19	Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029	834	836	0,08	(3,480) % fällig am 13.09.2021 (a)(b) ARS	99	0	0,00	
		11.908	1,15	1,100 % fällig am 18.11.2029	130	131	0,01	Summe kurzfristige Instrumente		4.141	0,40	
		848.566	82,24					Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 958.210	92,86		
NON-AGENCY-MBS												
Canada Square Funding PLC 0,999 % fällig am 17.06.2058	€ 1.483	1.738	0,17	AKTIEN								
1,149 % fällig am 17.10.2051	2.341	2.743	0,27	INVESTMENTFONDS								
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 2,890 % fällig am 25.08.2034 ^	\$ 31	24	0,00	BÖRSENGEHADELTE FONDS								
Domi BV 0,099 % fällig am 15.06.2053	€ 1.400	1.407	0,14	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)	247.500	24.198	2,35					
Dutch Property Finance BV 0,124 % fällig am 28.07.2058	2.900	2.911	0,28	Summe Investmentfonds	€ 24.198	2,35						
Great Hall Mortgages PLC 0,255 % fällig am 18.06.2039	\$ 425	354	0,03									

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	
								Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettvermögens
RYL	(1,000) %	30.06.2021	01.07.2021	€ 6.600	Austria Government International Bond 2,100 % fällig am 20.09.2117	€ (6.620)	€ 6.600	€ 6.600	0,64
	(1,000)	30.06.2021	01.07.2021	1.700	Belgium Government International Bond 1,600 % fällig am 22.06.2047	(1.709)	1.700	1.700	0,16
Summe Pensionsgeschäfte						€ (8.329)	€ 8.300	€ 8.300	0,80

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2021	620	€ 43	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	980	1.074	0,10
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	255	938	0,09
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	155	3	0,00
				€ 2.058	0,20
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 2.058	0,20

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Group Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 8.400	€ 44	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	\$ 11.300	(2)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	3.700	1	0,00
Auchan Holding S.A.	1,000	20.12.2027	€ 900	9	0,00
Auchan Holding S.A.	1,000	20.06.2028	5.700	64	0,01
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	2.300	3	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	4.500	(27)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	1.100	(9)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	1.600	(15)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	\$ 4.100	18	0,00
Glencore Finance (Europe) Ltd.	5,000	20.06.2026	€ 6.100	13	0,00
LafargeHolcim Ltd.	1,000	20.06.2026	7.100	19	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	1.900	8	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	6.100	88	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	400	6	0,00
Stellantis NV	5,000	20.06.2026	7.200	15	0,00
Syngenta Finance N.V.	1,000	20.06.2028	400	0	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2026	11.300	52	0,01
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	100	1	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	5.800	25	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	2.600	(2)	0,00
				€ 311	0,03

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 400	€ 1	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	7.900	18	0,00
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	€ 67.600	99	0,01
				€ 118	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,250 %	15.09.2023	£ 37.500	€ 37	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	18.400	26	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	1.300	(4)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	500	(2)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	\$ 27.600	19	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022	31.400	10	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	30.600	(390)	(0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	17.06.2022	43.600	11	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025	8.600	12	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025	4.800	9	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	600	(30)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2021	53.000	57	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2024	40.280	80	0,01
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 37.600	(25)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	18.800	10	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2023	42.300	20	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	900	2	0,00
					€ (158)	(0,01)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ 271	0,03

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Credit Fund (Forts.)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditrisikosituation zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditrisikosituation erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens	
BOA	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101.000 %	20.10.2021	300	€ (1)	€ (1)	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	1.600	(1)	0	0,00	
BPS	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.200	(2)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	2.300	(2)	0	0,00	
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.100	(1)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	2.600	(3)	(2)	0,00	
BRC	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	1.200	(1)	(1)	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.200	(1)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	2.300	(2)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.300	(2)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	9.500	(11)	(2)	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	4.600	(4)	(1)	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	2.300	(2)	(1)	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	2.200	(2)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	2.500	(3)	(1)	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	2.800	(2)	(2)	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	9.200	(8)	(5)	0,00	
	CBK	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.600	(1)	0	0,00
		Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	1.600	(1)	0	0,00
	DUB	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	4.800	(4)	(1)	0,00
Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index		Verkauf	0,800	18.08.2021	2.400	(2)	(1)	0,00	
FBF	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	2.300	(2)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	2.300	(3)	(1)	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	3.000	(3)	(3)	0,00	
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104.000	15.09.2021	400	(2)	(1)	0,00	
GST	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104.000	20.10.2021	600	(3)	(2)	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	1.400	(1)	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.600	(1)	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	1.400	(1)	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	3.000	(3)	(1)	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.600	(1)	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.600	(1)	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.700	(1)	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	3.100	(3)	(2)	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	3.000	(3)	(2)	0,00	
JPM	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.300	(3)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.300	(2)	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	2.400	(3)	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	1.600	(2)	(1)	0,00	
		Verkauf	0,850	20.10.2021	2.700	(3)	(1)	0,00	
						€ (97)	€ (32)	0,00	

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Hammerson PLC	1,000 %	20.12.2022	€ 200	€ 2	€ (3)	€ (1)	0,00
	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	400	78	(5)	73	0,01
BRC	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	400	3	(5)	(2)	0,00
	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	2.200	429	(27)	402	0,04
CBK	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	\$ 100	(1)	1	0	0,00
FBF	CPI Property Group S.A.	1,000	20.06.2023	€ 3.100	(13)	(11)	(24)	(0,01)
GST	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	2.300	11	(24)	(13)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 100	(1)	2	1	0,00
JPM	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	€ 1.700	331	(20)	311	0,03
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	\$ 100	(1)	1	0	0,00
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	300	(1)	2	1	0,00
					€ 835	€ (85)	€ 750	0,07

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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,

(ii) oder 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	04.2022	DKK	202.091	€ 27.163	€ 0	€ (8)	0,00
BPS	08.2021	£	460	535	0	(1)	0,00
	11.2021	\$	228	MXN 4.602	0	0	0,00
GLM	07.2021	€	1.164	\$ 1.418	31	0	0,00
	08.2021		1.820	£ 1.572	10	0	0,00
	08.2021	£	72.045	€ 83.847	0	(10)	0,00
HUS	09.2021	MXN	4.694	\$ 223	0	(9)	0,00
	09.2021	\$	13.056	CNH 83.906	0	(113)	(0,01)
	04.2022	DKK	235.800	€ 31.688	0	(15)	0,00
JPM	04.2022	€	3.580	DKK 26.635	1	0	0,00
MYI	07.2021		11.272	\$ 13.533	141	0	0,01
RBC	08.2021		2.124	£ 1.821	0	(4)	0,00
SCX	07.2021	\$	199.314	€ 162.923	0	(5.148)	(0,50)
				€ 183	€ (5.308)	€ (5.125)	(0,50)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ (4.407)	(0,43)
Summe Anlagen						€ 988.630	95,81
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 43.222	4,19
Nettovermögen						€ 1.031.852	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	2,129 %	24.11.2026	17.11.2020	€ 337	€ 342	0,03
Deutsche Bank AG	3,035	28.05.2032	25.05.2021	163	172	0,02
Standard Chartered PLC	1,214	23.03.2025	16.03.2021	168	169	0,02
				€ 668	€ 683	0,07

Barmittel in Höhe von EUR 28.822 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von EUR 4.750 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 956.765	€ 1.445	€ 958.210
Investmentfonds	0	24.198	0	24.198
Pensionsgeschäfte	0	8.300	0	8.300
Finanzderivate ⁽³⁾	2.058	(4.112)	(24)	(2.078)
Summen	€ 2.058	€ 985.151	€ 1.421	€ 988.630

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.074.763	€ 6.091	€ 1.080.854
Investmentfonds	0	19.350	0	19.350
Pensionsgeschäfte	0	16.413	0	16.413
Finanzderivate ⁽³⁾	(6)	2.169	0	2.163
Summen	€ (6)	€ 1.112.695	€ 6.091	€ 1.118.780

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	€ (9)	€ 0	€ (9)
BPS	69	0	69
BRC	387	(430)	(43)
DUB	(6)	(10)	(16)
FBF	(28)	0	(28)
GLM	31	0	31
GST	(16)	260	244
HUS	(137)	0	(137)
JPM	310	(340)	(30)
MYC	3	0	3
MYI	141	0	141
RBC	(4)	0	(4)
SCX	(5.148)	4.490	(658)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	88,34	87,07
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	3,42	5,45
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,10	1,46
Investmentfonds	2,35	1,68
Pensionsgeschäfte	0,80	1,43
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,20	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,03	(0,18)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,43)	0,37

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,56	1,41
Unternehmensanleihen und Wechsel	82,24	83,29
Non-Agency-MBS	2,72	1,94
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,85	5,90
Staatsemissionen	1,09	1,02
Kurzfristige Instrumente	0,40	0,42
Investmentfonds	2,35	1,68
Pensionsgeschäfte	0,80	1,43
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,20	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,03
Zinsswaps	(0,01)	(0,18)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,07	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,50)	0,39
Sonstige Aktiva und Passiva	4,19	2,72
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Altice Financing S.A.				Annington Funding PLC				CPI Property Group S.A.			
2,900 % fällig am 31.01.2026	\$ 2.237	€ 1.858	0,07	1,650 % fällig am 12.07.2024	€ 1.100	€ 1.150	0,04	1,500 % fällig am 27.01.2031	€ 2.600	€ 2.540	0,09
Altice France S.A.				Aroundtown S.A.	700	731	0,03	1,625 % fällig am 23.04.2027	8.700	8.962	0,33
3,000 % fällig am 02.02.2026	€ 6.035	5.951	0,22	1,450 % fällig am 09.07.2028	12.900	13.570	0,50	2,750 % fällig am 12.05.2026	100	109	0,00
3,871 % fällig am 31.01.2026	\$ 9.042	7.577	0,28	2,000 % fällig am 02.11.2026	9.300	10.003	0,37	4,750 % fällig am 08.03.2023	\$ 6.900	6.216	0,23
4,155 % fällig am 14.08.2026	2.932	2.472	0,09	3,250 % fällig am 18.07.2027	€ 1.100	1.396	0,05	4,875 % fällig am 16.07.2025 (e)	€ 1.300	1.379	0,05
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 3.600	3.636	0,13	4,875 % fällig am 18.08.2026 (e)	5.285	5.596	0,21
3,250 % fällig am 01.12.2027	5.771	4.873	0,18	Athora Netherlands NV	€ 800	920	0,03	Credit Suisse AG			
Casino Guichard Perrachon S.A.	€ 21.400	21.507	0,80	3,000 % fällig am 19.06.2025 (e)(g)	€ 800	920	0,03	6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	\$ 11.200	10.455	0,39
4,000 % fällig am 31.08.2025				Atrium European Real Estate Ltd.	6.400	6.939	0,26	Credit Suisse Group AG			
Charter Communications Operating LLC	\$ 4.296	3.599	0,13	3,000 % fällig am 15.02.2025	6.196	6.413	0,24	1,250 % fällig am 17.07.2025	€ 7.000	7.190	0,27
1,860 % fällig am 01.02.2027				3,625 % fällig am 17.10.2022				3,750 % fällig am 26.03.2025	\$ 1.550	1.419	0,05
Connect Finco SARL				Avolon Holdings Funding Ltd.	\$ 13.700	11.902	0,44	Cromwell Ereit Lux Finco SARL			
4,500 % fällig am 11.12.2026	3.160	2.671	0,10	2,875 % fällig am 11.09.2025	300	274	0,01	2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 13.900	14.430	0,53
Dell International LLC				4,250 % fällig am 15.04.2026				CTP NV			
2,000 % fällig am 19.09.2025	861	727	0,03	Balder Finland Oyj	€ 800	789	0,03	0,500 % fällig am 21.06.2025	3.200	3.189	0,12
Grifols S.A.				1,000 % fällig am 20.01.2029				1,250 % fällig am 21.06.2029	3.200	3.167	0,12
2,250 % fällig am 15.11.2027	€ 16.154	16.079	0,59	Banca Carige SpA	4.800	4.822	0,18	Cyrusone Europe Finance DAC	1.900	1.890	0,07
Hilton Worldwide Finance LLC	\$ 3.798	3.180	0,12	0,957 % fällig am 25.05.2022				1,450 % fällig am 22.01.2027	500	510	0,02
1,842 % fällig am 22.06.2026				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	23.300	24.338	0,90	Dell Bank International DAC			
INEOS Finance PLC	€ 19.233	19.152	0,71	3,625 % fällig am 24.09.2024	2.400	2.452	0,09	0,625 % fällig am 17.10.2022	2.500	2.528	0,09
2,500 % fällig am 01.04.2024				4,000 % fällig am 10.07.2022 (i)	4.467	3.688	0,14	1,625 % fällig am 24.06.2024	5.300	5.542	0,21
Level 3 Financing, Inc.	\$ 2.764	2.300	0,08	5,375 % fällig am 18.01.2028				Deutsche Bank AG			
1,854 % fällig am 01.03.2027				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	1.600	1.732	0,06	1,000 % fällig am 19.11.2025	3.100	3.166	0,12
Nielsen Finance LLC	3.385	2.855	0,11	5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)(g)				1,369 % fällig am 27.02.2023	\$ 200	170	0,01
2,081 % fällig am 04.10.2023				Banco de Sabadell S.A.	18.500	18.878	0,70	1,375 % fällig am 17.02.2032	€ 700	711	0,03
Numericable Group S.A.	1.661	1.382	0,05	1,125 % fällig am 27.03.2025				1,625 % fällig am 20.01.2027	14.200	14.941	0,55
2,936 % fällig am 31.07.2025				Banco Santander S.A.	1.400	1.415	0,05	1,750 % fällig am 17.01.2028	4.600	4.874	0,18
Perstorp Holding AB	€ 4.000	3.982	0,15	6,250 % fällig am 11.09.2021 (e)(g)				1,750 % fällig am 19.11.2030	6.200	6.559	0,24
4,750 % fällig am 27.02.2026				Bank of America Corp.	7.100	7.304	0,27	2,129 % fällig am 24.11.2026 (h)	\$ 5.100	4.367	0,16
Sigma Bidco BV				0,808 % fällig am 09.05.2026				2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 2.100	2.657	0,09
3,500 % fällig am 02.07.2025	9.000	8.782	0,32	Bank of Ireland				2,625 % fällig am 12.02.2026	€ 100	110	0,00
Summer (BC) Holdco B SARL	5.000	5.016	0,19	10,000 % fällig am 19.12.2022	700	801	0,03	3,547 % fällig am 18.09.2031	€ 1.100	988	0,04
4,750 % fällig am 04.12.2026				Banque Ouest Africaine de Developpement	1.600	1.682	0,06	3,700 % fällig am 30.05.2024	700	633	0,02
TDC A/S	5.736	5.705	0,21	2,750 % fällig am 22.01.2033 (i)				3,875 % fällig am 12.02.2024	€ 2.400	2.994	0,11
3,000 % fällig am 04.06.2025				Barclays Bank PLC	\$ 548	504	0,02	4,500 % fällig am 01.04.2025 (g)	€ 6.500	5.918	0,22
Ziggo BV				7,625 % fällig am 21.11.2022 (g)				5,625 % fällig am 19.05.2031	€ 2.000	2.370	0,09
3,000 % fällig am 31.01.2029	6.300	6.260	0,23	Barclays PLC	€ 8.900	9.060	0,34	Digital Dutch Finco BV	200	201	0,01
Ziggo Financing Partnership BV	\$ 5.566	4.654	0,17	0,750 % fällig am 09.06.2025	1.400	1.526	0,06	0,125 % fällig am 15.10.2022			
2,573 % fällig am 30.04.2028				3,375 % fällig am 04.03.2025	\$ 10.700	9.786	0,36	Digital Euro Finco LLC	300	321	0,01
		130.582	4,83	3,650 % fällig am 16.03.2025				2,625 % fällig am 15.04.2024			
				Bevco Lux SARL	€ 4.300	4.265	0,16	Fairfax Financial Holdings Ltd.	21.600	23.766	0,88
				1,000 % fällig am 16.01.2030				2,750 % fällig am 29.03.2028			
				Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	3.700	3.785	0,14	FCE Bank PLC	300	300	0,01
				1,250 % fällig am 26.04.2027	600	607	0,02	0,869 % fällig am 13.09.2021			
				1,400 % fällig am 06.07.2022	1.300	1.351	0,05	Ford Motor Credit Co. LLC	10.500	10.452	0,39
				1,750 % fällig am 12.03.2029	2.200	2.294	0,08	0,000 % fällig am 07.12.2022	3.100	3.022	0,11
				2,000 % fällig am 15.02.2024				0,157 % fällig am 01.12.2024	\$ 600	505	0,02
				BNP Paribas S.A.	2.500	2.540	0,09	1,068 % fällig am 12.10.2021	€ 200	168	0,01
				0,500 % fällig am 04.06.2026	\$ 500	417	0,02	1,391 % fällig am 15.02.2023	€ 3.100	3.150	0,12
				1,323 % fällig am 13.01.2027	700	681	0,03	1,514 % fällig am 17.02.2023	8.100	8.233	0,30
				4,400 % fällig am 14.08.2028	32.800	30.197	1,12	1,744 % fällig am 19.07.2024	12.000	12.427	0,46
				4,705 % fällig am 10.01.2025				2,330 % fällig am 25.11.2025	600	624	0,02
				BPCCE S.A.	100	88	0,00	2,386 % fällig am 17.02.2026	2.000	2.101	0,08
				2,375 % fällig am 14.01.2025				3,021 % fällig am 06.03.2024	\$ 500	431	0,02
				CA Immobilien Anlagen AG	€ 3.000	3.020	0,11	3,096 % fällig am 04.05.2023	300	255	0,01
				0,875 % fällig am 05.02.2027	900	921	0,03	3,340 % fällig am 07.01.2022	9.200	7.976	0,30
				1,000 % fällig am 27.10.2025				3,550 % fällig am 07.10.2022	600	555	0,02
				CaixaBank S.A.	1.800	1.840	0,07	5,584 % fällig am 18.03.2024	3.000	2.585	0,10
				0,750 % fällig am 10.07.2026				5,596 % fällig am 07.01.2022			
				Castellum AB	100	105	0,00	GA Global Funding Trust	600	513	0,02
				2,125 % fällig am 20.11.2023				1,625 % fällig am 15.01.2026			
				CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan				General Motors Financial Co., Inc.	€ 4.500	4.508	0,17
				European Core Fund	1.200	1.190	0,04	0,012 % fällig am 26.03.2022	200	211	0,01
				0,500 % fällig am 27.01.2028				2,200 % fällig am 01.04.2024			
				Ceetrus S.A.	9.100	9.954	0,37	Globalworth Real Estate Investments Ltd.	9.600	9.858	0,37
				2,750 % fällig am 26.11.2026				2,875 % fällig am 20.06.2022	5.200	5.596	0,21
				CIMIC Finance Ltd.	7.300	7.423	0,27	3,000 % fällig am 29.03.2025			
				1,500 % fällig am 28.05.2029				Goldman Sachs Group, Inc.	16.400	16.540	0,61
				Citycon Treasury BV	600	603	0,02	0,082 % fällig am 26.09.2023	9.300	9.548	0,35
				1,625 % fällig am 12.03.2028				1,375 % fällig am 15.05.2024			
				Corestate Capital Holding S.A.	11.600	10.099	0,37	HSBC Holdings PLC	300	301	0,01
				3,500 % fällig am 15.04.2023				0,309 % fällig am 13.11.2026	\$ 17.500	14.796	0,55
				Country Garden Holdings Co. Ltd.	\$ 2.600	2.172	0,08	1,589 % fällig am 24.05.2027	600	520	0,02
				2,700 % fällig am 12.07.2026	1.500	1.273	0,05	2,099 % fällig am 04.06.2026	11.800	10.449	0,39
				3,125 % fällig am 22.10.2025	600	518	0,02	2,633 % fällig am 07.11.2025	1.200	1.126	0,04
				4,750 % fällig am 17.01.2023				3,900 % fällig am 25.05.2026			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES MARKT-NETTO- WERTVERMÖ- GENS		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES MARKT-NETTO- WERTVERMÖ- GENS		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES MARKT-NETTO- WERTVERMÖ- GENS	
Coty, Inc.				Organon Finance LLC				Wabtec Transportation Netherlands BV			
3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 400	€	0,01	2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 1.200	€	0,05	1,250 % fällig am 03.12.2027	€ 2.500	€	2,523
4,000 % fällig am 15.04.2023	6.200		0,23	4,125 % fällig am 30.04.2028	\$ 3.100		0,10	Western Midstream Operating LP	\$ 300		268
DAE Funding LLC				Petroleos Mexicanos				4,350 % fällig am 01.02.2025			0,01
1,625 % fällig am 15.02.2024	\$ 3.500		0,11	2,750 % fällig am 21.04.2027	€ 300		0,01	Worley U.S. Finance Sub Ltd.			
2,625 % fällig am 20.03.2025	2.300		0,07	4,875 % fällig am 21.02.2028	12.500		0,47	0,875 % fällig am 09.06.2026	€ 1.700		1,701
3,375 % fällig am 20.03.2028	2.600		0,08	5,950 % fällig am 28.01.2031	\$ 700		0,02	Zimmer Biomet Holdings, Inc.			
Dell International LLC				6,490 % fällig am 23.01.2027	1.700		0,06	1,414 % fällig am 13.12.2022	3.600		3,683
6,020 % fällig am 15.06.2026	2.300		0,09	Phillip Morris International, Inc.							0,14
Delta Air Lines, Inc.				2,750 % fällig am 19.03.2025	€ 7.350		0,30				629.397
4,500 % fällig am 20.10.2025	1.100		0,04	Q-Park Holding BV							23,30
Energy Transfer LP				3,500 % fällig am 01.02.2025	7.800		0,29				
4,500 % fällig am 15.04.2024	100		0,00	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.							
5,000 % fällig am 15.05.2050	1.100		0,04	5,838 % fällig am 30.09.2027	\$ 240		0,01	CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.	9.500		9,588
Energy Transfer Partners LP				RCS & RDS S.A.				Galp Energia SGPS S.A.	5.400		5,691
5,000 % fällig am 01.10.2022	1.800		0,06	2,500 % fällig am 05.02.2025	€ 1.500		0,06	2,000 % fällig am 15.01.2026			0,21
Esercizi Aeroportuali SEA SpA				Renault S.A.				Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.	\$ 900		837
3,500 % fällig am 09.10.2025	€15.900		0,63	1,250 % fällig am 24.06.2025	10.200		0,37	6,000 % fällig am 27.11.2023			0,03
Eurofins Scientific SE				2,375 % fällig am 25.05.2026	1.100		0,04	Global Switch Holdings Ltd.	€ 1.500		1,550
2,125 % fällig am 25.07.2024	4.603		0,18	Roadster Finance DAC				1,500 % fällig am 31.01.2024	500		548
Fortune Star BVI Ltd.				1,625 % fällig am 09.12.2029	200		0,01	2,250 % fällig am 31.05.2027			0,02
3,950 % fällig am 02.10.2026 (b)	12.600		0,47	2,375 % fällig am 08.12.2032	400		0,02	NGPL PipeCo LLC	\$ 2.692		2,603
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				Rockies Express Pipeline LLC				4,875 % fällig am 15.08.2027			0,10
1,625 % fällig am 09.07.2024	8.900		0,34	3,600 % fällig am 15.05.2025	\$ 200		0,01	Pacific Gas & Electric Co.	2.500		2,108
2,125 % fällig am 09.07.2027	10.600		0,42	4,800 % fällig am 15.05.2030	2.800		0,09	1,367 % fällig am 10.03.2023	8.500		6,969
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.				Rolls-Royce PLC				2,100 % fällig am 01.08.2027	700		554
2,949 % fällig am 24.01.2024	700		0,03	4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 800		0,03	2,500 % fällig am 01.02.2031	700		0,02
Hyatt Hotels Corp.				5,750 % fällig am 15.10.2027	\$ 500		0,02	2,950 % fällig am 15.03.2026 ^	200		173
3,135 % fällig am 01.09.2022	\$ 2.500		0,08	5,750 % fällig am 15.10.2027	€ 700		0,03	3,150 % fällig am 01.01.2026	500		435
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)				Ryanair DAC				3,300 % fällig am 15.03.2027 ^	700		612
3,625 % fällig am 15.05.2025 (c)	€11.200		0,42	0,875 % fällig am 25.05.2026	€ 3.600		0,13	3,300 % fällig am 01.12.2027 ^	500		434
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				Sabine Pass Liquefaction LLC				3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	2.570		2,276
3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)	6.100		0,23	5,875 % fällig am 30.06.2026	\$ 4.200		0,16	3,450 % fällig am 01.07.2025	200		177
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)				Sands China Ltd.				3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	800		708
3,875 % fällig am 15.05.2027 (c)	6.300		0,24	3,800 % fällig am 08.01.2026	2.900		0,10	3,750 % fällig am 15.02.2024 ^	700		619
IMCD NV				5,125 % fällig am 08.08.2025	1.700		0,06	4,250 % fällig am 01.08.2023	800		715
2,500 % fällig am 26.03.2025	8.530		0,33	SEB S.A.				4,450 % fällig am 15.04.2042 ^	1.000		837
Imperial Brands Finance PLC				1,375 % fällig am 16.06.2025	€ 4.200		0,16	4,500 % fällig am 01.07.2040	500		422
1,125 % fällig am 14.08.2023	3.900		0,15	1,500 % fällig am 31.05.2024	6.400		0,25	4,550 % fällig am 01.07.2030	178		161
2,125 % fällig am 12.02.2027	3.000		0,12	SIG CombiBloc Purchase Co. SARL				4,600 % fällig am 15.06.2043 ^	100		84
3,125 % fällig am 26.07.2024	\$ 1.140		0,04	1,875 % fällig am 18.06.2023	7.900		0,30	4,650 % fällig am 01.08.2028	200		186
3,750 % fällig am 21.07.2022	1.600		0,05	Standard Industries, Inc.				Petrobras Global Finance BV			
INEOS Finance PLC				2,250 % fällig am 21.11.2026	9.500		0,35	5,375 % fällig am 01.10.2029	€ 4.900		6,289
2,875 % fällig am 01.05.2026	€ 6.700		0,25	Stryker Corp.				6,250 % fällig am 14.12.2026	1.020		1,366
Informa PLC				1,125 % fällig am 30.11.2023	2.200		0,08	Sinopec Group Overseas Development Ltd.	\$ 3.500		3,028
1,250 % fällig am 22.04.2028	8.000		0,30	Swedish Match AB				2,150 % fällig am 13.05.2025			0,11
1,500 % fällig am 05.07.2023	2.800		0,11	1,200 % fällig am 10.11.2025	11.400		0,43	State Grid Overseas Investment Ltd.	€ 4.400		4,498
2,125 % fällig am 06.10.2025	6.350		0,25	Syngenta Finance NV				0,797 % fällig am 05.08.2026			0,17
Ingenico Group S.A.				3,375 % fällig am 16.04.2026	12.000		0,50	Transmission Finance DAC			
1,625 % fällig am 13.09.2024	20.300		0,78	4,441 % fällig am 24.04.2023	\$ 1.000		0,03	1,500 % fällig am 24.05.2023	100		103
InterContinental Hotels Group PLC				4,892 % fällig am 24.04.2025	8.225		0,28				53.748
Jaguar Land Rover Automotive PLC				TDI Infrastructure SASU							1,99
3,875 % fällig am 01.03.2023	€12.600		0,55	2,500 % fällig am 07.04.2026	€ 5.000		0,20	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			1.934.239
5,875 % fällig am 15.11.2024	€ 300		0,01	2,875 % fällig am 19.10.2022	8.400		0,32				71,61
James Hardie International Finance DAC				Teva Pharmaceutical Finance Co. BV							
3,625 % fällig am 01.10.2026	1.000		0,04	3,650 % fällig am 10.11.2021	\$ 6.100		0,19				
John Lewis PLC				Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV							
6,125 % fällig am 21.01.2025	€ 2.870		0,14	1,125 % fällig am 15.10.2024	€ 6.700		0,23	Corestate Capital Holding S.A.	7.800		6,630
Kemira Oyj				1,250 % fällig am 31.03.2023	4.500		0,16	1,375 % fällig am 28.11.2022			0,25
Las Vegas Sands Corp.				Travis Perkins PLC							
2,900 % fällig am 25.06.2025	\$ 1.600		0,05	4,500 % fällig am 07.09.2023	€ 5.600		0,26				
Loxam S.A.S.				Ubisoft Entertainment S.A.							
3,250 % fällig am 14.01.2025	€19.800		0,74	0,878 % fällig am 24.11.2027	€ 8.600		0,32	Angel Oak Mortgage Trust	620		527
Marks & Spencer PLC				1,289 % fällig am 30.01.2023	6.900		0,26	1,469 % fällig am 25.06.2065			0,02
4,500 % fällig am 10.07.2027	€ 4.300		0,20	UCB S.A.				Atlas Funding PLC	€ 900		1,055
6,000 % fällig am 12.06.2025	3.593		0,17	1,000 % fällig am 30.03.2028	1.900		0,07	0,951 % fällig am 25.07.2058			0,04
Mattel, Inc.				5,125 % fällig am 02.10.2023	921		0,04	Banc of America Alternative Loan Trust			
3,375 % fällig am 01.04.2026	\$ 300		0,01	4,375 % fällig am 15.04.2026	\$ 1.400		0,05	0,452 % fällig am 25.06.2037	\$ 289		184
Mitchells & Butlers Finance PLC				Vilmorin & Cie S.A.				5,500 % fällig am 25.10.2033	288		251
0,531 % fällig am 15.12.2030	€ 560		0,02	1,375 % fällig am 26.03.2028	€ 3.300		0,12	6,000 % fällig am 25.07.2046 ^	301		247
0,569 % fällig am 15.12.2030	\$ 967		0,03	Virgin Media Secured Finance PLC				6,549 % fällig am 25.06.2037 ^ (a)	320		52
Nissan Motor Co. Ltd.				4,125 % fällig am 15.08.2030	€ 1.000		0,04	Banc of America Funding Trust	86		69
2,652 % fällig am 17.03.2026	€11.400		0,46	4,250 % fällig am 15.01.2030	900		0,04	0,302 % fällig am 25.04.2037 ^	92		65
3,201 % fällig am 17.09.2028	900		0,04	5,000 % fällig am 15.04.2027	200		0,01	0,473 % fällig am 20.10.2036	122		95
3,522 % fällig am 17.09.2025	\$ 3.400		0,11	Vmed O2 UK Financing PLC				2,529 % fällig am 20.11.2035 ^	91		74
				3,250 % fällig am 31.01.2031	€ 8.800		0,33	2,712 % fällig am 20.04.2035 ^	78		65
								2,815 % fällig am 20.09.2046 ^	53		43
								2,953 % fällig am 20.09.2046 ^	379		307
								6,000 % fällig am 25.08.2037 ^			0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Income Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- WERT VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- WERT VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- WERT VERMÖ- GENS
Banc of America Mortgage Trust 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^	\$ 14	€ 12	0,00	6,500 % fällig am 25.11.2036 ^	\$ 335	€ 181	0,01	Newgate Funding PLC 0,052 % fällig am 15.12.2050	€ 260	€ 259	0,01
BCAP LLC Trust 3,252 % fällig am 26.03.2037	75	56	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 1,242 % fällig am 25.09.2034 ^	49	46	0,00	1,081 % fällig am 15.12.2050	€ 206	238	0,01
3,283 % fällig am 27.03.2037	288	212	0,01	6,000 % fällig am 25.01.2036 ^	177	123	0,01	Residential Accredited Loans, Inc. Trust 0,512 % fällig am 25.06.2037	\$ 72	56	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2034 ^	19	15	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust 0,392 % fällig am 25.08.2036 ^	1.457	319	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	79	64	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 2,234 % fällig am 25.12.2046 ^	276	209	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2036	216	141	0,01	6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	63	52	0,00
2,986 % fällig am 25.02.2035	14	12	0,00	6,500 % fällig am 25.10.2021 ^	205	60	0,00	6,250 % fällig am 25.02.2037 ^	169	139	0,01
3,554 % fällig am 25.08.2035	19	15	0,00	6,500 % fällig am 25.02.2022 ^	513	81	0,00	Residential Asset Securitization Trust 6,000 % fällig am 25.02.2036	344	184	0,01
Bear Stearns ALT-A Trust 3,051 % fällig am 25.09.2035 ^	208	104	0,01	Deutsche ALT-A Securities, Inc. 0,392 % fällig am 25.04.2037	238	143	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2036	154	83	0,00
3,122 % fällig am 25.05.2036 ^	426	245	0,01	Dutch Property Finance BV 0,124 % fällig am 28.07.2058	€ 7.900	7.930	0,29	6,000 % fällig am 25.11.2036 ^	127	59	0,00
3,344 % fällig am 25.11.2036 ^	79	46	0,00	EuroMASTR PLC 0,281 % fällig am 15.06.2040	€ 154	174	0,01	6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	103	49	0,00
4,420 % fällig am 25.07.2035 ^	434	314	0,01	Finsbury Square PLC 0,849 % fällig am 16.03.2070	3.770	4.409	0,16	6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	741	516	0,02
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 5,750 % fällig am 25.11.2034 ^	217	181	0,01	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust 2,383 % fällig am 25.04.2036 ^	\$ 77	61	0,00	6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	87	42	0,00
Bear Stearns Mortgage Funding Trust 7,500 % fällig am 25.08.2036	15	13	0,00	2,690 % fällig am 25.01.2036 ^	185	107	0,01	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^	54	44	0,00
Canada Square Funding PLC 1,149 % fällig am 17.10.2051	€ 6.457	7.563	0,28	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust 3,144 % fällig am 25.11.2037 ^	47	39	0,00	Ripon Mortgages PLC 0,881 % fällig am 20.08.2056	€ 6.758	7.889	0,29
Canterbury Finance PLC 1,399 % fällig am 16.05.2056	8.800	10.354	0,38	GSC Capital Corp. Mortgage Trust 0,452 % fällig am 25.05.2036 ^	88	73	0,00	RMAC Securities PLC 0,254 % fällig am 12.06.2044	550	622	0,02
Chase Mortgage Finance Trust 2,794 % fällig am 25.01.2036 ^	\$ 278	216	0,01	GSR Mortgage Loan Trust 5,500 % fällig am 25.06.2035	140	127	0,01	Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	14.878	17.401	0,65
3,132 % fällig am 25.03.2037 ^	32	27	0,00	Harben Finance PLC 0,881 % fällig am 20.08.2056	€ 1.357	1.584	0,06	1,249 % fällig am 25.11.2036 ^	163	191	0,01
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	110	64	0,00	HarborView Mortgage Loan Trust 2,655 % fällig am 19.12.2035 ^	\$ 40	33	0,00	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 2,909 % fällig am 25.02.2036 ^	\$ 72	56	0,00
ChaseFlex Trust 5,000 % fällig am 25.07.2037 ^	84	51	0,00	3,020 % fällig am 19.12.2035 ^	101	58	0,00	3,076 % fällig am 25.10.2035 ^	230	186	0,01
ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust				3,132 % fällig am 19.06.2036 ^	116	63	0,00	SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 2,178 % fällig am 25.02.2037 ^	133	106	0,00
4,152 % fällig am 25.08.2037 ^	30	25	0,00	Hops Hill No. 1 PLC 1,000 % fällig am 27.05.2054	€ 1.096	1.286	0,05	Towd Point Mortgage Funding PLC 0,949 % fällig am 20.07.2045	€12.768	14.924	0,55
Citigroup Mortgage Loan Trust 2,529 % fällig am 25.04.2037 ^	230	174	0,01	HSI Asset Loan Obligation Trust 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	\$ 129	98	0,00	1,111 % fällig am 20.10.2051	11.374	13.321	0,49
3,252 % fällig am 25.03.2037 ^	52	41	0,00	Impac Secured Assets Trust 0,242 % fällig am 25.11.2036	257	207	0,01	Twin Bridges PLC 1,199 % fällig am 12.06.2053	4.589	5.384	0,20
5,500 % fällig am 25.12.2035	138	86	0,00	IndyMac Mortgage Loan Trust 0,463 % fällig am 25.01.2035	60	43	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,872 % fällig am 25.10.2044	\$ 77	64	0,00
6,250 % fällig am 25.11.2037	152	85	0,00	2,836 % fällig am 25.11.2035 ^	110	91	0,00	2,924 % fällig am 25.05.2037 ^	56	47	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 0,422 % fällig am 25.12.2034	7	6	0,00	2,933 % fällig am 25.06.2037 ^	1.337	930	0,04	3,103 % fällig am 25.12.2036 ^	319	260	0,01
CitiMortgage Alternative Loan Trust 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	290	248	0,01	2,969 % fällig am 25.06.2036	46	39	0,00	3,132 % fällig am 25.12.2035	15	13	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	501	425	0,02	6,250 % fällig am 25.11.2037 ^	46	25	0,00	3,250 % fällig am 25.10.2036 ^	40	32	0,00
Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	120	71	0,00	JPMorgan Alternative Loan Trust 0,572 % fällig am 25.10.2036	3.990	3.343	0,12	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,886 % fällig am 25.04.2047	457	342	0,01
Countrywide Alternative Loan Trust 2,676 % fällig am 25.09.2034	5	4	0,00	0,812 % fällig am 25.01.2035	246	167	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2036 ^	117	86	0,00
2,898 % fällig am 25.05.2036	19	14	0,00	2,716 % fällig am 25.12.2036	8	6	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	35	30	0,00
3,288 % fällig am 25.06.2037 ^	102	79	0,00	6,500 % fällig am 25.03.2036 ^	217	147	0,01	Wells Fargo Alternative Loan Trust 6,250 % fällig am 25.11.2037 ^	46	39	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035	92	62	0,00	6,500 % fällig am 25.05.2036	9	8	0,00		131.721	4,88	
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	79	50	0,00	Jubilee Place BV 0,463 % fällig am 17.10.2057	€ 2.476	2.505	0,09	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
5,500 % fällig am 25.02.2036 ^	58	40	0,00	Lavender Trust 6,250 % fällig am 26.10.2036	\$ 181	111	0,01	Accunia European CLO DAC 0,950 % fällig am 15.07.2030	€ 800	800	0,03
5,750 % fällig am 25.04.2047 ^	113	77	0,00	Lehman Mortgage Trust 5,049 % fällig am 25.12.2035	164	44	0,00	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,202 % fällig am 25.12.2036	\$ 443	137	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2036 ^	244	141	0,01	5,140 % fällig am 25.01.2036 ^	81	70	0,00	0,372 % fällig am 25.07.2036	134	101	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2036	181	115	0,01	Lehman XS Trust 0,272 % fällig am 25.12.2036	1.154	1.002	0,04	AlbaCore EURO CLO DAC 1,530 % fällig am 18.07.2031	€ 6.100	6.120	0,23
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^	38	26	0,00	0,936 % fällig am 15.11.2049	€ 1.205	1.408	0,05	ALME Loan Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2031	5.056	5.051	0,19
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^	197	135	0,01	Mansard Mortgages PLC 0,731 % fällig am 15.12.2049	67	78	0,00	Aqueduct European CLO DAC 0,640 % fällig am 20.07.2030	3.600	3.606	0,13
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	72	48	0,00	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2,622 % fällig am 25.03.2035	\$ 21	17	0,00	Arbour CLO DAC 0,580 % fällig am 15.03.2029	1.087	1.087	0,04
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	844	459	0,02	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	149	122	0,01	Ares European CLO DAC 1,120 % fällig am 21.10.2033	18.500	18.528	0,69
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	360	220	0,01	2,756 % fällig am 25.03.2036 ^	310	169	0,01	Argent Securities Trust 0,242 % fällig am 25.09.2036	\$ 921	336	0,01
6,250 % fällig am 25.07.2036 ^	1.579	927	0,04	Miravet SARL 0,307 % fällig am 26.05.2065	€ 7.115	7.136	0,27	0,292 % fällig am 25.06.2036	502	166	0,01
6,250 % fällig am 25.12.2036 ^	25	14	0,00	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 3,020 % fällig am 25.03.2036 ^	\$ 164	114	0,01	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 0,732 % fällig am 25.01.2036	584	476	0,02
6,500 % fällig am 25.12.2036 ^	66	37	0,00	5,962 % fällig am 25.06.2036 ^	4.755	1.683	0,06	Asset-Backed Funding Certificates Trust 1,092 % fällig am 25.06.2037	88	69	0,00
6,500 % fällig am 25.08.2037 ^	356	184	0,01	6,000 % fällig am 25.10.2037 ^	118	77	0,00	1,142 % fällig am 25.03.2034 ^	162	135	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates 0,572 % fällig am 25.04.2036 ^	189	147	0,01	Mulcair Securities DAC 0,461 % fällig am 24.04.2071	€ 4.258	4.274	0,16	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust 3,073 % fällig am 15.08.2033	11	9	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0,692 % fällig am 25.03.2035	324	224	0,01								
0,712 % fällig am 25.03.2035	20	16	0,00								
0,832 % fällig am 25.02.2035	233	184	0,01								
2,798 % fällig am 20.09.2036 ^	30	24	0,00								
2,808 % fällig am 25.01.2036 ^	52	42	0,00								
3,041 % fällig am 25.09.2047 ^	101	82	0,00								
3,125 % fällig am 25.11.2037	139	111	0,01								
3,165 % fällig am 20.12.2035 ^	81	69	0,00								
3,327 % fällig am 20.02.2036	179	153	0,01								
5,750 % fällig am 25.12.2035 ^	79	49	0,00								
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	118	72	0,00								
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	18	11	0,00								
6,000 % fällig am 25.07.2037	172	93	0,00								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Aurium CLO DAC				Mackay Shields Euro CLO DAC				Towd Point Mortgage Trust			
0,670 % fällig am 16.04.2030	€ 2.100	€ 2.100	0,08	0,930 % fällig am 20.10.2032	€ 1.300	€ 1.302	0,05	3,750 % fällig am 25.05.2058	\$ 5.421	€ 4.826	0,18
0,680 % fällig am 13.10.2029	2.596	2.598	0,10	1,550 % fällig am 15.08.2033	5.500	5.508	0,20	Vendome Funding CLO DAC			
								1,860 % fällig am 20.07.2031	€ 2.000	2.002	0,07
Babson Euro CLO BV				Man GLG Euro CLO DAC				Voya Euro CLO DAC			
0,281 % fällig am 25.10.2029	2.215	2.213	0,08	0,870 % fällig am 15.01.2030	6.996	6.994	0,26	0,750 % fällig am 15.10.2030	4.000	4.003	0,15
Bastille Euro CLO DAC				Marlay Park CLO DAC							
1,150 % fällig am 15.01.2034	16.200	16.326	0,61	0,740 % fällig am 15.10.2030	1.400	1.394	0,05				
										198.302	7,34
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				MASTR Asset-Backed Securities Trust				STAATSEMISSIONEN			
2,850 % fällig am 25.10.2036	\$ 37	22	0,00	0,192 % fällig am 25.11.2036	\$ 151	58	0,00	Albania Government International Bond			
				0,392 % fällig am 25.08.2036	269	120	0,00	3,500 % fällig am 16.06.2027	4.700	5.058	0,19
Black Diamond CLO DAC				0,572 % fällig am 25.06.2036	148	70	0,00	Argentina Government International Bond			
0,650 % fällig am 03.10.2029	€ 1.116	1.117	0,04	0,232 % fällig am 25.10.2036	161	73	0,00	0,125 % fällig am 09.07.2030	\$ 2.654	808	0,03
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0,125 % fällig am 09.07.2041	566	171	0,01
0,650 % fällig am 15.07.2030	2.600	2.607	0,10	0,392 % fällig am 25.11.2037	697	287	0,01	1,000 % fällig am 09.07.2029	71	23	0,00
0,910 % fällig am 15.01.2033	2.300	2.286	0,09	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				Banque Centrale de Tunisie Government International Bond			
				0,192 % fällig am 25.09.2036	60	24	0,00	5,625 % fällig am 17.02.2024	€ 5.500	5.154	0,19
BNPP AM Euro CLO BV				0,202 % fällig am 25.02.2037	523	194	0,01	6,375 % fällig am 15.07.2026	10.000	9.271	0,34
0,650 % fällig am 15.10.2031	1.150	1.145	0,04	0,222 % fällig am 25.01.2037	112	58	0,00	Egypt Government International Bond			
Bosphorus CLO DAC				0,232 % fällig am 25.10.2036	124	62	0,00	6,375 % fällig am 11.04.2031	600	627	0,02
0,820 % fällig am 15.12.2030	300	300	0,01	0,242 % fällig am 25.09.2036	358	145	0,01	Ivory Coast Government International Bond			
Cairn CLO BV				0,272 % fällig am 25.03.2037	378	175	0,01	5,250 % fällig am 22.03.2030	20.400	21.367	0,79
0,650 % fällig am 20.10.2028	654	655	0,02	0,292 % fällig am 25.02.2037	128	65	0,00	Oman Government International Bond			
0,670 % fällig am 31.01.2030	4.900	4.903	0,18	0,342 % fällig am 25.03.2037	378	177	0,01	4,875 % fällig am 01.02.2025	\$ 18.900	16.730	0,62
0,790 % fällig am 25.07.2029	4.930	4.935	0,18	1,022 % fällig am 25.03.2035	59	57	0,00	6,750 % fällig am 17.01.2048	1.800	1.515	0,06
Carlyle Euro CLO DAC				1,142 % fällig am 25.06.2033	12	10	0,00	Romania Government International Bond			
1,110 % fällig am 15.08.2032	200	200	0,01	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				2,375 % fällig am 19.04.2027	€ 5.300	5.802	0,21
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				0,262 % fällig am 25.04.2037	313	175	0,01	3,375 % fällig am 28.01.2050	3.600	3.853	0,14
0,730 % fällig am 21.09.2029	1.431	1.432	0,05	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				Russia Government International Bond			
Carrington Mortgage Loan Trust				5,965 % fällig am 25.09.2046 ^	335	145	0,01	2,875 % fällig am 04.12.2025	14.200	15.539	0,58
0,352 % fällig am 25.02.2037	\$ 191	156	0,01	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				Turkey Government International Bond			
Castle Park CLO DAC				6,032 % fällig am 25.10.2036 ^	165	52	0,00	4,250 % fällig am 13.03.2025	\$ 7.600	6.301	0,23
0,462 % fällig am 15.01.2028	€ 245	245	0,01	NovaStar Mortgage Funding Trust				4,875 % fällig am 16.04.2043	2.500	1.684	0,06
Centex Home Equity Loan Trust				0,392 % fällig am 25.06.2036	102	72	0,00	5,600 % fällig am 14.11.2024	1.200	1.042	0,04
1,142 % fällig am 25.10.2035	\$ 6.546	5.425	0,20	0,392 % fällig am 25.09.2036	173	86	0,00	Ukraine Government International Bond			
Citigroup Mortgage Loan Trust				0,412 % fällig am 25.05.2036	541	451	0,02	7,750 % fällig am 01.09.2021	1.900	1.618	0,06
6,851 % fällig am 25.05.2036 ^	146	63	0,00	OAK Hill European Credit Partners DAC				7,750 % fällig am 01.09.2022	9.900	8.787	0,33
				0,730 % fällig am 20.01.2032	€ 7.360	7.369	0,27	7,750 % fällig am 01.09.2023	6.500	5.918	0,22
Contego CLO BV				Option One Mortgage Loan Trust							
0,770 % fällig am 15.10.2030	€ 1.300	1.301	0,05	0,312 % fällig am 25.01.2037	\$ 307	183	0,01				
CVC Cordatus Loan Fund DAC				0,422 % fällig am 25.04.2037	111	60	0,00				
0,650 % fällig am 21.07.2030	11.600	11.606	0,43	Palmer Square European Loan Funding DAC							
0,780 % fällig am 15.08.2032	200	200	0,01	0,870 % fällig am 15.02.2030	€ 3.672	3.678	0,14				
First NLC Trust				1,150 % fällig am 15.01.2030	1.716	1.722	0,06				
0,232 % fällig am 25.08.2037	\$ 164	90	0,00	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates							
0,372 % fällig am 25.08.2037	55	31	0,00	0,827 % fällig am 25.08.2035	\$ 460	390	0,02				
Fremont Home Loan Trust				Renaissance Home Equity Loan Trust							
0,242 % fällig am 25.01.2037	242	115	0,00	1,892 % fällig am 25.09.2037	192	150	0,01				
0,252 % fällig am 25.08.2036	207	75	0,00	5,879 % fällig am 25.06.2037 ^	3.494	1.181	0,04				
0,432 % fällig am 25.02.2037	733	316	0,01	7,238 % fällig am 25.09.2037 ^	231	110	0,00				
				Residential Asset Securities Corp. Trust							
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				0,352 % fällig am 25.11.2036	1.062	834	0,03				
1,550 % fällig am 20.07.2031	€ 17.000	17.028	0,63	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust							
				0,272 % fällig am 25.07.2036	211	84	0,00				
Grosvenor Place CLO BV				0,412 % fällig am 25.07.2036	206	84	0,00				
0,720 % fällig am 30.10.2029	2.108	2.110	0,08	0,572 % fällig am 25.07.2036	177	73	0,00				
GSAA Home Equity Trust				0,592 % fällig am 25.05.2036	785	461	0,02				
5,772 % fällig am 25.11.2036 ^	\$ 141	53	0,00	Segovia European CLO DAC							
				0,770 % fällig am 18.01.2031	€ 300	300	0,01				
GSAMP Trust				Soundview Home Loan Trust							
0,192 % fällig am 25.12.2046	219	120	0,00	0,202 % fällig am 25.02.2037	\$ 288	89	0,00				
0,232 % fällig am 25.12.2036	965	526	0,02	0,272 % fällig am 25.02.2037	425	134	0,01				
0,242 % fällig am 25.09.2036	394	158	0,01	0,372 % fällig am 25.06.2037	172	120	0,00				
0,242 % fällig am 25.12.2046	602	334	0,01	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust							
0,292 % fällig am 25.11.2036	223	117	0,00	0,242 % fällig am 25.09.2037	81	53	0,00				
0,322 % fällig am 25.12.2046	109	62	0,00	St Paul's CLO DAC							
Harvest CLO DAC				0,850 % fällig am 25.04.2030	€ 700	701	0,03				
0,379 % fällig am 15.11.2028	€ 178	178	0,01	Structured Asset Investment Loan Trust							
0,630 % fällig am 18.11.2029	730	731	0,03	0,242 % fällig am 25.09.2036	\$ 65	54	0,00				
HSI Asset Securitization Corp. Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust							
0,312 % fällig am 25.12.2036	\$ 216	70	0,00	1,842 % fällig am 25.04.2031	1.879	1.642	0,06				
0,432 % fällig am 25.12.2036	1.038	338	0,01	Tikehau CLO BV							
0,532 % fällig am 25.12.2036	601	199	0,01	0,600 % fällig am 04.08.2028	€ 288	288	0,01				
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				0,880 % fällig am 07.12.2029	4.200	4.204	0,16				
1,022 % fällig am 25.06.2035	4.968	4.165	0,15	Toro European CLO DAC							
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				0,650 % fällig am 15.04.2030	5.800	5.800	0,22				
4,760 % fällig am 25.11.2036	73	61	0,00	0,740 % fällig am 15.10.2030	1.200	1.201	0,05				
6,337 % fällig am 25.08.2036 ^	102	61	0,00	0,900 % fällig am 15.10.2030	7.146	7.156	0,27				
Jubilee CLO BV											
0,252 % fällig am 15.12.2029	€ 2.663	2.655	0,10								
0,295 % fällig am 12.07.2028	2.214	2.211	0,08								
Lehman XS Trust											
0,262 % fällig am 25.02.2037 ^	\$ 1.363	1.042	0,04								

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Income Bond Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2021	764	€ (112)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	996	1.428	0,05
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	5.780	37	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	1.224	1.168	0,04
				€ 2.521	0,09
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 2.521	0,09

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Group Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 8.000	€ 89	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	\$ 17.700	64	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	5.000	9	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 1.600	14	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	8.700	50	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	3.000	(29)	0,00
Casino Guichard Perrachon S.A.	1,000	20.12.2021	3.500	342	0,01
Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.12.2022	200	27	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	\$ 3.600	75	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	4.400	122	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	2.800	94	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	9.600	54	0,00
Glencore Finance (Europe) Ltd.	5,000	20.06.2026	€ 16.400	(48)	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	3.300	158	0,01
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2025	2.100	62	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.06.2027	200	2	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	7.100	681	0,03
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	12.100	1.280	0,05
Syngenta Finance N.V.	1,000	20.06.2028	800	0	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2026	16.700	86	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	12.000	(1)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	4.800	(4)	0,00
				€ 3.127	0,12

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000 %	20.06.2026	\$ 10.800	€ 25	0,00
iTraxx Crossover 35 5-Year Index	5,000	20.06.2026	€ 168.600	1.637	0,06
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	188.600	193	0,01
				€ 1.855	0,07

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	15.09.2026	£ 52.600	€ 73	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	6.900	(21)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	22.400	(101)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	0,880	03.03.2024	CAD 372.500	(582)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,250	16.06.2023	\$ 285.800	238	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	186.200	(95)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	1.200	(53)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	€ 70.200	101	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	29.600	44	0,00
				€ (396)	(0,02)	
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				€ 4.586	0,17	

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einerreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einerreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONEN AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000 %	20.10.2021	900	€ (3)	€ (2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	4.200	(3)	(1)	0,00
BPS	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	5.800	(5)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	5.900	(6)	(1)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	3.000	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	6.900	(7)	(5)	0,00
BRC	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	3.300	(2)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	3.300	(4)	0	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	6.000	(5)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	6.000	(5)	0	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	24.800	(29)	(6)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	12.200	(12)	(2)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	5.800	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	5.900	(5)	(1)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	6.400	(7)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	7.100	(6)	(4)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	24.000	(21)	(12)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	4.000	(4)	(1)	0,00
CBK	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	4.200	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	12.300	(10)	(3)	0,00
DUB	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	6.100	(6)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	6.000	(5)	(1)	0,00
DUB	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	6.200	(7)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	7.700	(7)	(6)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	15.09.2021	900	(4)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	3.600	(3)	(1)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	4.200	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	3.600	(3)	(1)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	8.100	(7)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	4.400	(4)	0	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	4.000	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	4.400	(4)	(1)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	7.800	(7)	(4)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	7.800	(7)	(4)	0,00
GST	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	6.000	(7)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	5.900	(5)	0	0,00
JPM	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	6.400	(7)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	4.300	(4)	(2)	0,00
JPM	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	6.900	(7)	(3)	0,00
						€ (245)	€ (77)	0,00

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Hochtief AG	5,000 %	20.12.2025	€ 1.200	€ 233	€ (14)	€ 219	0,01
BRC	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	6.400	1.248	(78)	1.170	0,04
FBF	Intrum AB	5,000	20.12.2024	800	69	5	74	0,00
	CPI Property Group S.A.	1,000	20.06.2023	6.900	(29)	(23)	(52)	0,00
GST	Intrum AB	5,000	20.12.2024	3.600	309	25	334	0,01
	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	3.600	31	(52)	(21)	0,00
JPM	Intrum AB	5,000	20.12.2024	15.900	1.565	(90)	1.475	0,06
	Atlantia SpA	1,000	20.06.2026	100	(4)	3	(1)	0,00
JPM	Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.12.2022	1.600	56	(2)	54	0,00
	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	2.900	567	(37)	530	0,02
MYC	Intrum AB	5,000	20.12.2024	700	59	6	65	0,00
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	5.400	502	(1)	501	0,02
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	3.800	358	(5)	353	0,01
					€ 4.964	€ (263)	€ 4.701	0,17

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einerreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einerreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Income Bond Fund (Forts.)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	07.2021	€	1.733	\$	2.066	€	10	0,00		
	09.2021	PLN	33		9		0	0,00		
	09.2021	\$	23	RUB	1.705		0	0,00		
BPS	04.2022	DKK	1.051.984	€	141.396		(42)	0,00		
	07.2021	€	2.628	\$	3.152		30	0,00		
	07.2021	\$	26.920	€	22.356		(344)	(0,01)		
BRC	11.2021	MXN	6.827	\$	338		1	0,00		
	07.2021	€	4.265	€	5.197		118	0,00		
	07.2021	\$	6.899	€	5.697		(120)	0,00		
CBK	08.2021	¥	20.400		154		(1)	0,00		
	09.2021	PLN	22	\$	6		0	0,00		
	04.2022	DKK	82.260	€	11.054		(5)	0,00		
GLM	07.2021	\$	990		809		(26)	0,00		
	08.2021		399	MXN	8.341		15	0,00		
	09.2021		39	ZAR	538		(2)	0,00		
HUS	07.2021	€	2.345	\$	2.850		58	0,00		
	07.2021	\$	51	RUB	3.915		2	0,00		
	08.2021	€	5.658	£	4.888		32	0,00		
	08.2021		15.726	NOK	159.345		(123)	0,00		
	08.2021		15.925	SEK	161.860		26	0,00		
	08.2021	£	188.613	€	219.513		(21)	0,00		
	08.2021	\$	54	RUB	3.915		0	0,00		
	09.2021	PLN	35	\$	9		0	0,00		
	09.2021	TWD	4.773		174		2	0,00		
	09.2021	\$	18	RUB	1.312		0	0,00		
	09.2021		24	ZAR	326		(1)	0,00		
	JPM	04.2022	DKK	24.825	€	3.338		0	0,00	
07.2021		€	1.689	\$	2.058		46	0,00		
07.2021		\$	8.941	€	7.384		(156)	(0,01)		
08.2021		€	16.493	AUD	25.872		(126)	(0,01)		
09.2021		PLN	39	\$	10		0	0,00		
09.2021		\$	34.117	CNH	219.254		(294)	(0,01)		
MYI	09.2021		12	RUB	898		0	0,00		
	04.2022	DKK	1.062.639	€	142.804		(67)	0,00		
	04.2022	€	2.854	DKK	21.235		1	0,00		
	07.2021		1.684	\$	2.041		37	0,00		
	08.2021		996	£	858		2	0,00		
	09.2021	IDR	468.787	\$	33		0	0,00		
RBC	04.2022	DKK	81.249	€	10.918		(6)	0,00		
	04.2022	€	10.567	DKK	78.615		(1)	0,00		
	07.2021	€	14.063	\$	17.039		306	0,01		
RYL	07.2021	\$	8.446	€	7.044		(78)	0,00		
	04.2022	€	2.962	DKK	22.030		0	0,00		
	07.2021	\$	1.370	€	1.126		(29)	0,00		
SCX	08.2021	AUD	4.402		2.786		2	0,00		
	04.2022	€	2.877	DKK	21.395		(1)	0,00		
	07.2021	\$	724.385	€	592.124		(18.708)	(0,69)		
SOG	12.2021	INR	18.242	\$	243		2	0,00		
	08.2021	€	1.214	£	1.043		0	0,00		
UAG	08.2021	CAD	1.752	€	1.189		(3)	0,00		
				€	694	€	(20.154)	€	(19.460)	(0,72)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€	(14.836)	(0,55)		
Summe Anlagen						€	2.640.735	97,77		
Sonstige Aktiva und Passiva						€	60.149	2,23		
Nettovermögen						€	2.700.884	100,00		

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	2,129 %	24.11.2026	17.11.2020	€ 4.295	€ 4.367	0,16
Sunac China Holdings Ltd.	5,950	30.12.2021	11.01.2021	8.147	8.354	0,31
				€ 12.442	€ 12.721	0,47

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von EUR 3.827 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 53.045 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von EUR 17.236 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 2.514.802	€ 6.294	€ 2.521.096
Investmentfonds	105.761	21.607	0	127.368
Finanzderivate ⁽³⁾	1.353	(9.030)	(52)	(7.729)
Summen	€ 107.114	€ 2.527.379	€ 6.242	€ 2.640.735

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 3.397.149	€ 17.166	€ 3.414.315
Investmentfonds	127.470	0	0	127.470
Pensionsgeschäfte	0	2.872	0	2.872
Finanzderivate ⁽³⁾	255	31.062	0	31.317
Summen	€ 127.725	€ 3.431.083	€ 17.166	€ 3.575.974

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	(4,000) %	14.06.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (2.231)	€ (2.230)	(0,09)
SCX	(0,430)	20.05.2021	19.08.2021	(1.686)	(1.686)	(0,06)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					€ (3.916)	(0,15)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	€ (35)	€ 51	€ 16
BPS	(101)	0	(101)
BRC	1.206	(1.349)	(143)
CBK	(15)	0	(15)
DUB	(13)	194	181
FBF	275	(219)	56
GLM	(25)	(202)	(227)
GST	1.444	(1.501)	(57)
HUS	(596)	565	(31)
JPM	679	(548)	131
MYC	501	(472)	29
MYI	581	(481)	100
RBC	(27)	0	(27)
RYL	(1)	0	(1)
SCX	(18.706)	16.401	(2.305)
UAG	(3)	0	(3)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	83,09	81,07
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	7,08	22,96
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,17	3,24
Investmentfonds	4,72	4,00
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,09	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,17	0,36
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,55)	0,62
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,15)	(0,08)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	4,83	4,12
Unternehmensanleihen und Wechsel	71,61	71,09
Wandelanleihen & Wechsel	0,25	0,20
US-Regierungsbehörden	k. A.	15,20
Non-Agency-MBS	4,88	4,20
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,34	8,10
Staatsemissionen	4,12	4,36
Kurzfristige Instrumente	0,31	k. A.
Investmentfonds	4,72	4,00
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,09	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,12	0,06
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,07	0,33
Zinsswaps	(0,02)	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,17	0,06
Devisenterminkontrakte	(0,72)	0,57
Sonstige Aktiva und Passiva	2,23	(12,35)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BANKEN UND FINANZEN				BANKEN UND FINANZEN				BANKEN UND FINANZEN			
AMCO – Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	€ 400	€ 413	0,22	Realkredit Danmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053 2,000 % fällig am 01.10.2047	DKK 2.800	€ 371	0,19	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates 0,850 % fällig am 16.01.2057	€ 149	€ 174	0,09
Atrium European Real Estate Ltd. 3,625 % fällig am 17.10.2022	390	404	0,21	SBB Treasury Oyj 0,114 % fällig am 01.02.2023	€ 800	802	0,42	Ciel No. 1 PLC 1,134 % fällig am 12.06.2046	250	292	0,15
Bank of America Corp. 0,244 % fällig am 04.05.2023	500	503	0,26	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	200	200	0,10	Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates 2,148 % fällig am 25.07.2033	\$ 7	6	0,00
Bank of China Ltd. 0,950 % fällig am 21.09.2023	\$ 600	509	0,27	SLM Student Loan Trust 0,002 % fällig am 15.12.2033	628	601	0,31	Dilosk RMBS DAC 0,197 % fällig am 20.02.2060	€ 297	298	0,16
Barclays PLC 7,875 % fällig am 15.03.2022 (e)(f) 7,875 % fällig am 15.09.2022 (e)(f)	400 € 200	352 250	0,18 0,13	Societe Generale S.A. 7,875 % fällig am 18.12.2023 (e)(f)	\$ 200	189	0,10	Dutch Property Finance BV 0,111 % fällig am 28.07.2054 0,124 % fällig am 28.07.2058	525 400	526 402	0,27 0,21
Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 1,400 % fällig am 06.07.2022	€ 400	404	0,21	Standard Chartered PLC 1,319 % fällig am 14.10.2023 7,500 % fällig am 02.04.2022 (e)(f)	200 200	170 176	0,09 0,09	Eurohome UK Mortgages PLC 0,231 % fällig am 15.06.2044	€ 233	266	0,14
China Construction Bank Europe S.A. 0,000 % fällig am 28.06.2024 (b)	800	800	0,42	Sveabank AB 6,000 % fällig am 17.03.2022 (e)(f)	200	174	0,09	Eurosail PLC 0,244 % fällig am 10.12.2044	18	21	0,01
CK Hutchison Finance Ltd. 1,250 % fällig am 06.04.2023	400	410	0,21	UBS Group AG 7,125 % fällig am 10.08.2021 (e)(f)	200	170	0,09	Finsbury Square PLC 1,349 % fällig am 16.06.2070	266	313	0,16
Credit Suisse Group AG 0,462 % fällig am 16.01.2026 7,125 % fällig am 29.07.2022 (e)(f) 7,500 % fällig am 17.07.2023 (e)(f) 7,500 % fällig am 11.12.2023 (e)(f)	200 \$ 400 800 400	201 352 735 374	0,11 0,18 0,38 0,20	UniCredit SpA 3,127 % fällig am 03.06.2032 9,250 % fällig am 03.06.2022 (e)(f)	300 € 200	255 215	0,13 0,11	Great Hall Mortgages PLC 0,000 % fällig am 18.03.2039 0,255 % fällig am 18.06.2039	€ 110 \$ 39	109 32	0,06 0,02
Deutsche Bank AG 0,750 % fällig am 17.02.2027 1,000 % fällig am 19.11.2025 1,375 % fällig am 17.02.2032	€ 300 300 400	302 306 406	0,16 0,16 0,21	Volkswagen Financial Services NV 0,875 % fällig am 20.02.2025	€ 100	116	0,06	Hawksmoor Mortgages PLC 1,099 % fällig am 25.05.2053	€ 1.022	1.196	0,62
EUROFIMA 0,010 % fällig am 23.06.2028	700	703	0,37	Volkswagen Leasing GmbH 0,000 % fällig am 12.07.2023 (b)	€ 400	401	0,21	Jubilee Place BV 0,463 % fällig am 17.10.2057	€ 183	186	0,10
Europäische Investitionsbank 0,000 % fällig am 28.09.2028 (b)	100	101	0,05	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		38.062	19,83	Landmark Mortgage Securities PLC 0,282 % fällig am 17.06.2039 0,364 % fällig am 17.04.2044	€ 222 885	252 994	0,13 0,52
Europäische Union 0,000 % fällig am 06.07.2026 (a)(b) 0,000 % fällig am 04.07.2031 (b) 0,250 % fällig am 22.04.2036 0,700 % fällig am 06.07.2051 (a) 0,750 % fällig am 04.01.2047	300 900 1.650 700 700	306 898 1.619 709 721	0,16 0,47 0,84 0,37 0,38	INDUSTRIEWERTE				Ludgate Funding PLC 0,250 % fällig am 01.01.2061 0,270 % fällig am 01.12.2060	104 260	117 295	0,06 0,15
Goldman Sachs Group, Inc. 0,013 % fällig am 21.04.2023 0,084 % fällig am 09.09.2022 0,466 % fällig am 30.04.2024	400 300 500	401 300 505	0,21 0,16 0,26	Atlantia SpA 1,625 % fällig am 03.02.2025 1,875 % fällig am 12.02.2028	200 600	205 618	0,11 0,32	Newgate Funding PLC 0,052 % fällig am 15.12.2050	€ 910	906	0,47
HSBC Holdings PLC 2,848 % fällig am 04.06.2031 7,000 % fällig am 07.04.2038	\$ 400 € 250	350 451	0,18 0,24	Barry Callebaut Services NV 5,500 % fällig am 15.06.2023	\$ 400	367	0,19	Polaris PLC 1,300 % fällig am 27.05.2057	€ 284	334	0,17
JPMorgan Chase & Co. 1,406 % fällig am 24.10.2023	\$ 500	428	0,22	Bayer AG 0,050 % fällig am 12.01.2025	€ 400	399	0,21	Precise Mortgage Funding PLC 1,249 % fällig am 12.12.2055	300	354	0,19
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050 1,000 % fällig am 01.10.2053 1,500 % fällig am 01.10.2050 2,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 6.238 13.000 65 23	801 1.649 9 3	0,42 0,86 0,00 0,00	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024 1,875 % fällig am 31.03.2028	300 400	311 419	0,16 0,22	Primrose Residential 0,200 % fällig am 24.03.2061	€ 398	398	0,21
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.06.2029 (b) 0,375 % fällig am 20.05.2036 0,875 % fällig am 04.07.2039	€ 1.100 700 3.000	1.111 708 3.251	0,58 0,37 1,69	Organon Finance LLC 2,875 % fällig am 30.04.2028	100	102	0,05	Residential Mortgage Securities PLC 0,881 % fällig am 20.03.2050 1,281 % fällig am 20.09.2065	€ 154 69	180 81	0,09 0,04
LeasePlan Corp. NV 1,375 % fällig am 07.03.2024	200	208	0,11	Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	300	310	0,16	RMAC Securities PLC 0,234 % fällig am 12.06.2044	245	277	0,15
Natwest Group PLC 8,625 % fällig am 15.08.2021 (e)(f)	\$ 200	170	0,09	SK Hynix, Inc. 1,000 % fällig am 19.01.2024	\$ 200	168	0,09	SapphireOne Mortgages FCT 0,000 % fällig am 27.06.2061	€ 125	125	0,07
Nexi SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026	€ 500	498	0,26	Summe US-REGIERUNGSBEHÖRDEN		2.899	1,51	Stratton Mortgage Funding PLC 0,901 % fällig am 25.09.2051 0,948 % fällig am 20.07.2060 0,948 % fällig am 12.03.2052 1,249 % fällig am 25.05.2051	€ 385 778 270 81	449 910 316 95	0,23 0,47 0,17 0,05
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050 1,500 % fällig am 01.10.2050 2,000 % fällig am 01.10.2047 2,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 9.833 0 0 26	1.267 0 0 4	0,66 0,00 0,00 0,00	US-SCHATZOBIGATIONEN				Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,593 % fällig am 19.07.2035	\$ 22	18	0,01
Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 100	98	0,05	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,125 % fällig am 15.07.2030 0,875 % fällig am 15.01.2029 0,875 % fällig am 15.02.2047 1,000 % fällig am 15.02.2048	2.187 434 221 877	2.036 423 240 989	1,06 0,22 0,12 0,52	Thornburg Mortgage Securities Trust 0,732 % fällig am 25.09.2043	27	23	0,01
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050 1,000 % fällig am 01.10.2053 1,500 % fällig am 01.10.2047 1,500 % fällig am 01.10.2050 1,500 % fällig am 01.10.2053 2,000 % fällig am 01.10.2047 2,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 68.431 5.532 2 0 5.600 0 29	8.789 699 0 0 740 0 4	4,58 0,36 0,00 0,00 0,39 0,00 0,00	NON-AGENCY-MBS				Towd Point Mortgage Funding PLC 0,049 % fällig am 20.05.2045 1,111 % fällig am 20.10.2051	€ 372 582	435 681	0,23 0,36
				Alba PLC 0,000 % fällig am 15.12.2038	€ 256	250	0,13	Trinity Square PLC 0,899 % fällig am 15.07.2059	500	584	0,30
				Avon Finance No. 2 PLC 0,949 % fällig am 20.09.2048	€ 724	846	0,44	Twin Bridges PLC 1,299 % fällig am 12.12.2054	195	230	0,12
				Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 2,292 % fällig am 25.07.2033	\$ 5	5	0,00	Summe FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE		13.278	6,92
				Bluestep Mortgage Securities DAC 0,188 % fällig am 10.08.2066	€ 123	123	0,06	Accunia European CLO DAC 0,930 % fällig am 15.10.2030 0,950 % fällig am 15.07.2030	€ 200 700	200 700	0,10 0,36
				Canterbury Finance PLC 1,050 % fällig am 16.05.2057 1,219 % fällig am 16.05.2056	€ 140 13	164 15	0,09 0,01	Aqueduct European CLO DAC 0,640 % fällig am 20.07.2030	500	501	0,26
								Arbour CLO DAC 0,580 % fällig am 15.03.2029	155	155	0,08
								Ares European CLO DAC 0,660 % fällig am 15.10.2030 0,780 % fällig am 15.10.2031	200 900	200 900	0,10 0,47

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Aurium CLO DAC 0,680 % fällig am 13.10.2029	€ 668	€ 668	0,35	North Westerly CLO BV 0,910 % fällig am 20.04.2031	€ 300	€ 300	0,16	4,000 % fällig am 25.04.2055	€ 500	€ 948	0,49
Auto ABS French Leases 0,700 % fällig am 29.06.2033	600	607	0,32	NovaStar Mortgage Funding Trust 0,797 % fällig am 25.01.2036	\$ 820	\$ 690	0,36	4,000 % fällig am 25.04.2060	4.350	8.609	4,48
Auto ABS UK Loans 0,710 % fällig am 27.11.2027	£ 274	320	0,17	Palmer Square European Loan Funding DAC 0,870 % fällig am 15.02.2030	€ 525	525	0,27	4,500 % fällig am 25.04.2041	4.550	7.892	4,11
Bain Capital Euro DAC 0,740 % fällig am 20.01.2032	€ 200	200	0,10	1,150 % fällig am 15.01.2030	343	345	0,18	Israel Government International Bond 0,000 % fällig am 22.07.2022	700	702	0,37
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	224	225	0,12	Penta CLO BV 0,790 % fällig am 04.08.2028	442	442	0,23	(b) 0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS 2.000	518	0,27
Black Diamond CLO DAC 0,860 % fällig am 20.01.2032	500	500	0,26	Purple Master Credit Cards 0,147 % fällig am 25.05.2034	400	404	0,21	5,500 % fällig am 31.01.2022	11.900	3.180	1,66
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 0,650 % fällig am 15.07.2030	400	401	0,21	Segovia European CLO DAC 0,770 % fällig am 18.01.2031	200	200	0,10	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	€ 824	891	0,46
0,720 % fällig am 15.01.2031	500	499	0,26	0,149 % fällig am 15.02.2027	118	119	0,06	(d) 1,300 % fällig am 15.05.2028	744	848	0,44
0,910 % fällig am 15.01.2033	400	398	0,21	SLM Student Loan Trust 0,000 % fällig am 17.06.2024	12	12	0,01	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	¥ 330.650	2.584	1,35
1,050 % fällig am 15.01.2031	100	100	0,05	0,002 % fällig am 15.12.2033	186	177	0,09	(d) € 330.650	2.584	1,35	
BNPP AM Euro CLO BV 0,650 % fällig am 15.10.2031	250	249	0,13	St Paul's CLO DAC 0,850 % fällig am 25.04.2030	300	300	0,16	Netherlands Government International Bond 2,750 % fällig am 15.01.2047	€ 3.350	5.409	2,82
Bumper UK Finance PLC 0,550 % fällig am 20.12.2030	£ 300	350	0,18	Tikehau CLO BV 0,880 % fällig am 07.12.2029	872	873	0,45	Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050	5.000	4.598	2,39
Cairn CLO BV 0,780 % fällig am 15.10.2031	€ 600	600	0,31	0,900 % fällig am 15.10.2030	1.175	1.176	0,61	(b) 0,000 % fällig am 15.08.2050	5.000	4.598	2,39
0,790 % fällig am 25.07.2029	764	765	0,40	Voya Euro CLO DAC 0,750 % fällig am 15.10.2030	400	400	0,21	15,08.2050 (b)(g)	3.200	2.972	1,55
Carlyle Euro CLO DAC 0,700 % fällig am 15.01.2031	600	600	0,31	Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035	200	266	0,14	Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 400	339	0,18
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,730 % fällig am 21.09.2029	298	298	0,15	Caisse Francaise de Financement Local 0,000 % fällig am 25.02.2025	400	402	0,21	Societe Du Grand Paris EPIC 0,700 % fällig am 15.10.2060	€ 300	257	0,13
0,750 % fällig am 15.11.2031	300	299	0,16	China Development Bank 0,000 % fällig am 27.10.2023	400	400	0,21	Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 31.10.2031	800	802	0,42
Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC 0,269 % fällig am 15.12.2029	400	403	0,21	(b) 1,250 % fällig am 25.05.2036	5.300	5.938	3,09	1,250 % fällig am 31.10.2030	2.400	2.600	1,35
Contego CLO BV 0,770 % fällig am 15.10.2030	300	300	0,16	1,500 % fällig am 25.05.2050	9.050	10.520	5,48	1,450 % fällig am 31.10.2071	400	353	0,18
Contego CLO DAC 0,640 % fällig am 23.01.2030	500	499	0,26	1,750 % fällig am 25.06.2039	4.050	4.917	2,56	1,950 % fällig am 30.04.2026	400	443	0,23
CVC Cordatus Loan Fund DAC 0,650 % fällig am 21.07.2030	1.400	1.401	0,73	1,750 % fällig am 25.05.2068	970	1.222	0,64	103,070	53,68		
Harvest CLO DAC 0,640 % fällig am 15.10.2031	400	400	0,21	3,250 % fällig am 25.05.2045	7.100	11.066	5,76				
0,650 % fällig am 26.06.2030	500	499	0,26								
0,760 % fällig am 15.07.2031	300	301	0,16								
Hayfin Emerald CLO DAC 1,450 % fällig am 15.02.2033	400	401	0,21								
Laurelin DAC 0,720 % fällig am 20.10.2031	400	400	0,21								
Madison Park Euro Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2032	400	401	0,21								
Man GLG Euro CLO DAC 0,680 % fällig am 15.10.2030	400	401	0,21								
0,870 % fällig am 15.01.2030	999	999	0,52								

STAATSEMISSIONEN

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE

COMMERCIAL PAPER

Nomura Bank International PLC (0,375) % fällig am 14.10.2021	500	501	0,26
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 0,051 % fällig am 10.09.2021	900	900	0,47
		1.401	0,73

ISRAEL TREASURY BILLS

(0,028) % fällig am 30.11.2021 (b)(c)	ILS 5.700	1.475	0,77
(0,020) % fällig am 02.02.2022 (b)(c)	2.100	544	0,28
		2.019	1,05
Summe kurzfristige Instrumente		3.420	1,78

Summe Übertragbare Wertpapiere	€	187.714	97,77
--------------------------------	---	---------	-------

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
RYL	(1,000) %	30.06.2021	01.07.2021	€ 1.900	Belgium Government International Bond 1,600 % fällig am 22.06.2047	€ (1.911)	€ 1.900	€ 1.900	0,99
Summe Pensionsgeschäfte						€ (1.911)	€ 1.900	€ 1.900	0,99

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend², außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von EUR 114,300 auf Euro-Schatz Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Long	08.2021	441	€ 0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von EUR 170,500 auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	12	(11)	(0,01)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von EUR 171,500 auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	08.2021	12	(4)	0,00

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2021	61	€ (1)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	21	38	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	38	(29)	(0,02)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	268	962	0,50
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	217	139	0,07
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	394	1	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	2	0	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von EUR 170,500 auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	12	15	0,01
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von EUR 171,500 auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	08.2021	12	10	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2021	16	5	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	63	(23)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	75	54	0,03
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	37	(82)	(0,04)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	13	(46)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	21	(126)	(0,07)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	8	(5)	0,00
				€ 897	0,47
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 897	0,47

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2051	£ 600	€ (11)	(0,01)
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 17.100	7	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2036	700	(8)	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	200	0	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035	9.000	(342)	(0,18)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2023	5.100	1	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	4.800	65	0,04
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	7.000	(9)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	15.12.2040	9.900	(670)	(0,35)
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	1.200	(29)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,180	19.01.2022	\$ 1.600	(35)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,200	21.01.2022	1.300	(29)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,330	15.01.2025	£ 1.300	2	0,00
Zahlung	UKRPI	3,400	15.12.2024	5.300	45	0,02
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	2.300	(28)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,513	15.12.2029	1.100	2	0,00
					€ (1.039)	(0,54)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ (1.039)	(0,54)

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettver- mögens
BPS	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,195 %	02.11.2022	650	€ 0	€ 80	0,04
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	850	55	105	0,06
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	450	42	79	0,04
BRC	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	450	28	56	0,03
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,009	10.03.2022	700	55	38	0,02
GLM	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,009	10.03.2022	600	40	33	0,02
JPM	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	250	23	44	0,02
MYC	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,007	24.08.2021	7.600	23	3	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	610	38	76	0,04
							€ 304	€ 514	0,27

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	200	€ 1	€ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,156	05.08.2021	1.000	7	3	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	100	1	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	200	1	1	0,00
					€ 10	€ 4	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.08.2021	1.500	€ (1)	€ 0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.800	(2)	0	0,00
BPS	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	1.200	(1)	0	0,00
BRC	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	700	0	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	700	(1)	0	0,00
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	700	0	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	700	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.200	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	1.700	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.200	(1)	0	0,00
CBK	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	800	(1)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	1.000	(1)	0	0,00
DUB	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	3.500	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.600	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.600	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	2.300	(2)	(1)	0,00
FBF	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	300	0	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.800	(1)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	2.300	(2)	(1)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	900	(1)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.200	(1)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	800	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.300	(1)	0	0,00
					€ (29)	€ (6)	0,00	

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call – OTC USD versus CAD	CAD 1,265	11.02.2022	1.062	€ (10)	€ (11)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,002 %	26.05.2023	13.400	€ (57)	€ (47)	(0,03)
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,002	26.05.2023	13.400	(58)	(45)	(0,02)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	2.000	0	(76)	(0,04)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	2.490	(52)	(94)	(0,05)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	1.350	(41)	(77)	(0,04)
BRC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	1.310	(27)	(50)	(0,03)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,008	10.03.2022	1.800	(52)	(38)	(0,02)
DUB	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	1.260	(7)	(1)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	14.000	(18)	(6)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,008	10.03.2022	1.700	(41)	(36)	(0,02)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	750	(22)	(43)	(0,02)
JPM	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,006	24.08.2021	15.200	(20)	(1)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	2.840	(17)	(1)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	1.900	(40)	(72)	(0,04)
RYL	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,001	24.03.2022	34.600	(47)	(8)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,001	24.03.2022	34.600	(47)	(64)	(0,03)
							€ (547)	€ (659)	(0,34)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GSC	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,227	07.07.2021	200	€ (1)	€ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,023	07.09.2021	400	(2)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,023	07.09.2021	400	(1)	(2)	0,00
JPM	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	12.08.2021	3.000	(8)	(4)	(0,01)
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	300	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	2.000	(10)	(3)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 99,473	05.08.2021	200	€ (1)	€ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,047	07.07.2021	200	(1)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	104,047	07.07.2021	200	0	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	400	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	100	0	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,695	07.09.2021	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	2.000	(5)	(4)	0,00
					€ (32)	€ (16)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2021	\$ 23.430	€ 19.288	€ 0	€ (450)	€ (450)	(0,24)
	09.2021	273	CNY 1.759	0	(2)	(2)	0,00
	04.2022	DKK 41.929	€ 5.636	0	(2)	(2)	0,00
BPS	04.2022	1.400	188	0	0	0	0,00
BRC	08.2021	¥ 337.600	2.545	0	(19)	(19)	(0,01)
	07.2022	DKK 2.930	394	0	0	0	0,00
CBK	08.2021	£ 37	43	0	0	0	0,00
	11.2021	ILS 7.701	\$ 2.364	1	(5)	(4)	0,00
	01.2022	1.776	561	12	0	12	0,01
	02.2022	2.100	641	0	(5)	(5)	0,00
GLM	08.2021	AUD 1.221	€ 775	3	0	3	0,00
	08.2021	CAD 292	199	0	(12)	(12)	0,00
	08.2021	€ 1.555	NOK 15.760	0	(12)	(12)	(0,01)
	08.2021	229	SEK 2.325	0	0	0	0,00
	08.2021	3.740	\$ 4.588	125	0	125	0,06
	08.2021	£ 10.007	€ 11.647	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	NOK 7.940	781	3	0	3	0,00
	08.2021	NZD 2.260	1.337	7	0	7	0,00
	08.2021	SEK 8.245	815	2	0	2	0,00
	08.2021	\$ 337	278	0	(6)	(6)	0,00
	08.2021	1.584	NZD 2.254	0	(7)	(7)	0,00
	08.2021	1.040	SEK 9.023	13	0	13	0,01
	01.2022	ILS 1.900	\$ 580	0	(4)	(4)	0,00
	02.2022	CAD 259	214	4	0	4	0,00
HUS	08.2021	€ 1.545	AUD 2.424	0	(12)	(12)	(0,01)
	08.2021	\$ 245	€ 205	0	(2)	(2)	0,00
	09.2021	660	CNH 4.244	0	(6)	(6)	0,00
	09.2021	928	IDR 13.364.589	0	(15)	(15)	(0,01)
	01.2022	8.970	\$ 2.736	0	(21)	(21)	(0,01)
	04.2022	DKK 47.623	€ 6.400	0	(3)	(3)	0,00
	04.2022	€ 457	DKK 3.400	0	0	0	0,00
JPM	08.2021	CAD 1.076	€ 728	0	(4)	(4)	0,00
	08.2021	\$ 544	SEK 4.701	5	0	5	0,00
	04.2022	DKK 15.215	€ 2.045	0	(1)	(1)	0,00
	04.2022	€ 304	DKK 2.260	0	0	0	0,00
MYI	08.2021	1.669	CAD 2.461	5	0	5	0,00
	08.2021	\$ 1.026	€ 841	0	(24)	(24)	(0,01)
	04.2022	DKK 2.925	393	0	0	0	0,00
	04.2022	€ 286	DKK 2.125	0	0	0	0,00
RBC	08.2021	310	\$ 377	8	0	8	0,00
SCX	04.2022	DKK 4.815	€ 647	0	0	0	0,00
SOG	08.2021	€ 195	£ 168	1	0	1	0,00
	04.2022	413	DKK 3.075	0	0	0	0,00
UAG	08.2021	221	\$ 262	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 247	€ 202	0	(6)	(6)	0,00
				€ 189	€ (607)	€ (418)	(0,22)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ (592)	(0,31)
Summe Anlagen						€ 188.880	98,38
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 3.112	1,62
Nettovermögen						€ 191.992	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Wertpapier per Emissionstermin.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 379 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 2.693 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 187.714	€ 0	€ 187.714
Pensionsgeschäfte	0	1.900	0	1.900
Finanzderivate ⁽³⁾	1.114	(1.848)	0	(734)
Summen	€ 1.114	€ 187.766	€ 0	€ 188.880

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 186.567	€ 886	€ 187.453
Investmentfonds	0	10.189	0	10.189
Pensionsgeschäfte	0	168	0	168
Finanzderivate ⁽³⁾	293	993	(1)	1.285
Summen	€ 293	€ 197.917	€ 885	€ 199.095

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	€ (454)	€ 379	€ (75)
BPS	(75)	0	(75)
BRC	(16)	0	(16)
CBK	3	0	3
DUB	(3)	0	(3)
FBF	(1)	0	(1)
GLM	107	0	107
GSC	(3)	0	(3)
HUS	(59)	0	(59)
JPM	(8)	0	(8)
MYC	5	(120)	(115)
MYI	(19)	0	(19)
RBC	8	0	8
RYL	(72)	0	(72)
SOG	1	0	1
UAG	(6)	0	(6)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	94,63	86,31
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	3,14	15,94
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,49
Investmentfonds	k. A.	5,58
Pensionsgeschäfte	0,99	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,47	0,16
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,54)	0,29
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,31)	0,26
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(1,19)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	21,34	13,05
US-Regierungsbehörden	0,43	12,27
US-Schatzobligationen	1,92	1,35
Non-Agency-MBS	6,92	6,47
Forderungsbesicherte Wertpapiere	11,70	12,03
Staatsemissionen	53,68	55,96
Kurzfristige Instrumente	1,78	1,61
Investmentfonds	k. A.	5,58
Pensionsgeschäfte	0,99	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,47	0,16
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,54)	0,29
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,27	0,15
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Devisenoptionen	(0,01)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,34)	(0,13)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,22)	0,26
Sonstige Aktiva und Passiva	1,62	(9,12)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Short-Term Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BANKEN UND FINANZEN								BANKEN UND FINANZEN			
Aircastle Ltd. 5,500 % fällig am 15.02.2022	\$ 800	€ 695	0,10	Deutsche Pfandbriefbank AG 1,049 % fällig am 29.09.2023	£ 1.000	€ 1.185	0,17	QNB Finance Ltd. 1,256 % fällig am 12.02.2022	\$ 300	€ 254	0,04
AMCO – Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	€ 4.500	4.646	0,66	DNB Bank ASA 6,500 % fällig am 26.03.2022 (d)(e)	\$ 200	175	0,03	Realkredit Danmark A/S 2,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 25.400	3.507	0,50
American International Group, Inc. 1,500 % fällig am 08.06.2023	5.700	5.860	0,84	Euroclear Bank S.A. 0,500 % fällig am 10.07.2023	€ 200	203	0,03	Santander UK Group Holdings PLC 0,312 % fällig am 27.03.2024	€ 7.300	7.374	1,05
Aroundtown S.A. 0,375 % fällig am 23.09.2022	4.500	4.527	0,65	First Abu Dhabi Bank PJSC 1,134 % fällig am 16.04.2022	\$ 7.400	6.269	0,90	SBB Treasury Oyj 0,114 % fällig am 01.02.2023	2.500	2.505	0,36
Atrium European Real Estate Ltd. 3,625 % fällig am 17.10.2022	5.167	5.348	0,76	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 01.12.2021	€ 1.900	1.899	0,27	Scentre Group Trust 1,375 % fällig am 22.03.2023	2.900	2.969	0,42
Aviation Capital Group LLC 0,856 % fällig am 30.07.2021	\$ 200	169	0,02	0,000 % fällig am 07.12.2022	200	199	0,03	Societe Generale S.A. 0,000 % fällig am 06.03.2023	1.500	1.509	0,22
Balder Finland Oyj 0,055 % fällig am 14.06.2023	€ 1.350	1.352	0,19	1,068 % fällig am 12.10.2021	\$ 1.900	1.600	0,23	7,375 % fällig am 13.09.2021 (d)(e)	\$ 200	171	0,02
Banca Carige SpA 1,161 % fällig am 25.10.2021	7.000	7.021	1,00	1,514 % fällig am 17.02.2023	€ 100	102	0,01	Standard Chartered PLC 1,271 % fällig am 14.10.2023	2.200	1.874	0,27
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,250 % fällig am 20.01.2022	6.100	6.154	0,88	General Motors Financial Co., Inc. 0,012 % fällig am 26.03.2022	5.300	5.310	0,76	1,319 % fällig am 14.10.2023	1.100	937	0,13
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,750 % fällig am 11.09.2022	3.000	3.040	0,43	0,466 % fällig am 30.04.2024	14.100	14.248	2,04	2,744 % fällig am 10.09.2022	1.200	1.016	0,15
Banco BTG Pactual S.A. 5,500 % fällig am 31.01.2023	\$ 1.500	1.335	0,19	Hamburg Commercial Bank AG 0,750 % fällig am 23.11.2023	800	809	0,12	7,500 % fällig am 02.04.2022 (d)(e)	200	176	0,03
Banco de Sabadell S.A. 1,750 % fällig am 29.06.2023	€ 700	713	0,10	Hutchison Whampoa Europe Finance Ltd. 3,625 % fällig am 06.06.2022	600	621	0,09	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2,750 % fällig am 24.07.2023	€ 400	425	0,06
Banco Santander S.A. 6,250 % fällig am 11.09.2021 (d)(e)	100	101	0,01	Hutchison Whampoa Finance Ltd. 1,375 % fällig am 31.10.2021	2.100	2.111	0,30	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 0,508 % fällig am 12.01.2024	\$ 900	756	0,11
Bank of America Corp. 0,455 % fällig am 24.08.2025	6.200	6.310	0,90	IMMOFINANZ AG 2,625 % fällig am 27.01.2023	2.000	2.064	0,30	0,819 % fällig am 23.07.2023	€ 200	204	0,03
Barclays Bank PLC 6,625 % fällig am 30.03.2022	€ 2.700	2.836	0,41	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 1,000 % fällig am 09.09.2023	\$ 5.100	4.324	0,62	UBS AG 7,625 % fällig am 17.08.2022 (e)	\$ 650	590	0,08
9,500 % fällig am 07.08.2021	£ 1.340	1.575	0,23	ING Groep NV 6,875 % fällig am 16.04.2022 (d)(e)	600	527	0,08	UBS Group AG 5,750 % fällig am 19.02.2022 (d)(e)	€ 200	207	0,03
Barclays PLC 2,375 % fällig am 06.10.2023	600	714	0,10	Intesa Sanpaolo Bank Luxembourg S.A. 0,212 % fällig am 26.09.2021 (f)	€ 3.400	3.404	0,49	UniCredit SpA 1,000 % fällig am 18.01.2023	2.000	2.034	0,29
7,875 % fällig am 15.03.2022 (d)(e)	\$ 1.600	1.409	0,20	Intesa Sanpaolo SpA 0,413 % fällig am 19.04.2022	2.500	2.516	0,36	6,950 % fällig am 31.10.2022	4.000	4.362	0,62
7,875 % fällig am 15.09.2022 (d)(e)	€ 600	751	0,11	1,125 % fällig am 04.03.2022	4.000	4.040	0,58	7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 1.000	978	0,14
Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 1,400 % fällig am 06.07.2022	€ 4.600	4.651	0,66	JPMorgan Chase & Co. 1,500 % fällig am 26.10.2022	7.500	7.692	1,10	9,250 % fällig am 03.06.2022 (d)(e)	€ 600	644	0,09
BNP Paribas S.A. 0,208 % fällig am 07.06.2024	1.000	1.014	0,14	Land Securities Capital Markets PLC 1,974 % fällig am 08.02.2026	€ 1.500	1.793	0,26	Volkswagen Bank GmbH 0,934 % fällig am 01.08.2022	700	709	0,10
BOC Aviation Ltd. 3,000 % fällig am 23.05.2022	\$ 1.360	1.164	0,17	LeasePlan Corp. NV 0,750 % fällig am 03.10.2022	€ 4.300	4.353	0,62	Volkswagen Financial Services AG 0,625 % fällig am 01.04.2022	1.100	1.108	0,16
BPCE S.A. 0,000 % fällig am 23.03.2023	€ 800	805	0,12	1,000 % fällig am 25.02.2022	1.300	1.312	0,19	2,500 % fällig am 06.04.2023	400	418	0,06
4,625 % fällig am 18.07.2023	1.800	1.974	0,28	1,000 % fällig am 02.05.2023	1.200	1.227	0,18	Volkswagen Leasing GmbH 0,000 % fällig am 12.07.2023 (b)	2.300	2.304	0,33
CaixaBank S.A. 1,750 % fällig am 24.10.2023	1.200	1.250	0,18	Legal & General Group PLC 10,000 % fällig am 23.07.2041	€ 3.300	3.865	0,55	0,000 % fällig am 19.07.2024 (b)	3.000	2.998	0,43
3,750 % fällig am 15.02.2029	400	431	0,06	Lloyds Banking Group PLC 0,237 % fällig am 21.06.2024	€ 1.800	1.825	0,26	1,900 % fällig am 20.06.2022	1.900	1.914	0,27
Castellum AB 2,125 % fällig am 20.11.2023	200	210	0,03	Logicor Financing SARL 1,500 % fällig am 14.11.2022	4.226	4.304	0,62	Wells Fargo & Co. 2,125 % fällig am 22.04.2022	£ 5.000	5.902	0,84
China Construction Bank Europe S.A. 0,000 % fällig am 28.06.2024 (b)	600	600	0,09	Merlin Properties Socimi S.A. 2,225 % fällig am 25.04.2023	500	517	0,07	2,250 % fällig am 02.05.2023	€ 900	941	0,13
Citigroup, Inc. 0,000 % fällig am 21.03.2023	2.300	2.316	0,33	2,375 % fällig am 23.05.2022	1.000	1.017	0,15			274.125	39,19
CNP Assurances 7,375 % fällig am 30.09.2041	€ 4.000	4.735	0,68	Mizuho Financial Group, Inc. 0,000 % fällig am 10.04.2023	600	604	0,09	INDUSTRIEWERTE			
Cooperative Rabobank UA 4,125 % fällig am 14.09.2022	€ 200	210	0,03	MPT Operating Partnership LP 2,550 % fällig am 05.12.2023	€ 1.000	1.197	0,17	AA Bond Co. Ltd. 2,750 % fällig am 31.07.2043	£ 200	237	0,03
Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (e)	\$ 400	373	0,05	4,000 % fällig am 19.08.2022	€ 1.300	1.346	0,19	Aeroporti di Roma SpA 5,441 % fällig am 20.02.2023	1.600	1.991	0,28
Credit Suisse Group AG 7,125 % fällig am 29.07.2022 (d)(e)	1.200	1.057	0,15	Nasdaq, Inc. 1,750 % fällig am 19.05.2023	1.600	1.651	0,24	Alfa Laval Treasury International AB 1,375 % fällig am 12.09.2022	€ 3.400	3.452	0,49
7,500 % fällig am 17.07.2023 (d)(e)	600	552	0,08	Nationwide Building Society 1,000 % fällig am 24.01.2023	€ 1.100	1.293	0,18	Altice France S.A. 7,375 % fällig am 01.05.2026	\$ 200	176	0,03
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 1,250 % fällig am 14.04.2022	€ 10.300	10.413	1,49	Natwest Group PLC 2,000 % fällig am 08.03.2023	€ 5.861	5.949	0,85	Babcock International Group PLC 1,750 % fällig am 06.10.2022	€ 1.200	1.221	0,17
Dell Bank International DAC 0,625 % fällig am 17.10.2022	300	303	0,04	8,625 % fällig am 15.08.2021 (d)(e)	\$ 1.400	1.192	0,17	Bacardi Ltd. 2,750 % fällig am 03.07.2023	1.600	1.681	0,24
Deutsche Bank AG 0,625 % fällig am 19.12.2023	CHF 800	741	0,11	NatWest Markets PLC 0,625 % fällig am 02.03.2022	€ 9.600	9.670	1,38	Baidu, Inc. 3,875 % fällig am 29.09.2023	\$ 1.300	1.166	0,17
1,750 % fällig am 16.12.2021	€ 2.500	2.928	0,42	NE Property BV 2,625 % fällig am 22.05.2023	500	520	0,07	BAT Capital Corp. 0,000 % fällig am 16.08.2021	€ 7.100	7.103	1,02
1,875 % fällig am 14.02.2022	€ 6.100	6.180	0,88	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 2,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 30.700	4.226	0,60	BMW Finance NV 0,058 % fällig am 02.10.2023	1.900	1.919	0,27
2,375 % fällig am 11.01.2023	1.200	1.248	0,18	Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2050	130.200	17.955	2,57	0,125 % fällig am 13.07.2022	2.500	2.514	0,36
				PITCH 5,125 % fällig am 20.07.2022	€ 1.800	1.904	0,27	Boeing Co. 1,433 % fällig am 04.02.2024	\$ 200	169	0,02
				Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd. 3,950 % fällig am 05.02.2023	\$ 700	610	0,09	Booking Holdings, Inc. 2,150 % fällig am 25.11.2022	€ 1.800	1.851	0,26
								Bureau Veritas S.A. 1,250 % fällig am 07.09.2023	6.800	6.966	1,00
								Crown European Holdings S.A. 4,000 % fällig am 15.07.2022	400	412	0,06

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Daimler Canada Finance, Inc. 0,158 % fällig am 11.09.2022	€ 3.900	€ 3.927	0,56	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				Tower Bridge Funding PLC 1,419 % fällig am 20.09.2063	€ 1.730	€ 2.037	0,29
Daimler International Finance BV 0,000 % fällig am 11.01.2023	1.300	1.307	0,19	AT&T, Inc. 2,500 % fällig am 15.03.2023	€ 2.100	€ 2.185	0,31	Trinity Square PLC 0,899 % fällig am 15.07.2059	6.600	7.702	1,10
Daimler International Finance BV 0,625 % fällig am 27.02.2023	1.700	1.726	0,25	E.ON International Finance BV 5,500 % fällig am 06.07.2022	€ 900	1.102	0,16				
Dolphin Energy Ltd. LLC 5,500 % fällig am 15.12.2021	\$ 1.900	1.638	0,23	Global Switch Holdings Ltd. 1,500 % fällig am 31.01.2024	€ 3.600	3.720	0,53				
Eastern Creation Investment Holdings Ltd. 1,000 % fällig am 10.09.2023	1.100	927	0,13	Southern Power Co. 1,000 % fällig am 20.06.2022	1.700	1.722	0,25				
easyJet PLC 1,750 % fällig am 09.02.2023	€ 600	613	0,09	Telecom Italia SpA 5,875 % fällig am 19.05.2023	€ 2.300	2.907	0,41				
Fidelity National Information Services, Inc. 0,125 % fällig am 03.12.2022	2.500	2.513	0,36			11.636	1,66				
Fidelity National Information Services, Inc. 0,750 % fällig am 21.05.2023	1.600	1.626	0,23	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		404.912	57,88				
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	5.700	5.901	0,84	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 3,125 % fällig am 17.11.2023	2.600	2.745	0,39	Freddie Mac 0,650 % fällig am 27.10.2025	\$ 3.900	3.265	0,47	Accunia European CLO DAC 0,930 % fällig am 15.10.2030	€ 400	400	0,06
General Mills, Inc. 1,200 % fällig am 17.10.2023	\$ 100	86	0,01	Freddie Mac 0,800 % fällig am 28.10.2026	4.200	3.523	0,50	Aqueduct European CLO DAC 0,640 % fällig am 20.07.2030	1.900	1.903	0,27
Glencore Finance Europe Ltd. 6,000 % fällig am 03.04.2022	€ 5.000	6.061	0,87			6.788	0,97	1,450 % fällig am 20.04.2032	1.300	1.304	0,19
Greif Nevada Holdings, Inc. SCS 7,375 % fällig am 15.07.2021	€ 1.000	1.002	0,14	NON-AGENCY-MBS				Arbour CLO DAC 0,580 % fällig am 15.03.2029	207	207	0,03
Harvest Operations Corp. 1,000 % fällig am 26.04.2024	\$ 800	675	0,10	Atlas Funding PLC 0,951 % fällig am 25.07.2058	€ 500	586	0,08	Ares European CLO DAC 0,660 % fällig am 15.10.2030	5.700	5.696	0,82
Imperial Brands Finance PLC 9,000 % fällig am 17.02.2022	€ 5.800	7.112	1,02	Avon Finance No. 2 PLC 0,949 % fällig am 20.09.2048	2.624	3.067	0,44	Aurium CLO DAC 0,670 % fällig am 16.04.2030	2.800	2.800	0,40
Informa PLC 1,500 % fällig am 05.07.2023	€ 3.600	3.708	0,53	Bluestep Mortgage Securities DAC 0,188 % fällig am 10.08.2066	€ 752	752	0,11	Auto ABS UK Loans 0,710 % fällig am 27.11.2027	€ 3.429	4.001	0,57
International Flavors & Fragrances, Inc. 0,500 % fällig am 25.09.2021	2.200	2.203	0,32	Canada Square Funding PLC 1,149 % fällig am 17.10.2051	€ 1.703	1.995	0,28	Bain Capital Euro DAC 0,740 % fällig am 20.01.2032	€ 3.800	3.796	0,54
Kinder Morgan, Inc. 1,500 % fällig am 16.03.2022	1.300	1.317	0,19	Canterbury Finance PLC 1,050 % fällig am 16.05.2057	1.404	1.643	0,23	BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	3.760	3.772	0,54
Kraft Heinz Foods Co. 2,000 % fällig am 30.06.2023	300	310	0,04	1,399 % fällig am 16.05.2056	1.300	1.530	0,22	Black Diamond CLO DAC 0,860 % fällig am 20.01.2032	200	200	0,03
Marks & Spencer PLC 7,375 % fällig am 06.12.2021	€ 1.600	1.920	0,27	Darrowby No. 5 PLC 0,579 % fällig am 20.12.2057	533	626	0,09	Blackrock European CLO DAC 0,620 % fällig am 15.10.2031	7.800	7.766	1,11
McDonald's Corp. 1,125 % fällig am 26.05.2022	€ 1.600	1.621	0,23	Dilosk RMBS DAC 0,197 % fällig am 20.02.2060	€ 1.285	1.293	0,18	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 0,650 % fällig am 15.07.2030	1.000	1.003	0,14
Medtronic Global Holdings S.C.A. 0,000 % fällig am 15.03.2023 (b)	3.600	3.621	0,52	Durham Mortgages B PLC 0,688 % fällig am 31.03.2054	€ 501	584	0,08	BNPP AM Euro CLO BV 0,600 % fällig am 15.04.2031	200	200	0,03
Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	6.300	6.564	0,94	Dutch Property Finance BV 0,111 % fällig am 28.07.2054	€ 262	263	0,04	Cairn CLO BV 0,670 % fällig am 31.01.2030	2.100	2.101	0,30
Origin Energy Finance Ltd. 3,500 % fällig am 04.10.2021	1.700	1.717	0,25	Economic Master Issuer PLC 0,520 % fällig am 25.06.2072	€ 700	819	0,12	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,730 % fällig am 21.09.2029	119	119	0,02
Ryanair DAC 1,125 % fällig am 15.08.2023	4.700	4.809	0,69	Fingal Securities RMBS DAC 0,462 % fällig am 28.07.2055	€ 2.083	2.097	0,30	Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC 0,269 % fällig am 15.12.2029	1.400	1.410	0,20
Schaeffler AG 1,125 % fällig am 26.03.2022	1.800	1.813	0,26	Finsbury Square PLC 0,849 % fällig am 16.03.2070	€ 1.052	1.230	0,18	Contego CLO DAC 0,640 % fällig am 23.01.2030	1.000	998	0,14
SIG Combibloc Purchase Co. SARL 1,875 % fällig am 26.03.2024	5.200	5.389	0,77	1,052 % fällig am 16.06.2069	157	183	0,03	Driver Australia Five Trust 0,942 % fällig am 21.07.2026	AUD 162	102	0,02
SIG Combibloc Purchase Co. SARL 1,875 % fällig am 18.06.2023	1.500	1.553	0,22	Friary No. 6 PLC 0,769 % fällig am 21.11.2067	746	877	0,13	Driver Australia Six Trust 0,912 % fällig am 21.12.2027	341	217	0,03
Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,375 % fällig am 01.02.2024	100	106	0,02	Harben Finance PLC 0,881 % fällig am 20.08.2056	2.552	2.979	0,43	Dryden Euro CLO BV 0,660 % fällig am 15.12.2033	€ 3.100	3.089	0,44
Syngenta Finance NV 1,875 % fällig am 02.11.2021	1.500	1.502	0,22	Lanebrook Mortgage Transaction PLC 1,149 % fällig am 12.06.2057	2.549	2.995	0,43	Euro-Galaxy CLO DAC 0,620 % fällig am 24.04.2034	1.000	999	0,14
TDF Infrastructure SASU 2,875 % fällig am 19.10.2022	800	825	0,12	London Wall Mortgage Capital PLC 0,936 % fällig am 15.11.2049	93	108	0,02	FACT Master S.A. 0,000 % fällig am 20.11.2025	2.115	2.113	0,30
Teleperformance 1,500 % fällig am 03.04.2024	3.600	3.734	0,53	Mulcair Securities DAC 0,461 % fällig am 24.04.2071	€ 328	329	0,05	Harvest CLO DAC 0,640 % fällig am 15.10.2031	3.200	3.198	0,46
Tesco Corporate Treasury Services PLC 1,375 % fällig am 24.10.2023	2.800	2.888	0,41	Paragon Mortgages PLC 1,099 % fällig am 15.05.2045	€ 1.231	1.446	0,21	0,650 % fällig am 26.06.2030	1.600	1.598	0,23
Ubisoft Entertainment S.A. 1,289 % fällig am 30.01.2023	2.100	2.136	0,31	Precise Mortgage Funding PLC 0,980 % fällig am 16.10.2056	81	94	0,01	Hayfin Emerald CLO DAC 1,450 % fällig am 15.02.2033	1.900	1.904	0,27
Worldline S.A. 0,500 % fällig am 30.06.2023	1.600	1.621	0,23	Primrose Residential 0,200 % fällig am 24.03.2061	€ 3.578	3.577	0,51	Jubilee CLO BV 0,295 % fällig am 12.07.2028	474	474	0,07
WPP Finance 3,000 % fällig am 20.11.2023	1.000	1.077	0,15	Residential Mortgage Securities PLC 1,299 % fällig am 20.06.2070	€ 88	104	0,01	Laurelin DAC 0,720 % fällig am 20.10.2031	8.000	7.993	1,14
		119.151	17,03	Ripon Mortgages PLC 0,881 % fällig am 20.08.2056	3.904	4.557	0,65	Mackay Shields Euro CLO DAC 1,550 % fällig am 15.08.2033	800	801	0,12
				Stratton Mortgage Funding PLC 0,901 % fällig am 25.09.2051	3.173	3.707	0,53	Man GLG Euro CLO DAC 0,680 % fällig am 15.10.2030	1.050	1.052	0,15
				0,948 % fällig am 20.07.2060	3.355	3.924	0,56	0,870 % fällig am 15.01.2030	400	400	0,06
				1,249 % fällig am 25.05.2051	326	381	0,05	North Westery CLO BV 0,910 % fällig am 20.04.2031	2.100	2.102	0,30
				Towd Point Mortgage Funding PLC 1,111 % fällig am 20.10.2051	4.782	5.601	0,80	Oak Hill European Credit Partners Ltd. 0,900 % fällig am 22.07.2030	300	300	0,04
								Palmer Square European Loan Funding DAC 0,870 % fällig am 15.02.2030	525	525	0,08
								PCL Funding PLC 0,800 % fällig am 15.10.2025	€ 800	935	0,13
								Sorrento Park CLO DAC 0,409 % fällig am 16.11.2027	€ 164	164	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Short-Term Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
St Paul's CLO DAC				Nomura Bank International PLC				GERMANY TREASURY BILLS			
0,850 % fällig am 25.04.2030	€ 500	€ 501	0,07	(0,375) % fällig am 14.10.2021	€ 2.500	€ 2.503	0,36	(0,657) % fällig am			
Toro European CLO DAC				(0,365) % fällig am 15.11.2021	1.000	1.001	0,14	25.08.2021 (b)(c)	€ 9.400	€ 9.410	1,34
0,740 % fällig am 15.10.2030	500	500	0,07	Pure Finance S.A.				(0,656) % fällig am			
		66.643	9,53	0,152 % fällig am 05.08.2021	200	200	0,03	28.07.2021 (b)(c)	1.740	1.741	0,25
STAATSEMISSIONEN				0,152 % fällig am 20.08.2021	400	400	0,06	(0,656) % fällig am	1.550	1.553	0,22
Autonomous Community of Catalonia				0,152 % fällig am 05.10.2021	400	400	0,06	27.10.2021 (b)(c)			
4,900 % fällig am 15.09.2021	12.950	13.086	1,87	0,152 % fällig am 16.11.2021	CHF 200	191	0,03	(0,652) % fällig am			
Fukuoka Prefecture				0,152 % fällig am 16.12.2021	€ 100	100	0,01	28.07.2021 (b)(c)	2.580	2.581	0,37
0,880 % fällig am 22.06.2022	¥ 680.000	5.211	0,75	0,203 % fällig am 25.08.2021	€ 400	400	0,06	(0,644) % fällig am			
Gemeinsame Kommunalanleihe NRW				0,203 % fällig am 25.08.2021 (a)	€ 600	600	0,08	29.09.2021 (b)(c)	760	761	0,11
1,250 % fällig am 17.06.2022	€ 1.200	1.219	0,17	0,401 % fällig am 14.12.2021	€ 100	116	0,02	(0,624) % fällig am	3.700	3.704	0,53
Infraestruturas de Portugal S.A.				0,411 % fällig am 21.12.2021	100	116	0,02	25.08.2021 (b)(c)		19.750	2,82
4,250 % fällig am 13.12.2021	7.300	7.444	1,06	0,441 % fällig am 09.08.2021	200	233	0,03	ISRAEL TREASURY BILLS			
Israel Government International Bond				0,441 % fällig am 07.10.2021	200	233	0,03	(0,028) % fällig am			
0,000 % fällig am 22.07.2022				0,451 % fällig am 08.09.2021	100	116	0,02	16.12.2021 (b)(c)	ILS 5.500	1.423	0,20
(b)	7.100	7.123	1,02	0,451 % fällig am 17.09.2021	€ 400	466	0,07	0,020) % fällig am			
0,750 % fällig am 31.07.2022	ILS 4.100	1.069	0,15	0,487 % fällig am 14.09.2021	\$ 100	84	0,01	02.02.2022 (b)(c)	5.100	1.320	0,19
5,500 % fällig am 31.01.2022	14.300	3.821	0,55	0,508 % fällig am 14.12.2021	100	84	0,01	0,000 % fällig am 06.04.2022 (b)(c)	13.000	3.364	0,48
Morocco Government International Bond				0,549 % fällig am 10.11.2021	600	505	0,07			6.107	0,87
4,250 % fällig am 11.12.2022	\$ 7.200	6.385	0,91	0,559 % fällig am 06.08.2021	300	253	0,04	JAPAN TREASURY BILLS			
Poland Government International Bond				0,559 % fällig am 19.08.2021	300	253	0,04	(0,105) % fällig am			
0,000 % fällig am 07.07.2023				0,651 % fällig am 08.07.2021	200	169	0,02	16.12.2021 (b)(c)	¥ 1.830.000	13.910	1,99
(b)	€ 3.100	3.126	0,45	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	€ 3.600	3.601	0,51	10,08.2021 (b)(c)	3.200.000	24.315	3,47
Saudi Government International Bond				0,051 % fällig am 10.09.2021		13.124	1,88			38.225	5,46
0,000 % fällig am 03.03.2024				KURZFRISTIGE SCHULDITITEL				Summe kurzfristige Instrumente		88.519	12,65
(b)	7.800	7.798	1,12	Pacific Gas and Electric Co.				Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 686.589	98,15	
2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 300	255	0,04	1,531 % fällig am 15.11.2021	\$ 4.400	3.718	0,53				
South Africa Government International Bond				FRANCE TREASURY BILLS							
5,875 % fällig am 30.05.2022	4.600	4.069	0,58	(0,688) % fällig am							
Tokyo Metropolitan Government				20.10.2021 (b)(c)	€ 600	601	0,09				
0,770 % fällig am 20.12.2022	¥ 80.000	615	0,09	(0,675) % fällig am	800	802	0,11				
Ukraine Government International Bond				20.10.2021 (b)(c)	900	902	0,13				
7,750 % fällig am 01.09.2022	\$ 1.600	1.420	0,20	(0,674) % fällig am	2.790	2.790	0,40				
		62.641	8,96	20.10.2021 (b)(c)							
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				(0,641) % fällig am							
COMMERCIAL PAPER				07.07.2021 (b)(c)	760	760	0,11				
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				(0,638) % fällig am							
(0,101) % fällig am 16.09.2021	€ 1.100	1.100	0,16	21.07.2021 (b)(c)	1.740	1.740	0,25				
				(0,631) % fällig am							
				07.07.2021 (b)(c)		7.595	1,09				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettover-mögens
RYL	(1,000) %	30.06.2021	01.07.2021	€ 9.600	Austria Government International Bond 2,100 % fällig am 20.09.2117	€ (9.629)	€ 9.600	€ 9.600	1,37
Summe Pensionsgeschäfte						€ (9.629)	€ 9.600	€ 9.600	1,37

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend², außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von EUR 171,500 auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	47	€ 31	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	1.405	22	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von EUR 171,500 auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	47	41	0,01
				€ 94	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 94	0,01

(1) Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,490 %	20.07.2068	€ 4.100	€ 2.277	0,33
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,510	20.07.2068	4.100	(2.285)	(0,33)
					€ (8)	0,00
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ (8)	0,00

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettover- mögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 100,156	05.08.2021	2.000	€ 16	€ 5	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	2.000	15	7	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	3.000	14	9	0,00
					€ 45	€ 21	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BPS	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800 %	15.09.2021	7.200	€ (8)	€ (2)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	5.800	(5)	(1)	0,00
DUB	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	5.800	(5)	(1)	0,00
GST	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	7.600	(9)	0	0,00
JPM	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	21.000	(21)	(11)	0,00
					€ (48)	€ (15)	0,00	

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
RYL	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,001 %	24.03.2022	65.800	€ (88)	€ (15)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,001	24.03.2022	65.800	(88)	(121)	(0,02)
					€ (176)	€ (136)	(0,02)		

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
GSC	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 101,367	05.08.2021	2.300	€ (6)	€ (5)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,023	07.09.2021	3.000	(16)	(9)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,023	07.09.2021	3.000	(11)	(14)	(0,01)
JPM	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	12.08.2021	7.000	(18)	(10)	0,00
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	7.000	(19)	(10)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	4.000	(21)	(5)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	4.000	(21)	(7)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,313	07.09.2021	2.000	(5)	(7)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	2.300	(7)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	6.000	(15)	(7)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	2.300	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	2.000	(3)	(3)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,695	07.09.2021	2.000	(5)	(3)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	2.000	(5)	(4)	0,00
					€ (156)	€ (87)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Short-Term Fund (Forts.)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert unahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	09.2021	\$	€	82	0	(2)	0,00
	10.2021	£	€	231	0	(1)	0,00
	11.2021	CHF	€	92	0	0	0,00
BPS	07.2021	€	£	2.166	5	0	0,00
	07.2021	€	\$	7.537	179	0	0,02
	07.2021	£	€	104.826	0	(153)	(0,02)
BRC	04.2022	€	DKK	585	0	0	0,00
	08.2021	¥	€	30.108	0	(57)	(0,01)
	04.2022	DKK	€	1.410	0	(1)	0,00
CBK	07.2022	€	€	605	0	0	0,00
	11.2021	ILS	\$	1.691	2	(3)	0,00
	01.2022	€	€	2.388	20	(5)	0,00
	02.2022	€	€	1.555	0	(13)	0,00
	04.2022	DKK	€	1.522	0	(1)	0,00
GLM	04.2022	ILS	\$	3.970	0	(31)	0,00
	07.2022	DKK	€	954	0	0	0,00
	08.2022	ILS	\$	338	0	(6)	0,00
	07.2021	DKK	€	25.715	0	(3)	0,00
	07.2021	£	€	809	2	0	0,00
HUS	01.2022	ILS	\$	1.815	2	(6)	0,00
	08.2021	AUD	€	357	3	0	0,00
	08.2021	CHF	€	745	2	0	0,00
	12.2021	£	€	116	0	0	0,00
	01.2022	ILS	\$	193	0	(1)	0,00
JPM	04.2022	DKK	€	721	0	(1)	0,00
	01.2022	€	€	631	0	(1)	0,00
	01.2022	ILS	\$	325	0	0	0,00
	08.2022	€	€	941	0	0	0,00
	07.2021	€	€	1.337	35	0	0,01
RBC	07.2021	\$	€	1.002	0	(30)	0,00
RYL	12.2021	¥	€	13.911	33	0	0,00
SCX	07.2021	€	£	88.623	120	0	0,02
	07.2021	\$	€	72.693	0	(2.297)	(0,33)
	08.2021	£	€	103.117	0	(119)	(0,02)
SOG	07.2022	DKK	€	524	0	(1)	0,00
	01.2022	€	DKK	4.700	0	0	0,00
	04.2022	€	€	26.600	2	0	0,00
SSB	07.2022	€	€	15.500	1	0	0,00
	07.2021	\$	€	72	0	(2)	0,00
						€	(0,33)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€	(2.545)
Summe Anlagen						€	693.730
Sonstige Aktiva und Passiva						€	5.798
Nettovermögen						€	699.528

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (f) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettover- mögens
Intesa Sanpaolo Bank Luxembourg S.A.	0,212 %	26.09.2021	01.07.2020 - 06.08.2020	€ 3.399	€ 3.404	0,49

Barmittel in Höhe von EUR 730 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von EUR 2.040 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 686.589	€ 0	€ 686.589
Pensionsgeschäfte	0	9.600	0	9.600
Finanzderivate ⁽³⁾	94	(2.553)	0	(2.459)
Summen	€ 94	€ 693.636	€ 0	€ 693.730

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 735.203	€ 3.876	€ 739.079
Pensionsgeschäfte	0	62.900	0	62.900
Finanzderivate ⁽³⁾	22	1.988	(6)	2.004
Summen	€ 22	€ 800.091	€ 3.870	€ 803.983

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	€ (3)	€ 0	€ (3)
BPS	29	0	29
BRC	(59)	0	(59)
CBK	(37)	0	(37)
DUB	(1)	0	(1)
GLM	(5)	0	(5)
GSC	(28)	0	(28)
HUS	3	0	3
JPM	(50)	80	30
MYI	35	0	35
RBC	(30)	0	(30)
RYL	(103)	0	(103)
SCX	(2.297)	1.960	(337)
SOG	3	0	3
SSB	(2)	0	(2)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,33	77,45
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	10,82	12,73
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	1,34
Pensionsgeschäfte	1,37	7,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,36)	0,25
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,20)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	57,88	54,96
US-Regierungsbehörden	0,97	1,62
Non-Agency-MBS	8,16	7,60
Forderungsbesicherte Wertpapiere	9,53	5,14
Staatsemissionen	8,96	5,41
Kurzfristige Instrumente	12,65	16,79
Pensionsgeschäfte	1,37	7,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,00	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Short-Term Fund (Forts.)

30. Juni 2021

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,02)	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,33)	0,27
Sonstige Aktiva und Passiva	0,83	0,44
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO European High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Banco Santander S.A. 4,375 % fällig am 14.01.2026 (e)(g)	€ 600	€ 621	0,37	TalkTalk Telecom Group PLC 3,875 % fällig am 20.02.2025	£ 2.800	3.222	1,94	Summer BC Bidco LLC 5,500 % fällig am 31.10.2026 (a)	\$ 200	172	0,10
Neinor Homes S.A. 4,500 % fällig am 15.10.2026	900	924	0,56	Victoria PLC 3,625 % fällig am 24.08.2026	€ 800	€ 812	0,49	United Airlines Pass-Through Trust 2,900 % fällig am 01.11.2029	573	483	0,29
Via Celere Desarrollos Inmobiliarios S.A. 5,250 % fällig am 01.04.2026	900	939	0,56	Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£ 1.600	1.862	1,12	5,875 % fällig am 15.04.2029	952	892	0,54
Summe Spanien		4.124	2,48	Virgin Money UK PLC 9,250 % fällig am 08.06.2024 (e)(g)	800	1.089	0,66	United Airlines, Inc. 4,375 % fällig am 15.04.2026	\$ 100	€ 87	0,05
SCHWEDEN				Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % fällig am 31.01.2031	€ 100	101	0,06	4,625 % fällig am 15.04.2029	100	87	0,05
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,000 % fällig am 31.01.2029	£ 100	115	0,07				
Domestic Group AB 3,000 % fällig am 08.05.2026	1.500	1.597	0,96	4,250 % fällig am 31.01.2031	\$ 200	166	0,10				
Intrum AB 3,125 % fällig am 15.07.2024	600	604	0,36	Summe Großbritannien		22.067	13,28	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
3,500 % fällig am 15.07.2026	1.650	1.686	1,02	USA				INEOS Finance PLC 2,500 % fällig am 01.04.2024	€ 2.593	2.582	1,55
4,875 % fällig am 15.08.2025	1.100	1.158	0,70	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 3,500 % fällig am 30.06.2025	1.287	1.291	0,78
Verisure Holding AB 3,250 % fällig am 15.02.2027	1.000	1.002	0,60	American Airlines Pass-Through Trust 3,350 % fällig am 15.04.2031	251	216	0,13	Zayo Group Holdings, Inc. 3,250 % fällig am 09.03.2027	992	988	0,60
Verisure Midholding AB 5,250 % fällig am 15.02.2029	500	515	0,31	3,375 % fällig am 01.11.2028	526	442	0,27				
Summe Schweden		6.562	3,95	3,700 % fällig am 01.04.2028	517	444	0,27	Summe USA		26.222	15,78
GROSSBRITANNIEN				Avantor Funding, Inc. 3,875 % fällig am 01.04.2026	€ 1.000	1.057	0,64	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Bausch Health Americas, Inc. 9,250 % fällig am 01.04.2026	\$ 900	826	0,50	FRANCE TREASURY BILLS			
eG Global Finance PLC 4,375 % fällig am 07.02.2025	1.200	1.187	0,71	Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 1.700	1.710	1,03	(0,641) % fällig am 07.07.2021 (c)(d)	660	660	0,40
EnQuest PLC (7,000 % bar oder 7,000 % PIK) 7,000 % fällig am 15.10.2023 (b)	\$ 1.139	898	0,54	4,000 % fällig am 15.04.2023	1.600	1.591	0,96	(0,639) % fällig am 07.07.2021 (c)(d)	210	210	0,13
Heathrow Finance PLC 4,375 % fällig am 01.03.2027	€ 1.100	1.320	0,79	Fenix Marine Service Holdings Ltd. 8,000 % fällig am 15.01.2024	\$ 900	832	0,50	(0,636) % fällig am 04.08.2021 (c)(d)	160	160	0,09
INEOS Quattro Finance PLC 3,375 % fällig am 15.01.2026	\$ 1.900	1.625	0,98	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 07.12.2022	€ 1.200	1.194	0,72	(0,631) % fällig am 07.07.2021 (c)(d)	80	80	0,05
International Game Technology PLC 2,375 % fällig am 15.04.2028	€ 1.400	1.375	0,83	0,157 % fällig am 01.12.2024	2.600	2.534	1,52	(0,628) % fällig am 07.07.2021 (c)(d)	120	120	0,07
Jaguar Land Rover Automotive PLC 4,500 % fällig am 15.01.2026	800	850	0,51	2,386 % fällig am 17.02.2026	1.500	1.560	0,94	(0,628) % fällig am 25.08.2021 (c)(d)	290	290	0,17
5,000 % fällig am 15.02.2022	€ 1.000	1.191	0,72	3,250 % fällig am 15.09.2025	200	215	0,13	Summe kurzfristige Instrumente		2.066	1,24
5,875 % fällig am 15.11.2024	€ 300	330	0,20	Mauser Packaging Solutions Holding Co. 4,750 % fällig am 15.04.2024	1.800	1.802	1,08	GERMANY TREASURY BILLS			
7,750 % fällig am 15.10.2025	\$ 900	835	0,50	Occidental Petroleum Corp. 6,625 % fällig am 01.09.2030	\$ 1.000	1.013	0,61	(0,653) % fällig am 28.07.2021 (c)(d)(h)	544	546	0,33
Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	€ 200	243	0,15	Organon Finance LLC 2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 500	508	0,30	Summe übertragbare Wertpapiere	€ 149.088	89,72	
4,500 % fällig am 10.07.2027	705	881	0,53	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	\$ 1.632	1.594	0,96	AKTIEN			
Miller Homes Group Holdings PLC 5,500 % fällig am 15.10.2024	1.400	1.669	1,00	Scientific Games International, Inc. 3,375 % fällig am 15.02.2026	€ 900	905	0,54	INVESTMENTFONDS			
Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 2.100	2.296	1,38	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	1.200	1.197	0,72	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
								PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	103.300	10.100	6,08
								Summe Investmentfonds	€ 10.100	6,08	

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2021	102	€ 7	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	16	18	0,01
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2021	217	(5)	0,00
				€ 20	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 20	0,01

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 35 5-Year Index	5,000 %	20.06.2026	€ 4.900	€ 50	0,03

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000 %	17.06.2022	\$ 3.700	€ 23	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2025	3.800	73	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2030	2.600	95	0,06
						€ 191	0,12
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						€ 241	0,15

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens		
BOA	07.2021	£ 813	€ 945	€ 0	€ (2)	€ (2)	0,00		
BPS	07.2021	\$ 108	€ 89	0	(2)	(2)	0,00		
MYI	07.2021	€ 1.017	\$ 1.223	14	0	14	0,01		
	07.2021	\$ 121	€ 99	0	(3)	(3)	0,00		
SCX	07.2021	€ 16.948	£ 14.566	19	0	19	0,01		
	07.2021	£ 13.842	€ 16.004	0	(121)	(121)	(0,08)		
	07.2021	\$ 16.641	€ 13.603	0	(429)	(429)	(0,26)		
	08.2021	£ 14.574	€ 16.948	0	(20)	(20)	(0,01)		
						€ 33	€ (577)	€ (544)	(0,33)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ (544)	(0,33)		
Summe Anlagen						€ 158.905	95,63		
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 7.265	4,37		
Nettvermögen						€ 166.170	100,00		

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- Wertpapier per Emissionstermin.
- Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- Mit dem Fonds verbunden.
- Bedingt wandelbares Wertpapier.
- Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 544 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 858 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 149.088	€ 0	€ 149.088
Investmentfonds	0	10.100	0	10.100
Finanzderivate ⁽³⁾	20	(303)	0	(283)
Summen	€ 20	€ 158.885	€ 0	€ 158.905

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 133.203	€ 0	€ 133.203
Investmentfonds	0	10.121	0	10.121
Finanzderivate ⁽³⁾	(5)	222	0	217
Summen	€ (5)	€ 143.546	€ 0	€ 143.541

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	€ (2)	€ 0	€ (2)
BPS	(2)	0	(2)
MYI	11	0	11
SCX	(551)	544	(7)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	80,55	70,26
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	4,46	6,15
Sonstige übertragbare Wertpapiere	4,71	5,77
Investmentfonds	6,08	6,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,15	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,33)	0,13

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Belgien	0,72	0,37
Kanada	0,42	0,38
Dänemark	0,61	0,64
Finnland	0,50	0,11
Frankreich	8,82	10,04
Deutschland	7,31	6,47
Irland	0,61	2,14
Italien	6,84	8,08
Japan	0,92	1,83
Jersey, Kanalinseln	4,14	2,71
Luxemburg	10,02	9,64
Mexiko	2,13	2,66
Multinational	0,54	0,36
Niederlande	7,46	6,09
Norwegen	k. A.	0,95
Panama	0,92	k. A.
Rumänien	1,03	1,05
Spanien	2,48	2,05
Schweden	3,95	1,97
Großbritannien	13,28	10,73
USA	15,78	13,91
Kurzfristige Instrumente	1,24	k. A.
Investmentfonds	6,08	6,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,03	0,01
Zinsswaps	0,12	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,33)	0,14
Sonstige Aktiva und Passiva	4,37	11,43
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				EUROPÄISCHE FINANZSTABILISIERUNGSFÄHIGKEIT				PERMANENT TSB GROUP HOLDINGS PLC				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,000 % fällig am 20.01.2031 (b)				2,125 % fällig am 26.09.2024				
BANKEN UND FINANZEN				Europäische Union				Realkredit Danmark A/S				
ABN AMRO Bank NV	€ 1.000	€ 1.084	0,26	0,000 % fällig am 06.07.2026 (a)(b)	600	612	0,15	1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	3.192	405	0,10
4,375 % fällig am 22.09.2025 (e)(g)				0,000 % fällig am 02.06.2028 (b)	200	203	0,05	1,500 % fällig am 01.10.2053		5.500	728	0,18
Altarea S.C.A.	900	901	0,22	0,000 % fällig am 04.07.2029 (b)	2.100	2.123	0,52	Sagax AB				
1,750 % fällig am 16.01.2030				0,000 % fällig am 04.07.2031 (b)	2.100	2.096	0,51	1,125 % fällig am 30.01.2027	€	1.300	1.329	0,32
1,875 % fällig am 17.01.2028	600	622	0,15	0,200 % fällig am 04.06.2036	500	488	0,12	Santander UK Group Holdings PLC				
AMCO – Asset Management Co. SpA	900	929	0,23	0,250 % fällig am 22.04.2036	3.600	3.533	0,86	7,375 % fällig am 24.06.2022 (e)(g)	£	200	246	0,06
1,500 % fällig am 17.07.2023				0,300 % fällig am 04.11.2050	50	45	0,01	SBB Treasury Oyj				
American Honda Finance Corp.	800	807	0,20	0,450 % fällig am 02.05.2046	100	97	0,02	0,114 % fällig am 01.02.2023	€	1.400	1.403	0,34
0,350 % fällig am 26.08.2022				0,750 % fällig am 04.01.2047	500	515	0,12	Sirius Real Estate Ltd.				
AXA S.A.	€ 400	540	0,13	FCE Bank PLC	£ 1.100	1.301	0,32	1,125 % fällig am 22.06.2026		400	399	0,10
5,453 % fällig am 04.03.2026 (e)				2,727 % fällig am 03.06.2022				Societe Generale S.A.		2.900	2.917	0,71
Balder Finland Oyj	€ 800	801	0,19	Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 400	337	0,08	0,309 % fällig am 01.04.2022		200	171	0,04
0,055 % fällig am 14.06.2023				1,068 % fällig am 12.10.2021	€ 400	407	0,10	7,375 % fällig am 13.09.2021 (e)(g)	\$	300	283	0,07
Banca Carige SpA	3.400	3.410	0,83	1,744 % fällig am 19.07.2024	€ 900	1.065	0,26	7,875 % fällig am 18.12.2023 (e)(g)				
1,161 % fällig am 25.10.2021				2,748 % fällig am 14.06.2024				Standard Chartered PLC		500	426	0,10
Banco BTG Pactual S.A.	\$ 1.100	973	0,24	GE Capital UK Funding Unlimited Co.	200	251	0,06	1,319 % fällig am 14.10.2023		400	338	0,08
4,500 % fällig am 10.01.2025				4,125 % fällig am 13.09.2023				1,328 % fällig am 10.09.2022				
Bank of China Ltd.	1.400	1.187	0,29	Globalworth Real Estate Investments Ltd.	€ 100	108	0,03	Swedbank AB		200	174	0,04
0,950 % fällig am 21.09.2023				3,000 % fällig am 29.03.2025				6,000 % fällig am 17.03.2022 (e)(g)				
Bank of Ireland Group PLC	€ 600	710	0,17	Goldman Sachs Group, Inc.	600	600	0,15	UBS AG		850	771	0,19
7,500 % fällig am 19.05.2025 (e)(g)				0,084 % fällig am 09.09.2022	1.200	1.213	0,30	7,625 % fällig am 17.08.2022 (g)				
Barclays Bank PLC	\$ 500	460	0,11	0,466 % fällig am 30.04.2024	1.300	1.318	0,32	UBS Group AG		300	284	0,07
7,625 % fällig am 21.11.2022 (g)				4,750 % fällig am 12.10.2021				4,125 % fällig am 15.04.2026		800	679	0,16
Barclays PLC	£ 300	378	0,09	Hutchison Whampoa Finance Ltd.	700	704	0,17	7,125 % fällig am 10.08.2021 (e)(g)				
7,250 % fällig am 15.03.2023 (e)(g)				1,375 % fällig am 31.10.2021				UniCredit SpA		500	425	0,10
7,875 % fällig am 15.03.2022 (e)(g)	\$ 400	352	0,09	ING Groep NV	\$ 1.000	935	0,23	3,127 % fällig am 03.06.2032		1.000	978	0,24
Bevco Lux SARL	€ 300	315	0,08	5,750 % fällig am 16.11.2026 (e)(g)				7,830 % fällig am 04.12.2023				
1,500 % fällig am 16.09.2027				Jyske Realkredit A/S	DKK 0	0	0,00	Volkswagen Bank GmbH	€	3.900	4.092	1,00
Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	1.000	1.009	0,25	0,500 % fällig am 01.10.2040	186.654	23.995	5,85	1,875 % fällig am 31.01.2024		2.200	2.216	0,54
0,500 % fällig am 12.09.2023				1,000 % fällig am 01.10.2050	21.252	2.696	0,66	Volkswagen Financial Services AG		400	465	0,11
BNP Paribas S.A.	1.700	1.716	0,42	1,000 % fällig am 01.10.2053	4.329	580	0,14	0,625 % fällig am 01.04.2022				
0,306 % fällig am 22.09.2022				1,500 % fällig am 01.10.2050				Volkswagen Financial Services NV	£	400	465	0,11
Caixa Economica Montepio Geral Caixa Economica Bancaria S.A.	500	504	0,12	KBC Group NV	€ 400	425	0,10	0,875 % fällig am 20.02.2025				
0,125 % fällig am 14.11.2024				4,250 % fällig am 24.10.2025 (e)(g)				Volkswagen Leasing GmbH	€	600	600	0,15
CaixaBank S.A.	1.100	1.146	0,28	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	2.600	2.636	0,64	0,000 % fällig am 15.09.2028 (b)		1.000	1.002	0,24
1,750 % fällig am 24.10.2023				0,000 % fällig am 15.06.2029 (b)	1.400	1.414	0,34	0,000 % fällig am 12.07.2023 (b)				
3,750 % fällig am 15.02.2029	300	324	0,08	0,375 % fällig am 20.05.2036	1.700	1.718	0,42	Vonovia Finance BV		800	809	0,20
China Construction Bank Europe S.A.	1.700	1.699	0,41	LeasePlan Corp. NV				3,625 % fällig am 08.10.2021				
0,000 % fällig am 28.06.2024 (b)				0,125 % fällig am 13.09.2023	600	604	0,15	Wells Fargo & Co.		2.125	1.706	0,42
Citigroup, Inc.	900	904	0,22	3,500 % fällig am 09.04.2025	1.200	1.352	0,33	2,125 % fällig am 22.04.2022	£	1.445	1.706	0,42
0,500 % fällig am 29.01.2022				Liberty Living Finance PLC	£ 1.200	1.467	0,36	Yorkshire Building Society	€	500	512	0,12
Corestate Capital Holding S.A.	500	435	0,11	2,625 % fällig am 28.11.2024				0,625 % fällig am 21.09.2025				
3,500 % fällig am 15.04.2023 (h)				Morgan Stanley	€ 1.700	1.704	0,41			184.828	45,05	
Coventry Building Society	£ 3.100	3.660	0,89	0,168 % fällig am 08.11.2022				INDUSTRIEWERTE				
1,500 % fällig am 23.01.2023				Natwest Group PLC	500	510	0,12	Atlantia SpA		1.000	1.028	0,25
CPI Property Group S.A.	€ 400	412	0,10	0,750 % fällig am 15.11.2025	900	947	0,23	1,625 % fällig am 03.02.2025		400	415	0,10
1,625 % fällig am 23.04.2027				2,000 % fällig am 04.03.2025	700	732	0,18	1,875 % fällig am 13.07.2027		800	824	0,20
Credit Agricole S.A.	\$ 700	602	0,15	2,500 % fällig am 22.03.2023	\$ 300	275	0,07	1,875 % fällig am 12.02.2028				
1,907 % fällig am 16.06.2026				4,269 % fällig am 22.03.2025				BAT Capital Corp.		1.500	1.501	0,37
Credit Suisse Group AG	1.100	988	0,24	NE Property BV	€ 1.000	1.040	0,25	0,000 % fällig am 16.08.2021				
4,207 % fällig am 12.06.2024				2,625 % fällig am 22.05.2023 (h)				Bayer AG		900	910	0,22
7,125 % fällig am 29.07.2022 (e)(g)	200	176	0,04	Nexi SpA	1.300	1.296	0,32	0,375 % fällig am 06.07.2024				
7,250 % fällig am 12.09.2025 (e)(g)	500	477	0,12	1,625 % fällig am 30.04.2026				Bayer Capital Corp. BV		3.800	3.814	0,93
7,500 % fällig am 17.07.2023 (e)(g)	400	368	0,09	NN Group NV	600	687	0,17	0,012 % fällig am 26.06.2022				
7,500 % fällig am 11.12.2023 (e)(g)	300	281	0,07	4,500 % fällig am 15.01.2026 (e)				BMW Finance NV		1.300	1.307	0,32
CTP NV	€ 800	797	0,19	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab	DKK 0	0	0,00	0,125 % fällig am 13.07.2022				
0,500 % fällig am 21.06.2025				0,500 % fällig am 01.10.2040	163.686	21.058	5,13	Conti-Gummi Finance BV		600	630	0,15
CyrusOne LP	400	408	0,10	1,000 % fällig am 01.10.2050	20.066	2.538	0,62	2,125 % fällig am 27.11.2023				
1,450 % fällig am 22.01.2027				1,000 % fällig am 01.10.2053	9.372	1.256	0,31	Crown European Holdings S.A.		1.400	1.467	0,36
Dell Bank International DAC	200	202	0,05	1,500 % fällig am 01.10.2053	7.600	1.008	0,25	2,625 % fällig am 30.09.2024				
0,625 % fällig am 17.10.2022				Nova Ljubljanska Banka d.d.	€ 200	195	0,05	Expedia Group, Inc.		800	814	0,20
Deutsche Bank AG	€ 700	820	0,20	3,400 % fällig am 05.02.2030				2,500 % fällig am 03.06.2022				
1,750 % fällig am 16.12.2021				Nykredit Realkredit A/S	DKK 0	0	0,00	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide		2.400	2.485	0,61
1,875 % fällig am 14.02.2022	€ 1.800	1.824	0,44	0,500 % fällig am 01.10.2040	115.969	14.903	3,63	1,625 % fällig am 09.07.2024				
2,222 % fällig am 18.09.2024	\$ 200	173	0,04	1,000 % fällig am 01.10.2050	116.862	14.850	3,62	Heathrow Funding Ltd.				
2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 1.200	1.461	0,36	1,000 % fällig am 01.10.2053				5,225 % fällig am 15.02.2023	£	1.100	1.372	0,33
4,250 % fällig am 14.10.2021	\$ 2.800	2.387	0,58	1,500 % fällig am 01.10.2050				0,000 % fällig am 01.02.2023	€	500	528	0,13
Dexia Credit Local S.A.	€ 400	401	0,10	1,500 % fällig am 01.10.2053	25.996	3.434	0,84	1,625 % fällig am 18.09.2029				
0,000 % fällig am 21.01.2028 (b)				4,125 % fällig am 15.04.2026 (e)(g)	€ 400	430	0,10	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	\$	500	429	0,11
EUROFIMA	1.500	1.506	0,37					Informa PLC	€	500	515	0,13
0,010 % fällig am 23.06.2028								1,500 % fällig am 05.07.2023				

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
John Lewis PLC 6,125 % fällig am 21.01.2025	£ 500	€ 659	0,16	FT RMBS Prado 0,000 % fällig am 15.03.2056	€ 2.892	€ 2.900	0,71	1,110 % fällig am 15.08.2032	€ 100	€ 100	0,02
Marks & Spencer PLC 4,250 % fällig am 08.12.2023	2.000	2.479	0,60	Jubilee Place BV 0,463 % fällig am 17.10.2057	367	371	0,09	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,750 % fällig am 15.11.2031	1.100	1.095	0,27
Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	€ 200	208	0,05	Lanebrook Mortgage Transaction PLC 1,149 % fällig am 12.06.2057	€ 661	777	0,19	Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC 0,269 % fällig am 15.12.2029	700	705	0,17
2,652 % fällig am 17.03.2026	300	327	0,08	Miravet SARL 0,307 % fällig am 26.05.2065	€ 655	657	0,16	Contego CLO BV 0,770 % fällig am 15.10.2030	300	300	0,07
OI European Group BV 3,125 % fällig am 15.11.2024	1.300	1.347	0,33	Mulcair Securities DAC 0,461 % fällig am 24.04.2071	131	132	0,03	Contego CLO DAC 0,640 % fällig am 23.01.2030	500	499	0,12
Organon Finance LLC 2,875 % fällig am 30.04.2028	100	102	0,03	Polaris PLC 1,300 % fällig am 27.05.2057	€ 663	779	0,19	Cork Street CLO DAC 0,760 % fällig am 27.11.2028	586	586	0,14
Raytheon Technologies Corp. 2,800 % fällig am 15.03.2022	\$ 900	771	0,19	Precise Mortgage Funding PLC 1,249 % fällig am 12.12.2055	500	591	0,14	CVC Cordatus Loan Fund DAC 0,630 % fällig am 15.09.2031	300	299	0,07
Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 600	656	0,16	Primrose Residential 0,200 % fällig am 24.03.2061	€ 1.491	1.491	0,36	0,650 % fällig am 21.07.2030	1.600	1.601	0,39
SEB S.A. 2,375 % fällig am 25.11.2022	400	411	0,10	Residential Mortgage Securities PLC 1,299 % fällig am 20.06.2070	€ 617	726	0,18	0,650 % fällig am 15.10.2031	1.800	1.804	0,44
Syngenta Finance NV 1,875 % fällig am 02.11.2021	5.000	5.008	1,22	Ripon Mortgages PLC 0,881 % fällig am 20.08.2056	671	783	0,19	Dryden Euro CLO BV 0,660 % fällig am 15.04.2033	400	399	0,10
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1,125 % fällig am 21.11.2022	300	306	0,07	SapphireOne Mortgages FCT 0,000 % fällig am 27.06.2061	€ 1.919	1.923	0,47	GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 1,550 % fällig am 20.07.2031	400	401	0,10
Telefonica Emisiones S.A. 1,477 % fällig am 14.09.2021	1.300	1.305	0,32	Storm BV 0,055 % fällig am 22.05.2064	1.700	1.708	0,42	Grosvenor Place CLO BV 0,720 % fällig am 30.10.2029	458	459	0,11
Travis Perkins PLC 4,500 % fällig am 07.09.2023	€ 1.100	1.371	0,33	Stratton Mortgage Funding PLC 0,901 % fällig am 25.09.2051	€ 500	584	0,14	Harvest CLO DAC 0,640 % fällig am 15.10.2031	600	600	0,15
Ubisoft Entertainment S.A. 1,289 % fällig am 30.01.2023	€ 1.000	1.017	0,25	0,948 % fällig am 20.07.2060	1.556	1.820	0,44	0,650 % fällig am 26.06.2030	700	699	0,17
Zimmer Biomet Holdings, Inc. 1,414 % fällig am 13.12.2022	1.300	1.330	0,32	0,949 % fällig am 12.03.2052	720	843	0,21	0,760 % fällig am 15.07.2031	700	702	0,17
				Towd Point Mortgage Funding PLC 0,049 % fällig am 20.05.2045	837	979	0,24	0,960 % fällig am 20.10.2031	1.800	1.798	0,44
		35.336	8,62	Trinity Square PLC 0,899 % fällig am 15.07.2059	1.200	1.400	0,34	1,040 % fällig am 15.07.2031	400	401	0,10
				Tudor Rose Mortgages PLC 1,299 % fällig am 20.06.2048	448	524	0,13	Hayfin Emerald CLO DAC 1,450 % fällig am 15.02.2033	600	601	0,15
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				Twin Bridges PLC 1,299 % fällig am 12.12.2054	585	690	0,17	Jubilee CLO BV 0,295 % fällig am 12.07.2028	316	316	0,08
AT&T, Inc. 1,600 % fällig am 19.05.2028	600	644	0,16					Mackay Shields Euro CLO DAC 1,550 % fällig am 15.08.2033	500	501	0,12
2,650 % fällig am 17.12.2021	3.700	3.724	0,91					Madison Park Euro Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2032	1.000	1.001	0,24
Centrais Eletricas Brasileiras S.A. 3,625 % fällig am 04.02.2025	\$ 200	174	0,04			26.970	6,58	Man GLG Euro CLO DAC 0,680 % fällig am 15.10.2030	400	401	0,10
IE2 Holdco S.A.U. 2,375 % fällig am 27.11.2023	€ 1.000	1.050	0,25	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				North Westerly CLO BV 0,910 % fällig am 20.04.2031	600	600	0,15
Sprint Corp. 7,125 % fällig am 15.06.2024	\$ 300	292	0,07	Adagio CLO DAC 0,720 % fällig am 15.10.2031	€ 300	300	0,07	Palmer Square European Loan Funding DAC 1,150 % fällig am 15.01.2030	601	603	0,15
7,875 % fällig am 15.09.2023	1.400	1.343	0,33	ALME Loan Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2031	297	297	0,07	Purple Master Credit Cards 0,147 % fällig am 25.05.2034	600	606	0,15
Telecom Italia SpA 5,875 % fällig am 19.05.2023	€ 1.000	1.264	0,31	Aqueduct European CLO DAC 0,640 % fällig am 20.07.2030	600	601	0,15	Segovia European CLO DAC 0,770 % fällig am 18.01.2031	200	200	0,05
		8.491	2,07	Arbour CLO DAC 0,580 % fällig am 15.03.2029	414	414	0,10	0,880 % fällig am 20.07.2032 (a)	800	800	0,19
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		228.655	55,74	Ares European CLO DAC 0,660 % fällig am 15.10.2030	700	699	0,17	Silver Arrow S.A. 0,145 % fällig am 20.11.2030	421	422	0,10
				0,780 % fällig am 15.10.2031	500	500	0,12	0,149 % fällig am 15.02.2027	236	237	0,06
US-SCHATZobligationen				Armada Euro CLO DAC 0,720 % fällig am 15.07.2031	700	699	0,17	Tikehau CLO BV 0,880 % fällig am 07.12.2029	1.506	1.507	0,37
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,125 % fällig am 15.01.2030	\$ 6.641	6.152	1,50	Aurium CLO DAC 0,670 % fällig am 16.04.2030	200	200	0,05	Toro European CLO DAC 0,650 % fällig am 15.04.2030	2.700	2.700	0,66
0,125 % fällig am 15.02.2051	2.256	2.089	0,51					0,900 % fällig am 15.10.2030	1.371	1.372	0,33
		8.241	2,01	Auto ABS French Leases 0,700 % fällig am 29.06.2033	1.200	1.214	0,30	Turbo Finance 9 PLC 0,880 % fällig am 20.08.2028	€ 600	703	0,17
NON-AGENCY-MBS				Bain Capital Euro DAC 0,740 % fällig am 20.01.2032	600	599	0,15	Vendome Funding CLO DAC 1,860 % fällig am 20.07.2031	€ 700	701	0,17
Avon Finance No. 2 PLC 0,949 % fällig am 20.09.2048	€ 1.267	1.480	0,36	Bavarian Sky S.A. 0,145 % fällig am 20.05.2027	326	329	0,08	Voya Euro CLO DAC 0,750 % fällig am 15.10.2030	300	300	0,07
Canterbury Finance PLC 1,050 % fällig am 16.05.2057	281	329	0,08	BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	505	507	0,12				
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates 0,650 % fällig am 16.01.2057	372	434	0,11	Black Diamond CLO DAC 0,860 % fällig am 20.01.2032	600	600	0,15	STAATSEMISSIONEN			
Dilosk RMBS DAC 0,197 % fällig am 20.02.2060	€ 494	497	0,12	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 0,650 % fällig am 15.07.2030	800	802	0,20	Autonomous Community of Catalonia 4,900 % fällig am 15.09.2021	1.300	1.314	0,32
Domi BV 0,302 % fällig am 15.06.2051	364	366	0,09	0,720 % fällig am 15.01.2031	600	599	0,15	Caisse Francaise de Financement Local 0,000 % fällig am 25.02.2025	900	905	0,22
Dutch Property Finance BV 0,124 % fällig am 28.07.2058	900	903	0,22	0,910 % fällig am 15.01.2033	800	795	0,19	China Development Bank 0,375 % fällig am 24.01.2022	1.750	1.754	0,43
0,141 % fällig am 28.01.2048	1.952	1.956	0,48	1,050 % fällig am 15.01.2031	100	100	0,02	Development Bank of Japan, Inc. 1,125 % fällig am 28.04.2023	€ 800	945	0,23
Eurosail PLC 0,000 % fällig am 13.03.2045	625	623	0,15	BNPP AM Euro CLO BV 0,650 % fällig am 15.10.2031	300	299	0,07	Export-Import Bank of China 0,300 % fällig am 06.03.2022	€ 2.000	2.005	0,49
Fingal Securities RMBS DAC 0,462 % fällig am 28.07.2055	181	182	0,04	Bumper UK Finance PLC 0,550 % fällig am 20.12.2030	€ 500	584	0,14	France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	1.500	1.434	0,35
Finsbury Square PLC 1,349 % fällig am 16.06.2070	€ 443	522	0,13	Carlyle Euro CLO DAC 0,700 % fällig am 15.01.2031	€ 400	400	0,10				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Israel Government International Bond 0,000 % fällig am 22.07.2022 (b)	€ 1.300	€ 1.304	0,32	VORZUGSWERTPAPIERE				(0,020) % fällig am 02.03.2022 (b)(c)	ILS 800	€ 207	0,05
0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS 12.300	3.183	0,78	Nationwide Building Society 10,250 %	4.500	€ 985	0,24	0,000 % fällig am 06.04.2022 (b)(c)	7.900	2.044	0,50
0,750 % fällig am 31.07.2022	900	235	0,06					0,010 % fällig am 02.03.2022 (b)(c)	1.500	388	0,09
5,500 % fällig am 31.01.2022	7.800	2.084	0,51					0,011 % fällig am 06.04.2022 (b)(c)	1.300	337	0,08
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,250 % fällig am 15.03.2028	€ 3.500	3.465	0,84	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE							
1,300 % fällig am 15.05.2028 (d)	744	848	0,21	COMMERCIAL PAPER				Summe kurzfristige Instrumente		11.204	2,73
1,400 % fällig am 26.05.2025 (d)	17.375	18.776	4,58	Nomura Bank International PLC (0,375) % fällig am 14.10.2021	€ 1.200	1.201	0,30	Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 363.617	88,64	
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050 (b)(i)	600	557	0,14	(0,365) % fällig am 15.11.2021	500	501	0,12				
Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 700	594	0,14	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 0,051 % fällig am 10.09.2021	2.100	2.101	0,51				
South Korea Government International Bond 0,000 % fällig am 16.09.2025 (b)	€ 500	503	0,12					AKTIEN			
Spain Government International Bond 0,100 % fällig am 30.04.2031	2.600	2.522	0,61	ISRAEL TREASURY BILLS				INVESTMENTFONDS			
0,500 % fällig am 31.10.2031	1.900	1.904	0,46	(0,052) % fällig am 06.10.2021 (b)(c)	ILS 2.300	595	0,15	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	404.800	39.577	9,65
1,250 % fällig am 31.10.2030	5.800	6.282	1,53	(0,041) % fällig am 02.03.2022 (b)(c)	1.500	388	0,10	Summe Investmentfonds	€ 39.577	9,65	
Bundesland Saarland 0,500 % fällig am 15.03.2051	400	391	0,09	(0,034) % fällig am 05.01.2022 (b)(c)	700	181	0,04				
		51.005	12,43	(0,031) % fällig am 02.02.2022 (b)(c)	1.500	388	0,09				
				(0,030) % fällig am 02.03.2022 (b)(c)	900	233	0,06				
				(0,028) % fällig am 30.11.2021 (b)(c)	7.300	1.889	0,46				
				(0,020) % fällig am 02.02.2022 (b)(c)	2.900	751	0,18				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettover-mögens
RYL	(1,000) %	30.06.2021	01.07.2021	€ 5.800	Kingdom of Belgium Government Bond 1,600 % fällig am 22.06.2047	€ (5.834)	€ 5.800	€ 5.800	1,41
Summe Pensionsgeschäfte						€ (5.834)	€ 5.800	€ 5.800	1,41

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettover-mögens
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von EUR 170,500 auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	51	€ (33)	(0,01)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 171,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	08.2021	25	(11)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2021	489	120	0,03
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2021	10	(13)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	51	43	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	206	(469)	(0,11)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	34	(32)	(0,01)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	866	(22)	(0,01)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von EUR 170,500 auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	51	10	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von EUR 171,500 auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	08.2021	25	10	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2021	127	(10)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	245	15	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	154	32	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	7	(3)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	25	(13)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	72	(52)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	161	(103)	(0,03)
				€ (531)	(0,13)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (531)	(0,13)

(1) Future-Style-Option.

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	€ 32.000	€ 50	0,01
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	17.300	37	0,01
				€ 87	0,02

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2051	£ 300	€ (1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2036	€ 2.400	(10)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,193	23.06.2035	2.900	10	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,490	24.01.2033	4.600	12	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2023	83.000	34	0,01
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	900	2	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	12.300	(3)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,590	24.01.2034	4.600	14	0,01
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,819	19.12.2034	6.800	10	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,854	19.12.2039	3.300	7	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	700	(3)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,155	19.01.2022	\$ 4.400	(26)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,180	19.01.2022	3.700	(22)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,200	21.01.2022	2.400	(14)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,330	15.01.2025	£ 14.600	(53)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,473	15.08.2025	1.600	(7)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	4.800	(11)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,580	15.03.2036	300	1	0,00
					€ (60)	(0,01)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ 27	0,01

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS				0,195					
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	%	02.11.2022	1.150	€ 1	€ 143	0,04
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	1.340	86	166	0,04
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	1.100	103	192	0,05
BRC	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	760	48	94	0,02
JPM	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	900	82	158	0,04
MYC	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,007	24.08.2021	16.900	50	6	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	1.100	69	137	0,03
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,009	10.03.2022	3.300	244	181	0,04
							€ 683	€ 1.077	0,26

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	800	€ 4	€ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,156	05.08.2021	2.000	15	5	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	400	3	2	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	600	3	2	0,00
					€ 25	€ 9	0,00

VERKAUFSOPTIENEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONEN AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.08.2021	1.400	€ (1)	€ 0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.400	(1)	0	0,00	
BPS	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	1.800	(2)	0	0,00	
	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	1.200	(1)	(1)	0,00	
BRC	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.200	(1)	0	0,00	
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	800	0	(1)	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	800	(1)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	1.200	(1)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.800	(2)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	4.500	(5)	(1)	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	1.600	(2)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.700	(2)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	4.100	(3)	(2)	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.100	(1)	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	1.100	(1)	0	0,00	
	DUB	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	2.300	(1)	(1)	0,00
		Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	2.300	(2)	(1)	0,00
		Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	4.700	(4)	(1)	0,00
		Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	2.200	(2)	(1)	0,00
	FBF	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	2.800	(3)	(1)	0,00
Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index		Verkauf	0,800	15.09.2021	1.900	(2)	(1)	0,00	
Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index		Kauf	0,475	18.08.2021	600	0	0	0,00	
Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index		Verkauf	0,800	18.08.2021	1.500	(1)	0	0,00	
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	1.900	(2)	(1)	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.000	(1)	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.000	(1)	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.100	(1)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.300	(1)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.800	(2)	0	0,00	
						€ (47)	€ (12)	0,00	

DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BPS	Call – OTC USD versus CAD	CAD 1,265	11.02.2022	66	€ (1)	€ (1)	0,00
GLM	Call – OTC USD versus CAD	1,265	11.02.2022	2.337	(21)	(24)	(0,01)
					€ (22)	€ (25)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BOA	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,490 %	20.01.2023	8.400	€ (313)	€ (302)	(0,07)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,590	22.01.2024	4.200	(158)	(180)	(0,04)
BPS	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,640	20.01.2022	1.500	(115)	(105)	(0,03)
	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,002	26.05.2023	27.700	(119)	(98)	(0,02)
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,002	26.05.2023	27.700	(119)	(93)	(0,02)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	3.500	0	(132)	(0,03)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	4.040	(84)	(153)	(0,04)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	3.300	(101)	(189)	(0,05)
BRC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	2.260	(47)	(86)	(0,02)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,065	19.06.2025	6.600	(249)	(120)	(0,03)
DUB	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,640	20.01.2022	1.500	(161)	(105)	(0,03)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	4.410	(25)	(2)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	24.500	(32)	(10)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,590	22.01.2024	4.200	(206)	(180)	(0,04)
JPM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	2.700	(81)	(155)	(0,04)
MYC	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,006	24.08.2021	33.800	(44)	(2)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,008	17.12.2029	10.900	(352)	(355)	(0,09)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	600	(4)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	5.290	(32)	(3)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	3.300	(69)	(125)	(0,03)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,008	17.12.2029	5.500	(341)	(343)	(0,08)
RYL	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,008	10.03.2022	8.900	(236)	(190)	(0,05)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	01.02.2022	83.600	(78)	(197)	(0,05)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,001	24.03.2022	82.900	(112)	(19)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,001	24.03.2022	82.900	(112)	(153)	(0,04)
						€ (3.191)	€ (3.297)	(0,80)	

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
FAR	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	2.100	€ (8)	€ (2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	05.08.2021	1.300	(4)	(2)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettover-mögens
GSC	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	\$ 103,797	05.08.2021	1.300	€ (3)	€ (1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,227	07.07.2021	200	(1)	0	0,00
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,023	07.09.2021	500	(2)	(2)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,023	07.09.2021	500	(2)	(2)	0,00
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	1.000	(3)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	4.100	(21)	(6)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	800	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	1.200	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	300	0	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,695	07.09.2021	300	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	5.600	(14)	(11)	(0,01)
					€ (66)	€ (30)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowert zunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	CAD 2.225	€ 1.509	€ 0	€ (6)	€ (6)	0,00
	07.2021	£ 1.805	2.098	0	(5)	(5)	0,00
	04.2022	DKK 308.898	41.519	0	(12)	(12)	0,00
BPS	07.2021	AUD 2.541	1.607	0	(2)	(2)	0,00
	07.2021	€ 1.521	CAD 2.241	6	0	6	0,00
	07.2021	£ 577	\$ 699	13	0	13	0,00
	07.2021	€ 5.688	€ 6.614	0	(12)	(12)	0,00
	07.2021	\$ 713	599	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	€ 1.606	AUD 2.541	2	0	2	0,00
	11.2021	ILS 1.000	\$ 308	0	0	0	0,00
	02.2022	CAD 17	14	0	0	0	0,00
	07.2021	€ 407	£ 349	0	0	0	0,00
	07.2021	£ 602	€ 701	0	0	0	0,00
BRC	09.2021	CNY 154	\$ 24	0	0	0	0,00
	04.2022	€ 476	DKK 3.540	0	0	0	0,00
	07.2021	1.613	AUD 2.541	0	(4)	(4)	0,00
	07.2021	1.578	NOK 16.110	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 60	MXN 1.248	2	0	2	0,00
	10.2021	ILS 2.301	\$ 695	0	(10)	(10)	0,00
	11.2021	18.605	5.681	4	(38)	(34)	(0,01)
	01.2022	4.937	1.533	14	(3)	11	0,00
	02.2022	4.325	1.326	3	(7)	(4)	0,00
	03.2022	3.801	1.156	0	(12)	(12)	0,00
GLM	04.2022	9.200	2.813	0	(20)	(20)	(0,01)
	08.2022	913	276	0	(5)	(5)	0,00
	07.2021	€ 70	£ 60	0	0	0	0,00
	07.2021	530	\$ 628	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 3.849	NZD 5.477	0	(18)	(18)	0,00
	08.2021	2.562	SEK 22.233	33	0	33	0,01
	01.2022	ILS 844	\$ 258	0	(2)	(2)	0,00
	02.2022	CAD 570	471	9	0	9	0,00
	03.2022	ILS 900	274	0	(3)	(3)	0,00
	04.2022	DKK 3.465	€ 466	0	0	0	0,00
HUS	04.2022	€ 527	DKK 3.920	0	0	0	0,00
	07.2021	NZD 5.489	€ 3.263	29	0	29	0,01
	09.2021	\$ 1.951	CNH 12.537	0	(17)	(17)	0,00
	01.2022	ILS 2.533	\$ 775	1	(5)	(4)	0,00
	04.2022	DKK 351.086	€ 47.181	0	(22)	(22)	(0,01)
	04.2022	€ 2.911	DKK 21.655	0	0	0	0,00
JPM	07.2021	\$ 788	€ 647	0	(18)	(18)	0,00
	08.2021	1.287	SEK 11.122	12	0	12	0,00
	09.2021	1.916	IDR 27.620.614	0	(28)	(28)	(0,01)
	01.2022	ILS 528	\$ 162	0	0	0	0,00
	04.2022	DKK 74.860	€ 10.066	1	0	1	0,00
	04.2022	€ 4.308	DKK 32.050	1	0	1	0,00
MYI	07.2021	416	\$ 495	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 430	€ 363	0	0	0	0,00
	08.2021	€ 1.521	CAD 2.241	4	0	4	0,00
	01.2022	ILS 211	\$ 65	0	0	0	0,00
	04.2022	DKK 19.180	€ 2.578	0	0	0	0,00
	04.2022	€ 6.136	DKK 45.640	0	0	0	0,00
RYL	07.2021	411	£ 354	1	0	1	0,00
	04.2022	203	DKK 1.510	0	0	0	0,00
	07.2021	37.015	£ 31.812	44	0	44	0,01
SCX	07.2021	£ 24.642	€ 28.491	0	(216)	(216)	(0,05)
	07.2021	\$ 46.808	38.262	0	(1.210)	(1.210)	(0,30)
	08.2021	£ 31.830	37.015	0	(43)	(43)	(0,01)
	07.2021	NOK 16.110	1.582	3	0	3	0,00
	07.2021	SEK 17.275	1.709	6	0	6	0,00
	08.2021	€ 1.581	NOK 16.110	0	(3)	(3)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SSB	07.2021	€ 1.509	CAD 2.232	€ 11	€ 0	€ 11	0,00
				€ 200	€ (1.723)	€ (1.523)	(0,37)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ (3.801)	(0,93)
Summe Anlagen						€ 404.689	98,65
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 5.557	1,35
Nettovermögen						€ 410.246	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
 (b) Nullkuponwertpapier.
 (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
 (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
 (f) Mit dem Fonds verbunden.
 (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 1.476 als Sicherheiten verpfändet.
 (i) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 557 und Barmittel in Höhe von EUR 1.090 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 2.925 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 363.617	€ 0	€ 363.617
Investmentfonds	0	39.577	0	39.577
Pensionsgeschäfte	0	5.800	0	5.800
Finanzderivate ⁽³⁾	(500)	(3.805)	0	(4.305)
Summen	€ (500)	€ 405.189	€ 0	€ 404.689

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 357.235	€ 1.772	€ 359.007
Investmentfonds	0	34.027	0	34.027
Pensionsgeschäfte	0	6.767	0	6.767
Finanzderivate ⁽³⁾	(93)	(536)	(1)	(630)
Summen	€ (93)	€ 397.493	€ 1.771	€ 399.171

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlich- keiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettover- mögens
BRC	(2,500) %	17.02.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (456)	€ (451)	(0,11)
CFR	(0,950)	04.11.2020	TBD ⁽¹⁾	(1.022)	(1.016)	(0,25)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					€ (1.467)	(0,36)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	€ (610)	€ 0	€ (610)
BPS	(160)	0	(160)
BRC	(222)	(236)	(458)
CBK	(76)	0	(76)
DUB	(8)	0	(8)
FAR	(5)	0	(5)
FBF	(1)	0	(1)
GLM	(195)	0	(195)
GSC	(4)	0	(4)
HUS	(14)	0	(14)
JPM	(41)	0	(41)
MYC	(694)	0	(694)
MYI	5	0	5
RYL	(368)	410	42
SCX	(1.425)	1.237	(188)
SOG	6	0	6
SSB	11	0	11

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	86,96	85,37
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	1,68	16,48
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,51
Investmentfonds	9,65	9,70
Pensionsgeschäfte	1,41	1,93
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,13)	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	0,40
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,93)	(0,55)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,36)	(0,29)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	55,74	55,96
US-Regierungsbehörden	k. A.	14,99
US-Schatzobligationen	2,01	2,50
Non-Agency-MBS	6,58	6,79
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,91	9,80
Staatsemissionen	12,43	11,23
Vorzugswertpapiere	0,24	0,25
Kurzfristige Instrumente	2,73	0,84
Investmentfonds	9,65	9,70
Pensionsgeschäfte	1,41	1,93
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,13)	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,02	k. A.
Zinsswaps	(0,01)	0,40
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	0,26	0,21
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Devisenoptionen	(0,01)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,80)	(0,95)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,37)	0,20
Sonstige Aktiva und Passiva	1,35	(13,81)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Advantage Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Volkswagen Financial Services AG 0,625 % fällig am 01.04.2022	€	900	1,075 0,21
Summe Deutschland		18.470	3,58
GUATEMALA			
STAATSEMISSIONEN			
Guatemala Government International Bond 5,375 % fällig am 24.04.2032	\$	400	466 0,09
HONGKONG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023		400	305 0,06
Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd. 3,950 % fällig am 05.02.2023		500	517 0,10
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 1,697 % fällig am 25.05.2023		500	502 0,10
Summe Hongkong		1.324	0,26
INDIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Muthoot Finance Ltd. 6,125 % fällig am 31.10.2022		900	936 0,18
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,700 % fällig am 27.02.2022		900	911 0,18
Summe Indien		1.847	0,36
INDONESIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 3,000 % fällig am 30.06.2030		3.500	3.516 0,68
STAATSEMISSIONEN			
Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.03.2034	IDR	22.982.000	1.754 0,34
Summe Indonesien		5.270	1,02
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Accunia European CLO DAC 0,950 % fällig am 15.07.2030	€	600	712 0,14
Ares European CLO DAC 0,780 % fällig am 15.10.2031		1.100	1.304 0,25
Armada Euro CLO DAC 0,720 % fällig am 15.07.2031		400	473 0,09
Aurium CLO DAC 0,680 % fällig am 13.10.2029		742	880 0,17
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,700 % fällig am 15.01.2031		1.000	1.186 0,23
Dorchester Park CLO DAC 1,088 % fällig am 20.04.2028	\$	1.032	1.033 0,20
Dryden Euro CLO BV 0,860 % fällig am 15.05.2034 (b)	€	1.000	1.186 0,23
Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029		1.043	1.239 0,24
0,650 % fällig am 26.06.2030		1.100	1.303 0,25
0,760 % fällig am 15.07.2031		1.100	1.308 0,25
0,960 % fällig am 20.10.2031		800	948 0,19
Man GLG Euro CLO DAC 0,690 % fällig am 15.12.2031		600	713 0,14
OAK Hill European Credit Partners DAC 0,740 % fällig am 20.10.2031		1.100	1.303 0,25
Toro European CLO DAC 0,900 % fällig am 15.10.2030		1.762	2.093 0,41
Summe Irland		15.681	3,04
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AIB Group PLC 4,750 % fällig am 12.10.2023	\$	300	326 0,06
Summe Irland		16.007	3,10

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ISRAEL			
STAATSEMISSIONEN			
Israel Government International Bond 0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS	21.000	6.445 1,25
0,750 % fällig am 31.07.2022		1.000	309 0,06
1,750 % fällig am 31.08.2025		2.100	684 0,13
2,000 % fällig am 31.03.2027		2.700	895 0,17
3,800 % fällig am 13.05.2060	\$	1.800	2.054 0,40
3,875 % fällig am 03.07.2050		200	232 0,05
4,125 % fällig am 17.01.2048		400	482 0,09
5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS	3.200	1.014 0,20
Summe Israel		12.115	2,35
ITALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aerporti di Roma SpA 1,750 % fällig am 30.07.2031	€	500	619 0,12
AMCO – Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023		1.000	1.224 0,24
Banca Carige SpA 0,957 % fällig am 25.05.2022		600	715 0,14
1,161 % fällig am 25.10.2021		800	952 0,19
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 0,875 % fällig am 08.10.2027		1.600	1.975 0,38
4,000 % fällig am 10.07.2022 (k)		400	484 0,09
UniCredit SpA 2,200 % fällig am 22.07.2027		300	379 0,07
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$	1.100	1.275 0,25
Summe Italien		7.623	1,48
STAATSEMISSIONEN			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024 (f)	€	20.435	27.156 5,26
Italy Government International Bond 6,000 % fällig am 04.08.2028	£	1.000	1.786 0,35
Summe Italien		28.942	5,61
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Central Nippon Expressway Co. Ltd. 0,616 % fällig am 15.02.2022	\$	1.000	1.002 0,19
2,567 % fällig am 02.11.2021		3.200	3.222 0,62
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,337 % fällig am 08.06.2027	€	500	595 0,12
Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	\$	500	550 0,11
ORIX Corp. 3,250 % fällig am 04.12.2024		400	431 0,08
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,409 % fällig am 07.11.2029	€	1.300	1.572 0,31
2,014 % fällig am 07.11.2022	\$	500	511 0,10
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,474 % fällig am 08.07.2025		1.000	1.011 0,20
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % fällig am 15.10.2027	€	1.000	1.181 0,23
Summe Japan		10.075	1,96
STAATSEMISSIONEN			
Japan Finance Organization for Municipalities 3,000 % fällig am 12.03.2024	\$	200	213 0,04
3,375 % fällig am 27.09.2023		1.400	1.487 0,29
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 (f)(l)	¥	726.437	6.715 1,30
0,100 % fällig am 10.03.2029 (f)		500.985	4.643 0,90
0,500 % fällig am 20.03.2049 (l)		348.000	3.021 0,59
0,700 % fällig am 20.12.2048		116.000	1.062 0,21
1,200 % fällig am 20.09.2035		163.000	1.667 0,32
Tokyo Metropolitan Government 2,500 % fällig am 08.06.2022	\$	3.000	3.056 0,59
2,625 % fällig am 29.05.2024		400	421 0,08
Summe Japan		22.285	4,32

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summe Japan		32.360	6,28
KUWAIT			
STAATSEMISSIONEN			
Kuwait International Government Bond 3,500 % fällig am 20.03.2027	\$	5.700	6.367 1,24
LUXEMBURG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aroundtown S.A. 2,000 % fällig am 02.11.2026	€	500	638 0,12
CPI Property Group S.A. 1,625 % fällig am 23.04.2027		700	855 0,17
4,750 % fällig am 08.03.2023	\$	200	213 0,04
Logicor Financing SARL 0,750 % fällig am 15.07.2024	€	600	724 0,14
SELP Finance SARL 1,250 % fällig am 25.10.2023		1.400	1.705 0,33
Summe Luxemburg		4.135	0,80
NON-AGENCY-MBS			
Miravet SARL 0,307 % fällig am 26.05.2065		655	780 0,15
Summe Luxemburg		4.915	0,95
MALAYSIA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Petronas Capital Ltd. 2,480 % fällig am 28.01.2032	\$	500	504 0,10
3,500 % fällig am 21.04.2030		200	219 0,04
4,800 % fällig am 21.04.2060		200	266 0,05
Summe Malaysia		989	0,19
STAATSEMISSIONEN			
Malaysia Government International Bond 3,733 % fällig am 15.06.2028	MYR	12.200	3.075 0,60
3,828 % fällig am 05.07.2034		2.600	626 0,12
4,642 % fällig am 07.11.2033		5.200	1.355 0,26
Summe Malaysia		5.056	0,98
MEXIKO			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Petroleos Mexicanos 6,750 % fällig am 21.09.2047	\$	2.300	2.038 0,40
MULTINATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Preferred Term Securities Ltd. 0,525 % fällig am 23.06.2035		1.575	1.461 0,28
NIEDERLANDE			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Barings Euro CLO BV 0,680 % fällig am 27.07.2030	€	568	675 0,13
Cairn CLO BV 0,600 % fällig am 30.04.2031		400	473 0,09
Dryden Euro CLO BV 0,660 % fällig am 15.04.2033		700	827 0,16
Jubilee CLO BV 0,600 % fällig am 15.04.2030		600	710 0,14
0,650 % fällig am 15.04.2031		400	473 0,09
Summe Niederlande		3.158	0,61
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Airbus SE 2,375 % fällig am 09.06.2040		1.000	1.381 0,27
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025		1.100	1.300 0,25
Enel Finance International NV 2,650 % fällig am 10.09.2024	\$	1.200	1.262 0,25
ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026 (g)(i)		200	222 0,04
LeasePlan Corp. NV 0,125 % fällig am 13.09.2023	€	700	835 0,16

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Stichting AK Rabobank Certificaten 2,188 % (g)	€ 210	\$ 336	0,07
Syngenta Finance NV 5,182 % fällig am 24.04.2028	\$ 400	458	0,09
Volkswagen International Finance NV 1,009 % fällig am 16.11.2024	€ 800	986	0,19
		6.780	1,32

NON-AGENCY-MBS

Jubilee Place BV 0,463 % fällig am 17.10.2057	917	1.100	0,21
Summe Niederlande		11.038	2,14

NEUSEELAND

STAATSEMISSIONEN	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
New Zealand Government International Bond 1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD 600	409	0,08

NORWEGEN

STAATSEMISSIONEN	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Norway Government International Bond 1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK 6.000	716	0,14

PERU

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Banco de Credito del Peru 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 1.700	459	0,09

STAATSEMISSIONEN

Peru Government International Bond 1,862 % fällig am 01.12.2032	\$ 300	279	0,05
5,400 % fällig am 12.08.2034	PEN 1.600	396	0,08
5,940 % fällig am 12.02.2029	9.400	2.687	0,52
6,150 % fällig am 12.08.2032	1.200	320	0,06
6,350 % fällig am 12.08.2028	12.100	3.537	0,69
8,200 % fällig am 12.08.2026	2.100	689	0,13
		7.908	1,53
Summe Peru		8.367	1,62

PHILIPPINEN

STAATSEMISSIONEN	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Philippines Government International Bond 6,250 % fällig am 14.01.2036	PHP 21.000	516	0,10

PORTUGAL

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Banco Espirito Santo S.A. 4,000 % fällig am 21.01.2019	€ 1.900	360	0,07
4,750 % fällig am 15.01.2018	600	114	0,02
Summe Portugal		474	0,09

KATAR

STAATSEMISSIONEN	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Qatar Government International Bond 3,750 % fällig am 16.04.2030	\$ 500	567	0,11
4,000 % fällig am 14.03.2029	300	346	0,07
4,400 % fällig am 16.04.2050	200	244	0,05
4,500 % fällig am 23.04.2028	2.600	3.073	0,60
4,817 % fällig am 14.03.2049	500	645	0,12
Summe Katar		4.875	0,95

RUMÄNIEN

STAATSEMISSIONEN	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Romania Government International Bond 1,375 % fällig am 02.12.2029	€ 600	711	0,14
2,000 % fällig am 14.04.2033	500	590	0,11
2,625 % fällig am 02.12.2040	100	118	0,02
2,750 % fällig am 14.04.2041	200	236	0,05
3,375 % fällig am 08.02.2038	300	391	0,08
5,850 % fällig am 26.04.2023	RON 2.900	743	0,14
Summe Rumänien		2.789	0,54

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
RUSSLAND			
STAATSEMISSIONEN			
Russia Government International Bond 1,125 % fällig am 20.11.2027	€ 2.000	2.362	0,46
4,750 % fällig am 27.05.2026	\$ 5.200	5.916	1,15
7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB 137.400	1.958	0,38
7,700 % fällig am 23.03.2033	33.500	481	0,09
Summe Russland		10.717	2,08

SAUDI-ARABIEN

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Saudi Arabian Oil Co. 1,625 % fällig am 24.11.2025	\$ 400	404	0,08
2,750 % fällig am 16.04.2022	400	408	0,08
		812	0,16

STAATSEMISSIONEN

Saudi Government International Bond 3,250 % fällig am 26.10.2026	2.200	2.401	0,47
4,375 % fällig am 16.04.2029	2.800	3.248	0,63
4,625 % fällig am 04.10.2047	400	479	0,09
		6.128	1,19
Summe Saudi-Arabien		6.940	1,35

SERBIEN

STAATSEMISSIONEN	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Serbia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.05.2027	€ 3.900	5.153	1,00

SINGAPUR

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Ascendas Real Estate Investment Trust 0,750 % fällig am 23.06.2028	1.000	1.187	0,23
BOC Aviation Ltd. 2,750 % fällig am 18.09.2022	\$ 200	204	0,04
3,500 % fällig am 18.09.2027	400	427	0,08
PSA Treasury Pte. Ltd. 2,500 % fällig am 12.04.2026	1.000	1.049	0,21
		2.867	0,56

STAATSEMISSIONEN

Singapore Government International Bond 2,125 % fällig am 01.06.2026	SGD 1.800	1.417	0,27
Summe Singapur		4.284	0,83

SLOWENIEN

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 400	464	0,09

STAATSEMISSIONEN

Slovenia Government International Bond 5,250 % fällig am 18.02.2024	\$ 1.089	1.224	0,24
Summe Slowenien		1.688	0,33

SÜDAFRIKA

STAATSEMISSIONEN	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029	600	638	0,12
5,375 % fällig am 24.07.2044	500	503	0,10
Summe Südafrika		1.141	0,22

SÜDKOREA

STAATSEMISSIONEN	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd. 3,750 % fällig am 25.07.2023	300	319	0,06
South Korea Government International Bond 2,125 % fällig am 10.06.2027	KRW 680.000	612	0,12
2,375 % fällig am 10.12.2028	2.960.000	2.704	0,52
5,500 % fällig am 10.03.2028	640.000	695	0,14
Summe Südkorea		4.330	0,84

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
SPANIEN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	€ 617	\$735	0,14

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % fällig am 29.03.2024	(g)(i) 600	780	0,15
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 22.07.2025	100	121	0,02
1,750 % fällig am 10.05.2024	100	123	0,03
Banco Santander S.A. 1,849 % fällig am 25.03.2026	\$ 400	405	0,08
4,379 % fällig am 12.04.2028	400	458	0,09
CaixaBank S.A. 1,750 % fällig am 24.10.2023	€ 600	741	0,14
		2.628	0,51

STAATSEMISSIONEN

Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035	300	473	0,09
4,900 % fällig am 15.09.2021	1.500	1.798	0,35
Spain Government International Bond 0,850 % fällig am 30.07.2037	500	584	0,12
1,450 % fällig am 31.10.2071	500	523	0,10
		3.378	0,66
Summe Spanien		6.741	1,31

SUPRANATIONAL

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Europäische Union 0,000 % fällig am 06.07.2026	(b)(d) 400	484	0,09
0,000 % fällig am 04.07.2031 (d)	1.100	1.302	0,25
0,250 % fällig am 22.04.2036	200	233	0,05
0,700 % fällig am 06.07.2051 (b)	300	360	0,07
0,750 % fällig am 04.01.2047	0	0	0,00
Summe supranational		2.379	0,46

SCHWEIZ

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)	\$ 1.400	1.550	0,30
Credit Suisse Group AG 1,319 % fällig am 14.12.2023	1.200	1.213	0,24
3,800 % fällig am 09.06.2023	1.600	1.696	0,33
7,500 % fällig am 17.07.2023	(g)(i) 300	327	0,06
UBS Group AG 4,125 % fällig am 24.09.2025	1.200	1.340	0,26
Summe Schweiz		6.126	1,19

VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
First Abu Dhabi Bank PJSC 3,000 % fällig am 30.03.2022	1.900	1.938	0,37

STAATSEMISSIONEN

Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,125 % fällig am 16.04.2030	300	327	0,06
3,875 % fällig am 16.04.2050	200	231	0,05
		558	0,11
Summe Vereinigte Arabische Emirate		2.496	0,48

GROSSBRITANNIEN

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE	PARI	MARKT- WERT	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Bumper UK Finance PLC 0,650 % fällig am 20.12.2028	£ 674	931	0,18

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

Antofagasta PLC 2,375 % fällig am 14.10.2030	\$ 400	386	0,08
Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022 (i)	4.600	5.019	0,97
Barclays PLC 4,836 % fällig am 09.05.2028	500	562	0,11

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Advantage Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03.2022	13	\$ (1)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2021	28	6	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	1	1	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	15	(20)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2021	55	(5)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	57	70	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	121	(159)	(0,03)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	6	(26)	(0,01)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	132	(119)	(0,02)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	407	10	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	8	19	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	256	(61)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	423	498	0,10
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	26	(117)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2021	11	86	0,02
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	72	(122)	(0,02)
				\$ 60	0,01
				\$ 60	0,01

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Kraft Heinz Foods Co.	(1,000) %	20.06.2022	\$ 1.400	\$ 1	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Rolls-Royce PLC	1,000 %	20.12.2024	€ 200	\$ 4	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2026	450	13	0,00
Shell International Finance BV	1,000	20.12.2026	600	2	0,00
				\$ 19	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	\$ 1.235	\$ (4)	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000)	20.12.2025	300	(3)	0,00
CDX.HY-36 5-Year Index	(5,000)	20.06.2026	700	(7)	0,00
CDX.IG-35 5-Year Index	(1,000)	20.12.2025	800	(1)	0,01
CDX.IG-35 10-Year Index	(1,000)	20.12.2030	8.000	(29)	(0,01)
CDX.IG-36 10-Year Index	(1,000)	20.06.2031	8.300	(33)	(0,01)
				\$ (77)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000 %	20.06.2026	\$ 17.100	\$ 36	0,01

ZINSSWAPS - BASISWAPS

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month USD-LIBOR ⁽⁴⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	07.03.2024	\$ 3.400	\$ (0)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,071 %	12.06.2022	6.600	(2)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,084 %	12.06.2022	9.100	(4)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,085 %	19.06.2022	5.700	(2)	0,00
3-Month USD-LIBOR ⁽⁴⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,088 %	06.09.2024	21.300	(1)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,091 %	18.03.2022	121.700	(41)	(0,01)
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,098 %	02.03.2023	\$ 4.600	(3)	0,00

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month USD-LIBOR ⁽⁴⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,102 %	04.10.2024	4.500	(1)	0,00
3-Month USD-LIBOR ⁽⁴⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,105 %	27.09.2024	10.300	(2)	0,00
				\$ (56)	(0,01)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,250 %	15.09.2023	£ 500	\$ (1)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	900	(1)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	7.100	26	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	3.100	(205)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,850	03.01.2022	14.700	7	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022	37.500	18	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,860	03.01.2022	19.500	9	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	10.700	5	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,871	03.01.2022	14.600	7	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,300	03.01.2022	198.500	(81)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,345	03.01.2022	4.200	(2)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,350	03.01.2022	80.300	(35)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	31.800	12	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,700	03.01.2022	71.100	(30)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,280	04.01.2027	1.600	(4)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	6.700	(5)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	2.600	(7)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	6.300	59	0,01
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,750	16.12.2046	1.700	(72)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	3.700	25	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD 350	(1)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	2.600	4	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK 12.700	(1)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	16.100	14	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,250	30.03.2023	\$ 1.200	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,400	30.03.2026	10.300	5	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,400	15.01.2028	3.500	21	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	9.980	(17)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	400	0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	2.800	11	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022	2.200	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022	6.700	(5)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	30.03.2031	4.535	(87)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	400	7	(0,00)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	12.420	(231)	(0,04)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025	5.100	(12)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	12.300	(200)	(0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,120	02.02.2031	1.200	(25)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,160	02.02.2031	1.100	(23)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,249	31.08.2024	9.500	26	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	09.06.2041	5.100	(237)	(0,05)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050	300	18	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050	100	(6)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	4.400	263	0,05
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,298	25.08.2024	8.100	22	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,305	21.08.2023	9.550	(22)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,325	02.12.2050	900	(56)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,460	02.02.2051	1.600	109	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2024	200	1	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,620	27.01.2052	400	(27)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,635	31.08.2051	1.050	71	0,01
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,710	17.09.2051	550	37	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,720	15.10.2031	2.100	(42)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,750	18.12.2049	700	45	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,760	25.08.2051	1.150	(79)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,854	15.05.2045	600	34	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,935	22.06.2051	700	(20)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,940	15.06.2051	800	(24)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,950	04.10.2031	590	12	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,950	31.08.2051	850	(60)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,968	23.06.2051	800	(29)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,990	31.08.2051	900	(64)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.01.2030	12.000	(239)	(0,05)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.12.2051	1.100	(11)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	2,010	17.09.2051	750	(53)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	2,090	23.12.2051	1.000	(73)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	3.600	(18)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2021	18.700	30	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	15.03.2022	ZAR 66.400	(18)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,250	15.03.2022	9.600	(3)	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 5.700	(65)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Advantage Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750 %	16.06.2031	AUD 1.750	\$ (26)	(0,01)	
Zahlung	6-Month CHF-LIBOR	0,500	16.09.2025	CHF 18.800	(5)	0,00	
Zahlung	6-Month CHF-LIBOR	0,620	18.03.2025	3.750	7	0,00	
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 40.700	55	0,01	
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	200	(7)	0,00	
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,060	17.11.2032	1.500	24	0,00	
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	500	(20)	0,00	
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	27.01.2032	300	4	0,00	
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	27.01.2032	1.000	(14)	0,00	
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,205	27.01.2032	1.300	(18)	0,00	
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	16.500	(37)	(0,01)	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035	500	(10)	0,00	
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2023	13.700	7	0,00	
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	5.500	0	0,00	
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,000	17.03.2031	¥ 230.000	9	0,00	
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,400	19.06.2039	280.000	(21)	0,00	
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,500	19.06.2049	60.000	3	0,00	
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,500	10.03.2026	NOK 44.300	(6)	0,00	
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,635	18.03.2025	6.200	1	0,00	
Zahlung	6-Month NOK-NIBOR	1,900	10.03.2031	23.200	46	0,01	
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,993	12.11.2024	4.200	(3)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN 41.500	(16)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,715	15.10.2021	20.900	(2)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	26.02.2025	10.500	(5)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,380	25.02.2025	12.300	(6)	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,415	25.02.2025	300	0	0,00	
Erhalt	UKRPI	3,000	15.11.2050	£ 400	(3)	0,00	
Erhalt	UKRPI	3,051	15.11.2050	400	(4)	0,00	
Erhalt	UKRPI	3,143	15.11.2050	200	(2)	0,00	
Zahlung	UKRPI	3,217	15.11.2040	970	5	0,00	
Zahlung	UKRPI	3,272	15.11.2040	400	2	0,00	
Zahlung	UKRPI	3,273	15.11.2040	560	3	0,00	
Zahlung	UKRPI	3,340	15.11.2040	490	3	0,00	
Erhalt	UKRPI	3,397	15.11.2030	570	1	0,00	
Erhalt	UKRPI	3,445	15.11.2030	560	1	0,00	
Erhalt	UKRPI	3,510	15.11.2030	290	0	0,00	
Zahlung	UKRPI	3,700	15.04.2031	100	0	0,00	
Zahlung	UKRPI	3,740	15.03.2031	800	(1)	0,00	
						\$ (1.329)	(0,26)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (1.406)	(0,27)

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

(2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BOA	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,016 %	15.07.2021	2.100	\$ 32	\$ 3	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,016	06.08.2021	2.100	30	6	0,00
CBK	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,004	25.01.2022	6.000	79	40	0,01
FAR	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,020	30.09.2021	2.800	59	7	0,00
GLM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,004	25.01.2022	6.500	82	44	0,01
							\$ 282	\$ 100	0,02

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BPS	Put – OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	800	\$ 61	\$ 119	0,02
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	400	2	0	0,00
					\$ 63	\$ 119	0,02

VERKAUFSOPTIENEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000 %	20.10.2021	300	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	700	(1)	0	0,00
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.800	(2)	0	0,00
	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	1.100	(1)	0	0,00
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	900	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	800	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	800	(1)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	600	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	600	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	3.900	(5)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	2.100	(2)	(1)	0,00
CBK	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.400	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	1.500	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	4.600	(5)	(3)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	700	(1)	0	0,00
	Call - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	2.300	(2)	(1)	0,00
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.600	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.300	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.200	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	15.09.2021	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	20.10.2021	400	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	500	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	600	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	700	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	800	(1)	0	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	2.300	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	600	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	1.200	(2)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	800	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	900	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	1.700	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	2.000	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.400	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	100	0	0	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	2.200	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	100	0	0	0,00
MYC	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf						
						\$ (67)	\$ (23)	0,00

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC USD versus CAD	CAD 1,265	11.02.2022	2.618	\$ (26)	\$ (32)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,880 %	15.09.2021	18.300	\$ (91)	\$ 0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	15.07.2021	2.100	(14)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	15.07.2021	2.100	(17)	0	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	06.08.2021	2.100	(14)	(15)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	06.08.2021	2.100	(16)	(2)	0,00
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	800	(61)	(115)	(0,02)
BRC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,000	07.02.2022	4.900	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	07.02.2022	4.900	(6)	(13)	0,00
DUB	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,020	21.12.2021	10.200	(47)	(1)	0,00
FAR	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,025	30.09.2021	3.600	(26)	(1)	0,00
FBF	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,399	26.08.2021	22.500	(200)	0	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,000	07.02.2022	5.000	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	07.02.2022	5.000	(7)	(14)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	13.07.2021	600	(3)	(4)	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	13.07.2021	600	(3)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	25.01.2022	2.400	(64)	(31)	(0,01)
	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,448	23.08.2021	19.100	(170)	0	0,00
	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,020	21.12.2021	14.400	(66)	(2)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettover-mögens
RYL	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018 %	07.07.2021	300	\$ (2)	\$ 0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	15.07.2021	1.000	(2)	(2)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	15.07.2021	1.000	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	25.01.2022	2.800	(42)	(36)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,000	07.02.2022	25.700	(33)	(4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	07.02.2022	25.700	(33)	(70)	(0,02)
							\$ (932)	\$ (319)	(0,06)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettover-mögens
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽¹⁾	1-Year USD-LIBOR	0,000 %	07.10.2022	12.500	\$ (13)	\$ (2)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽¹⁾	1-Year USD-LIBOR	0,000	08.10.2022	3.500	(3)	0	0,00
						\$ (16)	\$ (2)	0,00

⁽¹⁾ Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

⁽²⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettover-mögens
FAR	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	800	\$ (4)	\$ (1)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettover-mögens
BOA	Japan Government International Bond	(1,000) %	20.06.2022	\$ 400	\$ (14)	\$ 10	\$ (4)	0,01
BPS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	3.100	(111)	81	(30)	(0,01)
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.100	(53)	13	(40)	(0,01)
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.200	(23)	1	(22)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.500	(39)	11	(28)	(0,01)
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.200	(42)	3	(39)	(0,01)
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	2.800	(98)	70	(28)	(0,01)
HUS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.200	(30)	8	(22)	0,00
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.700	(40)	9	(31)	(0,01)
					\$ (450)	\$ 206	\$ (244)	(0,05)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettover-mögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 500	\$ (12)	\$ 20	\$ 8	0,00
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.300	11	6	17	0,01
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	(10)	16	6	0,00
CBK	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	1.100	(64)	31	(33)	(0,01)
	Abu Dhabi Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.200	58	9	67	0,01
GST	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	500	(12)	20	8	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	3.400	(54)	70	16	0,01
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2021	2.400	(165)	172	7	0,00
MYC	Abu Dhabi Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.300	36	4	40	0,01
	Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2021	€ 400	3	(1)	2	0,00
					\$ (209)	\$ 347	\$ 138	0,03

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettover- mögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 700	\$ 527	\$ 4	\$ (7)	\$ (3)	0,00
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	5.900	4.071	(2)	378	376	0,07
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	5.600	3.864	(11)	368	357	0,07
						\$ (9)	\$ 739	\$ 730	0,14

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BPS	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,000 %	16.06.2031	MYR 11.900	\$ (8)	\$ 23	\$ 15	0,01
CBK	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	16.06.2031	6.100	1	7	8	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,480	18.05.2027	THB 4.000	0	10	10	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,810	18.05.2037	32.000	0	140	140	0,03
JPM	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,960	11.02.2029	COP 15.800	0	0	0	0,00
						\$ (7)	\$ 180	\$ 173	0,04

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
BOA	07.2021	DKK 32.676	\$ 5.200	\$ 0	\$ (11)	\$ (11)	0,00
	07.2021	MXN 1.127	57	1	0	1	0,00
	08.2021	CAD 183	152	4	0	4	0,00
	08.2021	€ 1.613	1.940	25	0	25	0,00
	08.2021	\$ 11.635	CAD 14.038	0	(299)	(299)	(0,06)
	08.2021	4.490	CHF 4.051	0	(102)	(102)	(0,02)
	08.2021	163	CZK 3.383	0	(5)	(5)	0,00
	08.2021	514	€ 425	0	(9)	(9)	0,00
	08.2021	301	RUB 22.620	7	0	7	0,00
	09.2021	1.835	CNY 11.799	0	(18)	(18)	0,00
	09.2021	14.053	INR 1.034.632	0	(259)	(259)	(0,05)
	09.2021	699	PLN 2.652	0	(2)	(2)	0,00
	09.2021	728	RUB 53.132	0	(9)	(9)	0,00
	11.2021	204	RON 835	0	(4)	(4)	0,00
BPS	07.2021	988	NZD 1.361	0	(37)	(37)	(0,01)
	08.2021	AUD 5.750	\$ 4.490	172	0	172	0,03
	08.2021	€ 1.158	1.380	5	0	5	0,00
	08.2021	\$ 1.146	MXN 24.439	77	0	77	0,01
	08.2021	3.824	SEK 31.945	0	(87)	(87)	(0,02)
	09.2021	MYR 15.134	\$ 3.638	5	0	5	0,00
	09.2021	\$ 3.125	THB 97.707	0	(77)	(77)	(0,01)
	09.2021	968	VND 22.242.320	0	(4)	(4)	0,00
	11.2021	MXN 8.187	\$ 406	1	0	1	0,00
BRC	07.2021	DKK 6.660	€ 1.091	29	0	29	0,01
	08.2021	€ 5.044	€ 6.053	66	0	66	0,01
	08.2021	\$ 3.058	€ 2.508	0	(81)	(81)	(0,02)
	08.2021	5.974	MXN 123.815	219	0	219	0,04
	09.2021	458	PLN 1.742	0	0	0	0,00
CBK	07.2021	DKK 25.336	\$ 4.018	0	(22)	(22)	0,00
	07.2021	MXN 1.008	50	0	0	0	0,00
	07.2021	PEN 2.431	666	31	0	31	0,01
	07.2021	\$ 802	DKK 4.980	1	(9)	(8)	0,00
	07.2021	307	RUB 23.733	17	0	17	0,00
	08.2021	766	COP 2.841.241	0	(7)	(7)	0,00
	08.2021	296	€ 248	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	564	HUF 169.598	9	0	9	0,00
	08.2021	274	RUB 20.621	6	0	6	0,00
	09.2021	1.369	ZAR 18.839	0	(62)	(62)	(0,01)
	10.2021	PEN 27.295	\$ 7.517	373	0	373	0,07
	11.2021	ILS 28.307	8.675	7	(37)	(30)	(0,01)
	02.2022	11.902	3.670	11	(6)	5	0,00
	06.2022	3.097	956	0	0	0	0,00
	08.2022	1.014	307	0	(6)	(6)	0,00
GLM	07.2021	BRL 33.956	6.764	0	(3)	(3)	0,00
	07.2021	£ 16.962	23.980	548	0	548	0,11
	07.2021	\$ 278	BRL 1.469	14	0	14	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Advantage Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens	
	07.2021	\$	616	RUB	47.574	\$	33	0,01
	08.2021	€	824	\$	981		3	0,00
	08.2021	\$	6.743	BRL	33.956		2	0,00
	08.2021		983	RUB	72.478		7	0,00
	09.2021		1.999	HKD	15.505		0	0,00
	09.2021		395	KZT	171.575		2	0,00
	09.2021		734	PLN	2.789		0	0,00
	09.2021		918	RUB	67.282		0	0,00
	09.2021		4.512	TWD	123.627		0	0,00
	09.2021		648	ZAR	8.924		0	0,00
	11.2021		1.562	PEN	5.854		0	0,00
	02.2022	CAD	611	\$	506		0	0,00
HUS	07.2021	£	748		1.060		27	0,01
	07.2021	\$	23.559	£	16.998		0	0,00
	07.2021		363	ILS	1.179		0	0,00
	08.2021	€	1.929	\$	2.357		67	0,01
	08.2021	£	14.964		20.713		39	0,01
	08.2021	\$	27.503	¥	2.988.315		0	0,00
	08.2021		618	RUB	46.534		15	0,00
	09.2021	CNY	3.046	\$	469		0	0,00
	09.2021	PEN	1.876		508		17	0,00
	09.2021	\$	14.022	CNH	90.114		0	0,00
	09.2021		4.062	IDR	58.479.449		0	0,00
	09.2021		7.702	KRW	8.581.039		0	0,00
	09.2021		830	PLN	3.180		5	0,00
	09.2021		382	RUB	27.975		0	0,00
	10.2021	PEN	3.394	\$	902		13	0,00
	01.2022	ILS	3.377		1.046		6	0,00
JPM	07.2021	DKK	28.246		4.480		0	0,00
	07.2021	\$	3.913	DKK	24.377		0	0,00
	08.2021	€	4.748	\$	5.809		173	0,03
	08.2021	\$	276	CZK	5.760		0	0,00
	10.2021	DKK	24.377	\$	3.920		25	0,01
	12.2021	\$	1.151	PHP	55.559		0	0,00
MYI	07.2021	€	2	\$	2		0	0,00
	07.2021	PEN	1.150		315		15	0,00
	07.2021	\$	4.641	DKK	28.899		0	0,00
	07.2021		93	€	78		0	0,00
	07.2021		305	RUB	23.356		14	0,00
	08.2021		557	AUD	722		0	0,00
	10.2021	DKK	28.899	\$	4.649		32	0,01
SCX	07.2021	\$	289	PEN	1.150		11	0,00
	08.2021		81	CZK	1.695		0	0,00
	09.2021	PEN	1.150	\$	289		0	0,00
	12.2021	\$	1.465	SGD	1.940		0	0,00
SOG	07.2021		5.524	DKK	34.395		0	0,00
	07.2021		349	RUB	27.109		21	0,00
	08.2021		343		25.860		9	0,00
	10.2021	DKK	34.395	\$	5.533		38	0,01
SSB	07.2021	\$	6.133	BRL	32.487		342	0,07
	07.2021		1.009	£	712		0	0,00
UAG	07.2021		1.002	RUB	76.797		47	0,01
	08.2021	BRL	1.809	\$	365		6	0,00
	08.2021	\$	866	€	717		0	0,00
	08.2021		4.582	NOK	37.874		0	0,00
	09.2021		377	RUB	27.638		0	0,00
						\$	2.610	(0,02)
						\$	(2.699)	(0,02)
						\$	(89)	(0,02)

ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens	
BOA	07.2021	\$	50.072	CHF	44.918	\$	(1.478)	(0,29)
	07.2021		871	NOK	7.467		(3)	0,00
	08.2021	NOK	7.467	\$	871		3	0,00
BPS	07.2021	AUD	2.820		2.192		74	0,01
	07.2021	¥	1.145.827		10.477		153	0,03
	07.2021	NZD	652		473		18	0,00
	07.2021	\$	285	€	239		0	0,00
BRC	07.2021	CHF	832	\$	926		26	0,01
	07.2021	SEK	10.379		1.252		38	0,01
CBK	07.2021	AUD	977		756		22	0,00
	07.2021	CHF	45.266		49.169		198	0,04
	07.2021	NOK	7.467		894		26	0,01
	07.2021	\$	50.184	CHF	44.996		0	0,00
	08.2021		49.210		45.266		0	0,00
GLM	07.2021	£	4.209	\$	5.950		136	0,03

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
HUS	07.2021	\$	5.825	£	4.209	\$	0	\$	(11)	\$	(11)	0,00	
	08.2021	£	4.209	\$	5.826		11		0		11	0,00	
MYI	07.2021	\$	10.829	CHF	9.757		0		(274)		(274)	(0,05)	
SCX	07.2021	DKK	4.192	\$	680		12		0		12	0,00	
	07.2021	€	24.188		29.591		907		0		907	0,17	
	07.2021	\$	141	SEK	1.209		1		0		1	0,00	
TOR	07.2021	CAD	4.121	\$	3.411		83		0		83	0,02	
UAG	07.2021	\$	1.940	AUD	2.557		0		(20)		(20)	0,00	
	07.2021		159	CHF	147		0		(1)		(1)	0,00	
	08.2021	AUD	2.557	\$	1.940		20		0		20	0,00	
							\$	1.728	\$	(3.491)	\$	(1.763)	(0,34)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens						
BOA	07.2021	€	8	\$	10	\$	0	\$	0	\$	0	0,00	
	07.2021	\$	1.480	NOK	12.691		0		(5)		(5)	0,00	
	08.2021	NOK	12.691	\$	1.481		5		0		5	0,00	
BPS	07.2021	AUD	5.171		4.019		136		0		136	0,03	
	07.2021	€	50		60		0		0		0	0,00	
	07.2021	NZD	1.483		1.076		40		0		40	0,01	
	07.2021	\$	190	£	137		0		0		0	0,00	
BRC	07.2021	CHF	2.324	\$	2.587		73		0		73	0,01	
	07.2021	¥	2.133.722		19.509		285		0		285	0,06	
	07.2021	SEK	17.063		2.058		63		0		63	0,01	
	07.2021	\$	8.246	€	6.769		0		(218)		(218)	(0,04)	
CBK	07.2021	AUD	1.792	\$	1.386		41		0		41	0,01	
	07.2021	¥	115.430		1.053		13		0		13	0,00	
	07.2021	NOK	12.691		1.519		45		0		45	0,01	
	07.2021	\$	436	¥	48.042		0		(3)		(3)	0,00	
GLM	07.2021	£	7.810	\$	11.041		252		0		252	0,05	
	07.2021	\$	330	¥	36.541		0		(1)		(1)	0,00	
HUS	07.2021	€	33	\$	40		1		0		1	0,00	
	07.2021	\$	523	€	439		0		(2)		(2)	0,00	
	07.2021		11.394	£	8.232		0		(22)		(22)	0,00	
	08.2021	£	8.232	\$	11.395		22		0		22	0,00	
MYI	07.2021	€	2.260		2.690		11		0		11	0,00	
SCX	07.2021	DKK	8.558		1.388		23		0		23	0,00	
	07.2021	\$	102.547	€	83.823		0		(3.141)		(3.141)	(0,61)	
SSB	07.2021	CAD	412	\$	341		8		0		8	0,00	
	07.2021		£422		598		15		0		15	0,00	
TOR	07.2021	CAD	7.648		6.330		154		0		154	0,03	
	07.2021	\$	48.971	€	40.030		0		(1.500)		(1.500)	(0,29)	
UAG	07.2021	AUD	377	\$	291		8		0		8	0,00	
	07.2021	\$	3.749	AUD	4.943		0		(39)		(39)	(0,01)	
	08.2021	AUD	4.943	\$	3.750		38		0		38	0,01	
							\$	1.233	\$	(4.931)	\$	(3.698)	(0,72)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklasse Institutional GBP (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens						
BPS	07.2021	AUD	5	\$	4	\$	0	\$	0	\$	0	0,00	
	07.2021	¥	1.919		18		0		0		0	0,00	
	07.2021	NZD	1		1		0		0		0	0,00	
BRC	07.2021	CHF	2		2		0		0		0	0,00	
CBK	07.2021	AUD	2		1		0		0		0	0,00	
GLM	07.2021	\$	85	£	60		0		(2)		(2)	0,00	
HUS	07.2021	£	63	\$	88		0		0		0	0,00	
	07.2021	SEK	16		2		0		0		0	0,00	
	08.2021	\$	88	£	63		0		0		0	0,00	
MYI	07.2021	NOK	12	\$	1		0		0		0	0,00	
SCX	07.2021	DKK	7		1		0		0		0	0,00	
	07.2021	€	41		50		2		0		2	0,00	
	07.2021	\$	9	£	6		0		0		0	0,00	
SSB	07.2021	£	63	\$	87		0		0		0	0,00	
	08.2021	\$	87	£	63		0		0		0	0,00	
TOR	07.2021	CAD	7	\$	6		0		0		0	0,00	
UAG	07.2021	\$	3	AUD	4		0		0		0	0,00	
	07.2021		85	£	60		0		(2)		(2)	0,00	
	08.2021	AUD	4	\$	3		0		0		0	0,00	
							\$	2	\$	(4)	\$	(2)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Advantage Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens	
BOA	07.2021	NOK	184.039	\$	21.466	\$	79	0,02
	07.2021	\$	68	¥	7.506		0	0,00
	08.2021		21.469	NOK	184.039		(79)	(0,01)
BPS	07.2021	AUD	1.148	\$	893		30	0,01
	07.2021	¥	482.197		4.409		64	0,01
	07.2021	NZD	253		184		7	0,00
	07.2021	\$	39	AUD	52		0	0,00
BRC	07.2021		190	€	159		(1)	0,00
	07.2021		73	CHF	65		(2)	0,00
CBK	07.2021	AUD	398	\$	308		9	0,00
	07.2021	CHF	575		642		19	0,00
GLM	07.2021	\$	98	¥	10.844		(1)	0,00
	07.2021		20.813	NOK	173.849		(611)	(0,12)
	07.2021	£	1.776	\$	2.511		57	0,01
HUS	07.2021	\$	43	CAD	53		0	0,00
	07.2021	SEK	3.905	\$	473		16	0,00
	07.2021	\$	84	€	71		0	0,00
MYI	07.2021		2.409	£	1.740		(4)	0,00
	08.2021	£	1.740	\$	2.409		5	0,00
	07.2021	NOK	2.480		300		12	0,00
SCX	07.2021	\$	50	£	36		0	0,00
	07.2021		20.820	NOK	173.626		(643)	(0,12)
	07.2021	DKK	1.882	\$	305		5	0,00
SSB	07.2021	€	10.082		12.334		378	0,07
	07.2021	\$	8	NOK	65		0	0,00
	07.2021		4.623		38.606		(136)	(0,03)
TOR	07.2021	CAD	1.750	\$	1.449		35	0,01
UAG	07.2021	\$	763	AUD	1.006		(8)	0,00
	08.2021	AUD	1.006	\$	763		8	0,00
						\$	724	
						\$	(1.485)	
						\$	(761)	
							(0,15)	
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$	(5.674)	(1,10)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTOVER- MÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 9.350	\$ (9.423)	(1,83)
2,500 % fällig am 01.07.2051	1.700	(1.759)	(0,34)
2,500 % fällig am 01.08.2051	5.900	(6.091)	(1,18)
3,000 % fällig am 01.09.2051	900	(937)	(0,18)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (18.210)	(3,53)
Summe Anlagen		\$ 594.972	115,38
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (79.307)	(15,38)
Nettovermögen		\$ 515.665	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

[^] Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(h) Mit dem Fonds verbunden.

(i) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(j) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	3,035 %	28.05.2032	21.06.2021	\$ 1.065	\$ 1.070	0,21
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	21.01.2021	802	815	0,16
				\$ 1.867	\$ 1.885	0,37

(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 37.252 als Sicherheiten verpfändet.

(l) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 12.728 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 540 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 5.995 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 6.400 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 609.754	\$ 1.606	\$ 611.360
Investmentfonds	8.842	0	0	8.842
Finanzderivate ⁽³⁾	(346)	(6.674)	0	(7.020)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(18.210)	0	(18.210)
Summen	\$ 8.496	\$ 584.870	\$ 1.606	\$ 594.972

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 763.436	\$ 2.575	\$ 766.011
Investmentfonds	19.995	0	0	19.995
Pensionsgeschäfte	0	1.298	0	1.298
Finanzderivate ⁽³⁾	52	7.683	(1)	7.734
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(44.384)	0	(44.384)
Summen	\$ 20.047	\$ 728.033	\$ 2.574	\$ 750.654

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BRC	(4,000) %	30.06.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (423)	\$ (502)	(0,10)
GRE	0,040	19.05.2021	19.07.2021	\$ (16.456)	(16.457)	(3,19)
	0,050	05.05.2021	06.07.2021	(289)	(289)	(0,05)
	0,050	24.06.2021	14.07.2021	(2.668)	(2.668)	(0,52)
	0,060	06.05.2021	07.07.2021	(1.855)	(1.855)	(0,36)
IND	0,060	12.05.2021	12.07.2021	(9.987)	(9.987)	(1,94)
	0,070	25.06.2021	09.07.2021	(4.998)	(4.998)	(0,97)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (36.756)	(7,13)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	% des Nettovermögens
BOS	0,040 %	18.06.2021	02.07.2021	\$ (559)	\$ (559)	(0,11)
BPS	(0,095)	29.06.2021	13.07.2021	¥ (174.890)	(1.576)	(0,31)
	(0,060)	29.06.2021	13.07.2021	(745.931)	(6.721)	(1,30)
TDM	0,070	30.06.2021	02.07.2021	\$ (3.889)	(3.889)	(0,75)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (12.745)	(2,47)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Advantage Fund (Forts.)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (3)	\$ 0	\$ (3)
BOA	(2.170)	1.770	(400)
BPS	523	(320)	203
BRC	416	(210)	206
CBK	(993)	770	(223)
DUB	(5)	(20)	(25)
FAR	5	0	5
FBF	(4)	0	(4)
GLM	1.252	(790)	462
GST	(53)	260	207
HUS	(791)	600	(191)
JPM	81	0	81
MYC	(1)	(560)	(561)
MYI	(881)	500	(381)
RYL	(74)	0	(74)
SCX	(1.840)	1.590	(250)
SOG	30	0	30
SSB	203	(270)	(67)
TOR	(1.228)	910	(318)
UAG	(141)	0	(141)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	79,49	79,21
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	38,17	65,92
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,90	0,98
Investmentfonds	1,71	3,81
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,27)	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,10)	1,46
Leerverkaufte Wertpapiere	(3,53)	(8,47)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(7,13)	(9,05)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(2,47)	(2,38)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Argentinien	0,03	0,04
Australien	3,30	3,73
Brasilien	1,27	2,03
Kanada	0,76	0,78
Cayman Inseln	3,86	3,65
Chile	0,53	0,57
China	5,53	1,81
Kolumbien	0,03	0,42
Tschechische Republik	0,10	0,10
Dänemark	3,16	3,94
Dominikanische Republik	0,17	k. A.
Frankreich	2,51	3,43
Deutschland	3,58	2,99
Guatemala	0,09	k. A.
Hongkong	0,26	0,41
Ungarn	k. A.	0,10
Indien	0,36	0,35
Indonesien	1,02	1,68
Irland	3,10	1,90
Israel	2,35	0,77
Italien	7,09	7,68
Japan	6,28	7,31
Kuwait	1,24	1,24
Luxemburg	0,95	1,30
Malaysia	1,17	0,29
Mexiko	0,40	0,40
Multinational	0,28	0,42
Niederlande	2,14	1,85
Neuseeland	0,08	0,14
Norwegen	0,14	0,35
Peru	1,62	2,11
Philippinen	0,10	0,11
Portugal	0,09	0,09
Katar	0,95	0,82

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Rumänien	0,54	0,32
Russland	2,08	3,74
Saudi-Arabien	1,35	1,46
Serbien	1,00	1,03
Singapur	0,83	0,80
Slowenien	0,33	0,32
Südafrika	0,22	0,22
Südkorea	0,84	0,88
Spanien	1,31	2,69
Supranational	0,46	0,22
Schweiz	1,19	1,07
Vereinigte Arabische Emirate	0,48	0,96
Großbritannien	13,07	12,70
USA	38,96	66,87
Kurzfristige Instrumente	1,36	0,02
Investmentfonds	1,71	3,81
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,01
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,01)	(0,05)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	k. A.
Zinsswaps – Basisswaps	(0,01)	(0,01)
Zinsswaps	(0,26)	0,07
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	0,02	0,06
Optionen auf Wertpapiere	0,02	0,01
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Devisenoptionen	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,06)	(0,02)
Zinsscaps	0,00	0,00
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,05)	(0,06)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	0,01
Cross-Currency Swaps	0,14	0,20
Zinsswaps	0,04	0,03
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,02)	0,42
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,21)	0,84
Leerverkaufte Wertpapiere	(3,53)	(8,47)
Sonstige Aktiva und Passiva	(15,38)	(43,18)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				STAATSEMISSIONEN				CHINA						
AUSTRALIEN				CAYMAN INSELN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Pepper SPARKZ Trust No.3 1,062 % fällig am 17.08.2028	AUD	16.213	12.239	0,08	Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.06.2028	650	554	0,00	1,256 % fällig am 12.02.2022	\$	275.850	277.064	1,89	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Commonwealth Bank of Australia 3,000 % fällig am 04.09.2026	£	11.400	17.513	0,12	Ontario Teachers' Finance Trust 0,900 % fällig am 20.05.2041	9.700	11.540	0,08	1,375 % fällig am 26.01.2026	\$	6.500	6.466	0,04	
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Interstar Millennium Trust 0,430 % fällig am 27.03.2038	AUD	10	7	0,00	Province of Alberta 3,350 % fällig am 01.11.2023	\$	3.800	4,058	0,03	S.A. Global Sukuk Ltd. 0,946 % fällig am 17.06.2024		4.000	3.999	0,03
Pepper Residential Securities Trust 1,210 % fällig am 16.09.2059		8.204	6.202	0,04	Province of Ontario 0,010 % fällig am 25.11.2030	€	30.200	35.040	0,24	2,694 % fällig am 17.06.2031		6.200	6.285	0,04
RESIMAC Bastille Trust 1,010 % fällig am 05.09.2057	\$	5.880	5.898	0,04	Province of Quebec 3,000 % fällig am 01.09.2023	€	16.200	13.763	0,09	Sands China Ltd. 4,600 % fällig am 08.08.2023		5.000	5.327	0,04
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN						
Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD	286.300	211.281	1,44	3,500 % fällig am 01.12.2022	CAD	57.200	47.404	0,32	5,125 % fällig am 08.08.2025		3.900	4.367	0,03
1,000 % fällig am 21.12.2030		13.800	9.948	0,07	Summe Kanada		422.410	2,87	5,400 % fällig am 08.08.2028		9.100	10.576	0,07	
1,750 % fällig am 21.06.2051		71.150	47.239	0,32	CAYMAN INSELN				Tencent Holdings Ltd. 1,810 % fällig am 26.01.2026		10.900	11.085	0,08	
2,500 % fällig am 21.05.2030		17.700	14.545	0,10	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				3,925 % fällig am 19.01.2028		3.240	3.552	0,02	
Northern Territory Treasury Corp. 2,000 % fällig am 21.04.2031		11.200	8.404	0,06	Assurant CLO Ltd. 1,438 % fällig am 20.10.2029	\$	15.900	15.910	0,11	3,925 % fällig am 19.01.2038		1.100	1.200	0,01
Queensland Treasury Corp. 4,750 % fällig am 21.07.2025		375	327	0,00	Atlas Senior Loan Fund Ltd. 1,530 % fällig am 16.01.2030		11.600	11.606	0,08	Summe Cayman Inseln		372.752	2,54	
Treasury Corp. of Victoria 4,250 % fällig am 20.12.2032		25.060	23.374	0,16	Catamaran CLO Ltd. 1,444 % fällig am 22.04.2030		25.768	25.784	0,18			552.572	3,76	
Summe Australien		356.977	2,43	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
ÖSTERREICH				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Erste Group Bank AG 4,250 % fällig am 15.10.2027 (g)(i)	€	9.800	12.466	0,08	CBAM CLO Ltd. 1,308 % fällig am 20.10.2029		31.900	31.920	0,22	CNPC Global Capital Ltd. 1,125 % fällig am 23.06.2023		15.600	15.640	0,11
BELGIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
KBC Group NV 4,250 % fällig am 24.10.2025 (g)(i)		2.000	2.523	0,02	ICG U.S. CLO Ltd. 1,584 % fällig am 22.10.2031		24.000	24.052	0,16	1,350 % fällig am 23.06.2025		7.200	7.182	0,05
BRASILIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Banco Votorantim S.A. 4,000 % fällig am 24.09.2022	\$	200	207	0,00	KKR Financial CLO Ltd. 1,460 % fällig am 18.07.2030		3.300	3.302	0,02	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 3,900 % fällig am 17.05.2022		1.100	1.129	0,01
4,500 % fällig am 24.09.2024		2.200	2.326	0,02	Mountain View CLO Ltd. 0,984 % fällig am 15.10.2026		211	211	0,00	4,375 % fällig am 10.04.2024		400	437	0,00
Summe Brasilien		2.533	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
KANADA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Bank of Montreal 0,200 % fällig am 26.01.2023	€	500	599	0,00	OCP CLO Ltd. 0,984 % fällig am 15.07.2027		420	420	0,00	China Development Bank 3,050 % fällig am 25.08.2026	CNY	635.000	97.096	0,66
0,750 % fällig am 21.09.2022		400	482	0,00	OZLM Ltd. 1,186 % fällig am 16.05.2030		9.200	9.198	0,06	3,180 % fällig am 05.04.2026		392.900	60.563	0,41
Enbridge, Inc. 0,655 % fällig am 18.02.2022	\$	45.900	46.017	0,31	Telos CLO Ltd. 1,460 % fällig am 17.01.2027		706	706	0,01	3,340 % fällig am 14.07.2025		149.200	23.213	0,16
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	€	15.000	19.572	0,13	Venture CLO Ltd. 1,064 % fällig am 15.04.2027		2.542	2.538	0,02	3,430 % fällig am 14.01.2027		56.000	8.702	0,06
HSBC Bank Canada 1,650 % fällig am 10.09.2022	\$	14.900	15.154	0,10	WhiteHorse Ltd. 1,120 % fällig am 17.04.2027		593	594	0,00	3,500 % fällig am 13.08.2026		193.000	30.167	0,21
3,300 % fällig am 28.11.2021		5.300	5.367	0,04	Zais CLO Ltd. 1,334 % fällig am 15.04.2028		8.562	8.573	0,06	3,680 % fällig am 26.02.2026		1.542.800	242.873	1,65
Royal Bank of Canada 0,520 % fällig am 30.01.2025	£	19.700	27.461	0,19	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
0,629 % fällig am 03.10.2024		49.900	69.774	0,48	Ambac LSNI LLC 6,000 % fällig am 12.02.2023		530	530	0,00	3,740 % fällig am 10.09.2025		10.700	1.687	0,01
Summe Australien		356.977	2,43	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Non-Agency-MBS		184.426	1,25	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	Baidu, Inc. 3,875 % fällig am 29.09.2023		300	319	0,00	4,040 % fällig am 10.04.2027		1.133.400	181.346	1,23
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	China Mengniu Dairy Co. Ltd. 3,000 % fällig am 18.07.2024		7.700	8.092	0,06	4,150 % fällig am 26.10.2025		51.300	8.226	0,06
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,700 % fällig am 12.07.2026		1.400	1.387	0,01	4,240 % fällig am 24.08.2027		1.306.700	211.423	1,44
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	KSA Sukuk Ltd. 2,894 % fällig am 20.04.2022		7.700	7.847	0,05	4,880 % fällig am 09.02.2028		573.400	96.297	0,66
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	QNB Finance Ltd. 1,176 % fällig am 02.05.2022		15.100	15.176	0,10	China Government Bond 2,850 % fällig am 04.06.2027		471.900	72.297	0,49
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	Ambac LSNI LLC 6,000 % fällig am 12.02.2023		530	530	0,00	2,950 % fällig am 16.06.2023		32.900	5.125	0,03
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	Baidu, Inc. 3,875 % fällig am 29.09.2023		300	319	0,00	3,020 % fällig am 22.10.2025		491.300	76.346	0,52
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	China Mengniu Dairy Co. Ltd. 3,000 % fällig am 18.07.2024		7.700	8.092	0,06	3,220 % fällig am 06.12.2025		32.800	5.146	0,03
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,700 % fällig am 12.07.2026		1.400	1.387	0,01	3,280 % fällig am 03.12.2027		517.000	81.160	0,55
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	KSA Sukuk Ltd. 2,894 % fällig am 20.04.2022		7.700	7.847	0,05	3,290 % fällig am 18.10.2023		98.600	15.494	0,11
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	QNB Finance Ltd. 1,176 % fällig am 02.05.2022		15.100	15.176	0,10	3,820 % fällig am 02.11.2027		67.600	10.952	0,07
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	Ambac LSNI LLC 6,000 % fällig am 12.02.2023		530	530	0,00	Summe China		1.228.113	8,35	
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	Baidu, Inc. 3,875 % fällig am 29.09.2023		300	319	0,00			1.252.501	8,52	
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	China Mengniu Dairy Co. Ltd. 3,000 % fällig am 18.07.2024		7.700	8.092	0,06					
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,700 % fällig am 12.07.2026		1.400	1.387	0,01					
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	KSA Sukuk Ltd. 2,894 % fällig am 20.04.2022		7.700	7.847	0,05					
NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS				NON-AGENCY-MBS						
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	2.442	2.031	0,02	QNB Finance Ltd. 1,176 % fällig am 02.05.2022		15.100	15.176	0,10					

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS				
DANEMARK				RENALT S.A.				Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd.							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,375 % fällig am 25.05.2026				3,950 % fällig am 05.02.2023							
Danske Bank A/S				€	4.800	\$ 5.784	0,04								
3,001 % fällig am 20.09.2022	\$	5.200	\$ 5.226	0,04											
Jyske Realkredit A/S								Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.							
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	526.778	80.382	0,55				1,697 % fällig am 25.05.2023	6.900	6.933	0,05				
1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00				3,150 % fällig am 12.10.2025	8.300	8.642	0,06				
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00				Summe Hongkong		53.205	0,36				
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00				JUNGARN							
2,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00				STAATSEMISSIONEN							
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00				Hungary Government International Bond							
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab								3,000 % fällig am 27.10.2027			HUF	117.500	415	0,00	
1,000 % fällig am 01.10.2050	628.851	95.992	0,65					INDIEN							
1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0,00					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0,00					Shriram Transport Finance Co. Ltd.							
2,000 % fällig am 01.10.2037		0	0,00					5,700 % fällig am 27.02.2022			\$	6.600	6.684	0,05	
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0,00					5,950 % fällig am 24.10.2022			\$	7.500	7.684	0,05	
2,000 % fällig am 01.10.2050		0	0,00					Summe Indien					14.368	0,10	
2,500 % fällig am 01.10.2037		0	0,00					INDONESIEN							
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0,00					STAATSEMISSIONEN							
Nykredit Realkredit A/S								Indonesia Government International Bond							
0,000 % fällig am 01.10.2022	€	200	238	0,00				4,200 % fällig am 15.10.2050			9.000	10.271	0,06		
1,000 % fällig am 01.07.2021	DKK	1.500	239	0,00				7,750 % fällig am 17.01.2038			500	758	0,01		
1,000 % fällig am 01.10.2050		2.231.195	340.447	2,32				Summe Indonesien					11.029	0,07	
1,000 % fällig am 01.10.2053		53.021	8.058	0,05				IRLAND							
1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0,00					FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE							
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0,00					Accunia European CLO DAC							
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0,00					0,950 % fällig am 15.07.2030			€	7.050	8.365	0,06	
2,000 % fällig am 01.10.2050		0	0,00					Adagio CLO DAC							
2,500 % fällig am 01.10.2036		0	0,00					0,720 % fällig am 15.10.2031			10.250	12.143	0,08		
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0,00					ALME Loan Funding DAC							
3,000 % fällig am 01.10.2047		0	0,00					0,750 % fällig am 15.01.2031			6.345	7.516	0,05		
Realkredit Danmark A/S								Aquaduct European CLO DAC							
0,750 % fällig am 01.01.2038		0	0,00					0,840 % fällig am 20.07.2030			15.000	17.817	0,12		
2,000 % fällig am 01.10.2050		0	0,00					Ares European CLO DAC							
2,500 % fällig am 01.04.2036		0	0,00					0,660 % fällig am 15.10.2030			15.700	18.606	0,13		
2,500 % fällig am 01.04.2047		0	0,00					Armada Euro CLO DAC							
3,000 % fällig am 01.07.2046		0	0,00					0,720 % fällig am 15.07.2031			9.000	10.652	0,07		
Summe Dänemark		530.582	3,61					Aurium CLO DAC							
FINNLAND				DEUTSCHLAND				IRLAND							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE							
Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj								Bain Capital Euro DAC							
0,625 % fällig am 23.05.2025	€	1.000	1.233	0,01				0,740 % fällig am 20.01.2032			12.500	14.809	0,10		
FRANKREICH				Aareal Bank AG				Black Diamond CLO DAC							
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				2,625 % fällig am 15.07.2021				0,650 % fällig am 03.10.2029							
FCT Ginkgo Compartment Sales Finance								1,244 % fällig am 03.10.2029				\$	2.291	2.291	0,02
0,000 % fällig am 25.11.2044		80	94	0,00				Blackrock European CLO DAC							
FCT Titrisocram								0,620 % fällig am 15.10.2031				€	10.800	12.752	0,09
0,000 % fällig am 25.07.2036		32	38	0,00				BlueMountain Fuji EUR CLO DAC							
								0,720 % fällig am 15.01.2031				11.250	13.325	0,09	
								Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC							
								0,750 % fällig am 15.11.2031				11.500	13.579	0,09	
								Castle Park CLO DAC							
								0,462 % fällig am 15.01.2028				212	252	0,00	
								CVC Cordatus Loan Fund DAC							
								0,650 % fällig am 21.07.2030				22.600	26.815	0,18	
								Dryden Euro CLO BV							
								0,860 % fällig am 15.05.2034 (b)				23.450	27.809	0,19	
								GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC							
								1,550 % fällig am 20.07.2031				31.700	37.655	0,26	
								Griffith Park CLO DAC							
								0,720 % fällig am 21.11.2031				14.300	16.895	0,12	
								Harvest CLO DAC							
								0,650 % fällig am 26.06.2030				9.950	11.787	0,08	
								0,760 % fällig am 15.07.2031				9.850	11.716	0,08	
								0,960 % fällig am 20.10.2031				15.500	18.362	0,13	
								Laurelin DAC							
								0,720 % fällig am 20.10.2031				15.000	17.772	0,12	
								Madison Park Euro Funding DAC							
								0,750 % fällig am 15.01.2032				22.900	27.195	0,19	
								OAK Hill European Credit Partners DAC							
								0,740 % fällig am 20.10.2031				24.100	28.543	0,19	
								Summe Deutschland						527.666	3,59
								HONGKONG							
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
								Horse Gallop Finance Ltd.							
								3,250 % fällig am 30.05.2022				\$	20.200	20.567	0,14
								Huarong Finance Co. Ltd.							
								2,125 % fällig am 30.09.2023				13.700	10.448	0,07	

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Palmer Square European Loan Funding DAC				Nexti SpA				Japan Government International Bond			
0,870 % fällig am 15.02.2030	€ 16.611	\$ 19.729	0,13	1,625 % fällig am 30.04.2026	€ 16.700	\$ 19.742	0,13	0,100 % fällig am 10.03.2028 (f)	¥ 10.139.847	\$ 93.734	0,64
1,150 % fällig am 15.01.2030	5.492	6.536	0,04	UniCredit SpA				0,200 % fällig am 20.06.2036	202.750	1.811	0,01
Pepper Iberia Unsecured DAC				2,200 % fällig am 22.07.2027	6.650	8.392	0,06	0,500 % fällig am 20.09.2046	9.246.000	81.748	0,56
0,000 % fällig am 07.04.2028	2.304	2.738	0,02	7,500 % fällig am 03.06.2026 (g)(i)	8.400	11.837	0,08	0,500 % fällig am 20.03.2049	14.938.000	129.694	0,88
Segovia European CLO DAC				7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 25.710	29.805	0,20	0,700 % fällig am 20.12.2048	12.616.150	115.532	0,79
0,880 % fällig am 20.07.2032 (b)	13.700	16.247	0,11			235.492	1,60	1,300 % fällig am 20.06.2035	8.720.000	90.188	0,61
Sorrento Park CLO DAC								1,400 % fällig am 20.09.2034	15.880.000	165.618	1,13
0,409 % fällig am 16.11.2027	1.365	1.619	0,01	STAATSEMISSIONEN				Tokyo Metropolitan Government			
1,200 % fällig am 16.11.2027	71	84	0,00	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				0,750 % fällig am 16.07.2025	\$ 18.600	18.411	0,12
Toro European CLO DAC				1,850 % fällig am 01.07.2021	€ 100.000	127.501	0,87	2,625 % fällig am 29.05.2024	3.900	4.108	0,03
0,650 % fällig am 15.04.2030	22.600	26.800	0,18	2,150 % fällig am 01.03.2072	2.500	2.903	0,02			809.606	5,51
0,900 % fällig am 15.10.2030	26.627	31.621	0,22	Italy Government International Bond				Summe Japan		1.488.005	10,12
Vendome Funding CLO DAC				6,000 % fällig am 04.08.2028	£ 5.484	9.792	0,07	JERSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
1,860 % fällig am 20.07.2031	8.300	9.853	0,07			140.196	0,96	Atrium European Real Estate Ltd.			
		475.294	3,24	Summe Italien		375.688	2,56	3,000 % fällig am 11.09.2025	€ 9.800	12.600	0,09
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				JAPAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				KASACHSTAN STAATSEMISSIONEN			
AerCap Ireland Capital DAC				Central Nippon Expressway Co. Ltd.				Kazakhstan Government International Bond			
3,500 % fällig am 15.01.2025	\$ 1.300	1.378	0,01	2,091 % fällig am 14.09.2021	\$ 13.400	13.447	0,09	5,125 % fällig am 21.07.2025	\$ 600	698	0,00
AIB Group PLC				2,567 % fällig am 02.11.2021	70.700	71.184	0,48	KUWAIT STAATSEMISSIONEN			
2,875 % fällig am 30.05.2031	€ 1.700	2.158	0,01	Mitsubishi Corp.				Kuwait International Government Bond			
4,750 % fällig am 12.10.2023	\$ 3.500	3.803	0,03	2,625 % fällig am 14.07.2022	400	409	0,00	3,500 % fällig am 20.03.2027	57.200	63.898	0,43
5,250 % fällig am 09.10.2024 (g)(i)	€ 2.700	3.458	0,02	Mitsubishi HC Capital, Inc.				LITAUEN STAATSEMISSIONEN			
Bank of Ireland Group PLC				2,250 % fällig am 07.09.2021	1.600	1.605	0,01	Lithuania Government International Bond			
1,375 % fällig am 29.08.2023	500	612	0,00	2,652 % fällig am 19.09.2022	5.100	5.222	0,04	6,625 % fällig am 01.02.2022	8.800	9.134	0,06
German Postal Pensions Securitisation PLC				Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,375 % fällig am 18.01.2022	300	365	0,00	1,412 % fällig am 17.07.2025	29.800	30.097	0,20	Aroundtown S.A.			
SMBC Aviation Capital Finance DAC				2,193 % fällig am 25.02.2025	33.200	34.565	0,24	0,000 % fällig am 16.07.2026 (d)	€ 12.700	14.722	0,10
3,000 % fällig am 15.07.2022	\$ 900	921	0,01	3,455 % fällig am 02.03.2023	24.400	25.635	0,17	0,375 % fällig am 23.09.2022	11.200	13.363	0,09
		12.695	0,08	Mizuho Financial Group, Inc.				2,000 % fällig am 02.11.2026	7.000	8.929	0,06
NON-AGENCY-MBS				0,777 % fällig am 25.05.2024	12.600	12.681	0,09	5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 2.100	2.515	0,02
Bluestep Mortgage Securities DAC				1,125 % fällig am 11.09.2024	12.700	12.879	0,09	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL			
0,188 % fällig am 10.08.2066	€ 61	73	0,00	1,241 % fällig am 10.07.2024	8.600	8.722	0,06	2,000 % fällig am 15.02.2024	€ 500	618	0,00
Dilosk RMBS DAC				2,721 % fällig am 16.07.2023	19.600	20.071	0,14	2,200 % fällig am 24.07.2025	5.700	7.228	0,05
0,213 % fällig am 20.10.2057	81	97	0,00	3,549 % fällig am 05.03.2023	19.900	20.942	0,14	CPI Property Group S.A.			
European Loan Conduit				3,922 % fällig am 11.09.2024	10.800	11.575	0,08	1,625 % fällig am 23.04.2027	14.500	17.714	0,12
1,000 % fällig am 17.02.2030	3.197	3.808	0,03	Nissan Motor Co. Ltd.				2,750 % fällig am 12.05.2026	900	1.163	0,01
		3.978	0,03	3,043 % fällig am 15.09.2023	11.800	12.312	0,08	Logicoor Financing SARL			
Summe Irland		491.967	3,35	3,522 % fällig am 17.09.2025	18.800	20.088	0,14	0,750 % fällig am 15.07.2024	10.700	12.910	0,09
ISRAEL STAATSEMISSIONEN				4,345 % fällig am 17.09.2027	17.300	19.032	0,13	1,500 % fällig am 14.11.2022	15.000	18.116	0,12
Israel Government International Bond				4,810 % fällig am 17.09.2030	18.200	20.567	0,14	2,250 % fällig am 13.05.2025	2.000	2.544	0,02
0,000 % fällig am 22.07.2022 (d)	31.900	37.955	0,26	NTT Finance Corp.				Medtronic Global Holdings S.C.A.			
0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS 216.800	66.533	0,45	1,900 % fällig am 21.07.2021	400	400	0,00	0,000 % fällig am 02.12.2022 (d)	8.100	9.658	0,07
0,750 % fällig am 31.07.2022	90.300	27.933	0,19	ORIX Corp.				Summe Luxemburg		109.480	0,75
2,000 % fällig am 31.03.2027	87.900	29.119	0,20	3,250 % fällig am 04.12.2024	4.300	4.638	0,03	NON-AGENCY-MBS			
3,375 % fällig am 15.01.2050	\$ 1.200	1.285	0,01	Panasonic Corp.				Miravet SARL			
3,800 % fällig am 13.05.2060	38.000	43.367	0,29	2,536 % fällig am 19.07.2022	7.000	7.140	0,05	0,307 % fällig am 26.05.2065	17.789	21.157	0,14
3,875 % fällig am 03.07.2050	400	464	0,00	Sumitomo Mitsui Banking Corp.				Summe Luxemburg		130.637	0,89
4,125 % fällig am 17.01.2048	8.100	9.767	0,07	0,010 % fällig am 10.09.2025	€ 43.200	51.572	0,35	MALAYSIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS 160.800	50.951	0,35	0,409 % fällig am 07.11.2029	26.100	31.551	0,21	Petronas Capital Ltd.			
Summe Israel		267.374	1,82	0,550 % fällig am 06.11.2023	35.300	42.694	0,29	2,480 % fällig am 28.01.2032	\$ 5.300	5.341	0,04
ITALIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,014 % fällig am 07.11.2022	\$ 55.300	56.569	0,39	3,500 % fällig am 21.04.2030	8.400	9.215	0,06
AMCO - Asset Management Co. SpA				2,440 % fällig am 18.06.2024	26.400	27.735	0,19	4,550 % fällig am 21.04.2050	6.100	7.542	0,05
1,500 % fällig am 17.07.2023	€ 35.500	43.469	0,30	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				4,800 % fällig am 21.04.2060	5.000	6.645	0,04
Atlantia SpA				1,050 % fällig am 19.07.2023	31.100	31.494	0,21			28.743	0,19
1,875 % fällig am 12.02.2028	8.700	10.632	0,07	3,748 % fällig am 19.07.2023	28.700	30.626	0,21				
Banca Carige SpA				Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.							
0,957 % fällig am 25.05.2022	20.600	24.541	0,17	0,010 % fällig am 15.10.2027	€ 34.400	40.621	0,28				
1,161 % fällig am 25.10.2021	11.100	13.204	0,09	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.							
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				1,125 % fällig am 21.11.2022	10.200	12.326	0,08				
0,875 % fällig am 08.10.2027	10.800	13.332	0,09			678.399	4,61				
2,000 % fällig am 29.01.2024	26.600	33.382	0,23	STAATSEMISSIONEN							
2,625 % fällig am 28.04.2025	2.800	3.378	0,02	Development Bank of Japan, Inc.							
4,000 % fällig am 10.07.2022 (l)	10.100	12.235	0,08	1,750 % fällig am 28.08.2024	\$ 13.400	13.855	0,09				
Intesa Sanpaolo SpA				1,875 % fällig am 02.10.2024	22.200	23.010	0,16				
5,875 % fällig am 01.09.2031 (g)(i)	8.550	11.543	0,08	Japan Bank for International Cooperation							
				1,750 % fällig am 17.10.2024	6.200	6.411	0,04				
				Japan Finance Organization for Municipalities							
				0,625 % fällig am 02.09.2025	1.400	1.377	0,01				
				2,625 % fällig am 20.04.2022	28.200	28.734	0,20				
				3,000 % fällig am 12.03.2024	13.300	14.133	0,10				
				3,375 % fällig am 27.09.2023	20.000	21.242	0,14				

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
STAATSEMISSIONEN			
Slovenia Government International Bond 5,250 % fällig am 18.02.2024	\$ 35.152	\$ 39.516	0,27
Summe Slowenien		52.938	0,36
SUDAFRIKA			
STAATSEMISSIONEN			
South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029		10.500	11,165
7,750 % fällig am 28.02.2023	ZAR 4.275	311	0,00
8,750 % fällig am 28.02.2048		2.125	126
Summe Südafrika		11.602	0,08
SÜDKOREA			
STAATSEMISSIONEN			
Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd. 25.07.2023	\$ 4.400	4.683	0,03
South Korea Government International Bond 2,125 % fällig am 10.06.2027	KRW 16.365.000	14.716	0,10
2,375 % fällig am 10.12.2027	14.900.000	13.595	0,09
2,375 % fällig am 10.12.2028	69.980.000	63.936	0,44
2,625 % fällig am 10.06.2028	32.730.000	30.332	0,21
5,500 % fällig am 10.03.2028	14.900.000	16.188	0,11
Summe Südkorea		143.450	0,98
SPANIEN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	€ 21.888	26.039	0,18
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (g)(i)	10.000	12.837	0,09
6,000 % fällig am 29.03.2024 (g)(i)	14.800	19.242	0,13
6,000 % fällig am 15.01.2026 (g)(i)	12.600	17.102	0,12
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 22.07.2025	3.300	3.994	0,03
Banco Santander S.A. 1,849 % fällig am 25.03.2026	\$ 10.600	10.719	0,07
4,375 % fällig am 14.01.2026 (g)(i)	€ 4.600	5.647	0,04
4,379 % fällig am 12.04.2028	\$ 2.600	2.975	0,02
5,250 % fällig am 29.09.2023 (g)(i)	€ 12.800	16.099	0,11
6,250 % fällig am 11.09.2021 (g)(i)	8.200	9.832	0,07
CaixaBank S.A. 1,750 % fällig am 24.10.2023	10.200	12.604	0,08
5,875 % fällig am 09.10.2027 (g)(i)	3.800	5.171	0,03
Merlin Properties Socimi S.A. 2,375 % fällig am 13.07.2027	2.500	3.239	0,02
		119.461	0,81
NON-AGENCY-MBS			
AyT Hipotecario Mixto FTA 0,000 % fällig am 20.01.2043	933	1.098	0,01

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
BESCHREIBUNG			
Fondo de Titulacion de Activos Santander Hipotecario 0,000 % fällig am 15.07.2042	€ 967	\$ 1.144	0,01
0,000 % fällig am 18.01.2049	664	786	0,00
Fondo de Titulacion de Activos UCI 0,000 % fällig am 15.09.2041	1.163	1.363	0,01
IM Pastor Fondo de Titulacion Hipotecaria 0,000 % fällig am 22.09.2041	2	3	0,00
		4.394	0,03
STAATSEMISSIONEN			
Autonomous Community of Catalonia			
4,220 % fällig am 26.04.2035	3.900	6.151	0,04
4,900 % fällig am 15.09.2021	28.500	34.153	0,23
Autonomous Community of Madrid			
0,747 % fällig am 30.04.2022	15.800	18.918	0,13
1,571 % fällig am 30.04.2029	800	1.043	0,01
Spain Government International Bond			
0,500 % fällig am 31.10.2031	200	238	0,00
0,800 % fällig am 30.07.2027	600	749	0,01
0,850 % fällig am 30.07.2037	66.850	78.130	0,53
1,000 % fällig am 31.10.2050	2.300	2.467	0,02
1,250 % fällig am 31.10.2030	370	475	0,00
1,400 % fällig am 30.07.2028	97.750	126.909	0,86
1,450 % fällig am 31.10.2027	700	909	0,01
1,450 % fällig am 31.10.2071	7.300	7.640	0,05
1,600 % fällig am 30.04.2025	35	45	0,00
1,850 % fällig am 30.07.2035	1.800	2.440	0,02
1,950 % fällig am 30.04.2026	400	525	0,00
2,150 % fällig am 31.10.2025	2.050	2.693	0,02
5,250 % fällig am 06.04.2029	€ 800	1.403	0,01
		284.888	1,94
Summe Spanien		434.782	2,96
SUPRANATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung			
0,500 % fällig am 01.09.2023	AUD 5.400	4.053	0,03
0,500 % fällig am 21.12.2023	4.000	2.994	0,02
Europäische Investitionsbank			
0,500 % fällig am 10.08.2023	€ 10.200	7.650	0,05
6,000 % fällig am 07.12.2028	€ 53	101	0,00
Europäische Union			
0,000 % fällig am 04.07.2031 (d)	€ 26.400	31.251	0,21
0,250 % fällig am 22.04.2036	16.600	19.319	0,13
0,700 % fällig am 06.07.2051 (b)	10.000	12.011	0,08
0,750 % fällig am 04.01.2047	700	855	0,01
Summe supranational		78.234	0,53
SCHWEIZ			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Credit Suisse AG			
0,250 % fällig am 05.01.2026	30.500	36.302	0,25
0,750 % fällig am 17.09.2021	4.600	5.470	0,04
2,100 % fällig am 12.11.2021	\$ 10.950	11.026	0,07
6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)	23.106	25.580	0,17
Credit Suisse Group AG			
3,091 % fällig am 14.05.2032	16.700	17.219	0,12
3,800 % fällig am 09.06.2023	13.250	14.047	0,10
3,869 % fällig am 12.01.2029	12.050	13.281	0,09
4,194 % fällig am 01.04.2031	1.600	1.800	0,01
7,250 % fällig am 12.09.2025 (g)(i)	400	452	0,00
7,500 % fällig am 17.07.2023 (g)(i)	2.400	2.616	0,02
UBS AG			
5,125 % fällig am 15.05.2024 (i)	11.650	12.869	0,09
7,625 % fällig am 17.08.2022 (i)	3.025	3.255	0,02
UBS Group AG			
0,157 % fällig am 20.09.2022	€ 800	950	0,01
5,125 % fällig am 29.07.2026 (g)(i)	\$ 8.200	8.943	0,06
Summe Schweiz		153.810	1,05
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
First Abu Dhabi Bank PJSC 1,134 % fällig am 16.04.2022	16.500	16.575	0,11

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
3,000 % fällig am 30.03.2022	\$ 2.500	\$ 2.551	0,02
		19.126	0,13
STAATSEMISSIONEN			
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond			
2,500 % fällig am 11.10.2022	1.600	1.645	0,01
3,125 % fällig am 16.04.2030	2.900	3.158	0,02
3,125 % fällig am 30.09.2049	12.900	13.195	0,09
3,875 % fällig am 16.04.2050	10.300	11.894	0,08
		29.892	0,20
Summe Vereinigte Arabische Emirate		49.018	0,33
GROSSBRITANNIEN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Bumper UK Finance PLC			
0,650 % fällig am 20.12.2028	£ 10.866	15.027	0,10
PCL Funding PLC			
1,100 % fällig am 15.09.2024	22.600	31.395	0,22
		46.422	0,32
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Annington Funding PLC			
1,650 % fällig am 12.07.2024	€ 100	124	0,00
AstraZeneca PLC			
0,821 % fällig am 17.08.2023	\$ 400	404	0,00
Barclays Bank PLC			
7,625 % fällig am 21.11.2022 (i)	58.579	63.912	0,44
Barclays PLC			
1,536 % fällig am 16.05.2024	6.800	6.928	0,05
1,586 % fällig am 15.02.2023	19.400	19.544	0,13
2,180 % fällig am 26.06.2024	AUD 4.000	3.127	0,02
2,375 % fällig am 06.10.2023	€ 6.250	8.839	0,06
3,125 % fällig am 17.01.2024	800	1.166	0,01
3,375 % fällig am 02.04.2025	€ 9.800	12.665	0,09
3,650 % fällig am 16.03.2025	\$ 7.500	8.135	0,06
3,684 % fällig am 10.01.2023	2.000	2.034	0,01
3,750 % fällig am 22.11.2030	€ 700	1.046	0,01
4,338 % fällig am 16.05.2024	\$ 1.200	1.280	0,01
4,375 % fällig am 12.01.2026	2.200	2.465	0,02
4,610 % fällig am 15.02.2023	18.000	18.463	0,13
4,836 % fällig am 09.05.2028	6.800	7.650	0,05
6,375 % fällig am 15.12.2025 (g)(i)	€ 4.300	6.660	0,05
7,125 % fällig am 15.06.2025 (g)(i)	3.900	6.169	0,04
7,250 % fällig am 15.03.2023 (g)(i)	600	896	0,01
7,750 % fällig am 15.09.2023 (g)(i)	\$ 1.000	1.101	0,01
8,000 % fällig am 15.06.2024 (g)(i)	8.200	9.333	0,06
BG Energy Capital PLC			
4,000 % fällig am 15.10.2021	200	202	0,00
British Telecommunications PLC			
1,125 % fällig am 10.03.2023	€ 900	1.092	0,01
9,625 % fällig am 15.12.2030	\$ 708	1.098	0,01
Frontier Finance PLC			
8,000 % fällig am 23.03.2022	£ 2.756	3.898	0,03
Grainger PLC			
3,375 % fällig am 24.04.2028	1.400	2.096	0,01
HSBC Holdings PLC			
1,139 % fällig am 16.02.2024	AUD 4.000	3.029	0,02
1,155 % fällig am 18.05.2024	\$ 6.800	6.689	0,05
1,750 % fällig am 24.07.2027	€ 15.600	21.806	0,15
2,648 % fällig am 04.06.2031	\$ 9.900	10.285	0,07
3,000 % fällig am 22.07.2028	€ 11.900	17.741	0,12
3,803 % fällig am 11.03.2025	\$ 1.900	2.044	0,01
3,950 % fällig am 18.05.2024	800	850	0,01
3,973 % fällig am 22.05.2030	21.700	24.308	0,17
4,041 % fällig am 13.03.2028	3.700	4.106	0,03
4,583 % fällig am 19.06.2029	19.000	21.974	0,15
4,950 % fällig am 31.03.2030	2.900	3.503	0,02
6,500 % fällig am 23.03.2028 (g)(i)	900	1.034	0,01
6,750 % fällig am 11.09.2028	€ 4.200	7.595	0,05
Imperial Brands Finance PLC			
3,750 % fällig am 21.07.2022	\$ 700	718	0,01
Lloyds Bank PLC			
4,875 % fällig am 30.03.2027	£ 18.000	30.574	0,21
5,125 % fällig am 07.03.2025	300	484	0,00
6,000 % fällig am 08.02.2029	150	283	0,00
Lloyds Banking Group PLC			
0,500 % fällig am 12.11.2025	€ 4.100	4.935	0,03
3,500 % fällig am 01.04.2026	15.700	20.960	0,14

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
4,582 % fällig am 10.12.2025	\$ 12.240	13.761	0,09	0,251 % fällig am 15.12.2038	£ 5.846	7.848	0,05	Towd Point Mortgage Funding PLC	£ 30.712	\$ 42.572	0,29
4,650 % fällig am 24.03.2026	17.200	19.490	0,13	Albion PLC	6.775	9.430	0,06	1,111 % fällig am 20.10.2051	23.201	32.223	0,22
4,947 % fällig am 27.06.2025 (g)(i)	€ 300	393	0,00	0,729 % fällig am 17.08.2062				Tower Bridge Funding PLC	30.467	42.538	0,29
7,500 % fällig am 27.06.2024 (g)(i)	\$ 1.288	1.469	0,01	Avon Finance No. 2 PLC	30.399	42.136	0,29	1,419 % fällig am 20.09.2063			
7,500 % fällig am 27.09.2025 (g)(i)	€ 7.965	9.339	0,06	0,949 % fällig am 20.09.2048				Trinity Square PLC	23.100	31.967	0,22
7,625 % fällig am 27.06.2023 (g)(i)	£ 300	455	0,00	Brass PLC	7.029	9.801	0,07	0,899 % fällig am 15.07.2059			
7,875 % fällig am 27.06.2029 (g)(i)	4.780	8.441	0,06	0,769 % fällig am 16.11.2066				Twin Bridges PLC	14.900	20.726	0,14
Marks & Spencer PLC	4.795	6.899	0,05	Business Mortgage Finance PLC	53	73	0,00	1,034 % fällig am 12.12.2052	10.072	13.983	0,10
Nationwide Building Society				1,086 % fällig am 15.02.2041				Uropa Securities PLC	3.151	4.257	0,03
1,700 % fällig am 13.02.2023	\$ 11.700	11.960	0,08	Canada Square Funding PLC	21.600	29.896	0,20	0,284 % fällig am 10.06.2059	77	104	0,00
4,000 % fällig am 14.09.2026	2.100	2.318	0,02	0,829 % fällig am 17.06.2058 (b)	18.731	26.018	0,18	0,434 % fällig am 10.06.2059	811	1.087	0,01
4,363 % fällig am 01.08.2024	11.200	12.021	0,08	1,149 % fällig am 17.10.2051	6.582	9.226	0,06	0,286 % fällig am 10.10.2040	634	850	0,01
5,750 % fällig am 20.06.2027 (g)(i)	£ 7.800	12.095	0,08	1,299 % fällig am 17.12.2057				0,634 % fällig am 10.06.2059	677	913	0,01
5,875 % fällig am 20.12.2024 (g)(i)	200	305	0,00	Eurohome UK Mortgages PLC	21	29	0,00	0,834 % fällig am 10.06.2059			
NatWest Group PLC	€ 22.550	27.302	0,19	0,231 % fällig am 15.06.2044				Warwick Finance Residential Mortgages PLC	1	2.348	0,02
0,750 % fällig am 15.11.2025				Eurosail PLC	€ 109	129	0,00	0,000 % fällig am 21.12.2049 (d)	53.182	73.698	0,50
NatWest Group PLC	\$ 10.300	10.410	0,07	0,000 % fällig am 10.12.2044	€ 200	232	0,00	0,999 % fällig am 21.12.2049	7.280	10.118	0,07
1,626 % fällig am 15.05.2023				0,000 % fällig am 15.12.2044	€ 478	552	0,00	1,699 % fällig am 21.12.2049	3.640	5.063	0,03
NatWest Group PLC	€ 6.400	7.703	0,05	0,244 % fällig am 10.12.2044	€ 217	299	0,00	2,199 % fällig am 21.12.2049	2.080	2.890	0,02
2,000 % fällig am 08.03.2023	1.600	1.996	0,01	0,784 % fällig am 13.09.2045	1.279	1.738	0,01	3,199 % fällig am 21.12.2049	2.080	2.879	0,02
2,000 % fällig am 04.03.2025	1.700	2.107	0,01	1,034 % fällig am 13.06.2045	66	91	0,00				
2,500 % fällig am 22.03.2023	€ 400	588	0,00	Feldspar PLC	1.093	1.512	0,01				
2,875 % fällig am 19.09.2026	\$ 8.900	9.133	0,06	0,781 % fällig am 15.09.2045							
3,498 % fällig am 15.05.2023	4.600	4.893	0,03	Finsbury Square PLC	13.177	18.261	0,12				
3,754 % fällig am 01.11.2029	5.000	5.343	0,04	1,034 % fällig am 12.09.2068	209	290	0,00				
3,875 % fällig am 12.09.2023	4.175	4.786	0,03	1,052 % fällig am 16.06.2069	8.465	11.773	0,08				
4,445 % fällig am 08.05.2030	200	215	0,00	1,059 % fällig am 16.12.2069	20.710	28.783	0,20				
4,519 % fällig am 25.06.2024	19.200	22.790	0,16	1,079 % fällig am 16.09.2069	9.214	12.866	0,09				
5,076 % fällig am 27.01.2030	11.900	13.293	0,09	1,349 % fällig am 16.06.2070							
6,000 % fällig am 29.12.2025 (g)(i)	2.100	2.490	0,02	Friary No. 6 PLC	8.875	12.376	0,08				
8,000 % fällig am 10.08.2025 (g)(i)	7.400	7.471	0,05	0,769 % fällig am 21.11.2067							
8,625 % fällig am 15.08.2021 (g)(i)				Great Hall Mortgages PLC	€ 535	632	0,00				
NatWest Markets PLC	€ 3.900	4.634	0,03	0,000 % fällig am 18.06.2038	€ 457	540	0,00	United Kingdom Gilt	£ 10.960	12.867	0,09
0,362 % fällig am 27.09.2021	7.000	8.362	0,06	0,000 % fällig am 18.03.2039	€ 4.670	6.156	0,04	0,625 % fällig am 22.07.2023	105	147	0,00
0,625 % fällig am 02.03.2022	7.721	9.451	0,06	0,320 % fällig am 18.03.2039				1,750 % fällig am 07.09.2022	25	35	0,00
Hawksmoor Mortgages PLC				1,099 % fällig am 25.05.2053	51.566	71.600	0,49	4,250 % fällig am 07.06.2032	200	375	0,00
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC	\$ 600	603	0,00	Ludgate Funding PLC	€ 624	719	0,01				
0,694 % fällig am 24.06.2022	11.000	11.213	0,08	0,000 % fällig am 01.01.2061							
2,375 % fällig am 24.06.2022				Mansard Mortgages PLC	£ 9.451	13.016	0,09				
Santander UK Group Holdings PLC	€ 21.800	26.098	0,18	0,731 % fällig am 15.12.2049							
0,391 % fällig am 28.02.2025	\$ 18.900	18.973	0,13	Newgate Funding PLC	€ 2.670	2.995	0,02				
1,089 % fällig am 15.03.2025	10.300	10.324	0,07	0,000 % fällig am 01.12.2050	€ 884	1.044	0,01	Accredited Mortgage Loan Trust	\$ 3.226	3.181	0,02
2,875 % fällig am 05.08.2021	€ 2.600	3.813	0,03	0,052 % fällig am 15.12.2050	€ 665	895	0,01	0,352 % fällig am 25.09.2036			
2,920 % fällig am 08.05.2026	\$ 7.000	7.286	0,05	0,254 % fällig am 01.12.2050	€ 477	624	0,00	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust	5	3	0,00
3,373 % fällig am 05.01.2024	4.405	4.476	0,03	0,280 % fällig am 01.12.2050	€ 2.632	3.088	0,02	0,212 % fällig am 25.10.2036	7.153	4.684	0,03
3,571 % fällig am 10.01.2023	600	674	0,00	0,702 % fällig am 15.12.2050	€ 4.594	5.324	0,04	0,222 % fällig am 25.12.2036	2.294	1.098	0,01
4,750 % fällig am 15.09.2025	20.100	21.987	0,15	0,081 % fällig am 15.12.2050	€ 3.303	4.516	0,03	0,242 % fällig am 25.07.2036	825	812	0,01
4,796 % fällig am 15.11.2024	€ 3.900	5.697	0,04	1,331 % fällig am 15.12.2050	2.942	4.022	0,03	0,887 % fällig am 25.01.2035	1.141	1.116	0,01
7,375 % fällig am 24.06.2022 (g)(i)				Paragon Mortgages PLC	\$ 32	31	0,00	0,992 % fällig am 25.12.2034	5.600	5.625	0,04
Santander UK PLC	€ 16.900	23.700	0,16	0,376 % fällig am 15.11.2038	€ 16.699	23.265	0,16	0,992 % fällig am 25.08.2035			
0,600 % fällig am 12.02.2027	\$ 10.700	10.727	0,07	Resloc UK PLC				Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates	555	555	0,00
0,816 % fällig am 15.11.2021	11.200	11.348	0,08	0,241 % fällig am 15.12.2043	€ 71	95	0,00	0,842 % fällig am 25.09.2035	771	771	0,01
3,750 % fällig am 15.11.2021	1.338	1.460	0,01	0,279 % fällig am 15.12.2043	\$ 177	172	0,00	1,142 % fällig am 25.11.2034			
5,000 % fällig am 07.11.2023	€ 300	512	0,00	0,301 % fällig am 15.12.2043	€ 3.368	4.446	0,03	Amortizing Residential Collateral Trust	36	36	0,00
5,750 % fällig am 02.03.2026				Ripon Mortgages PLC	34.279	47.462	0,32	0,792 % fällig am 25.10.2031			
Society of Lloyd's	750	1.149	0,01	0,881 % fällig am 20.08.2056				AMRESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust	47	46	0,00
4,750 % fällig am 30.10.2024				RMAC PLC	26.514	36.673	0,25	1,032 % fällig am 25.06.2029			
Standard Chartered PLC	\$ 13.400	13.372	0,09	0,784 % fällig am 12.06.2046	14.115	19.605	0,13	Argent Securities Trust	3.997	3.634	0,03
0,991 % fällig am 12.01.2025	500	501	0,00	1,054 % fällig am 12.06.2046				Asset-Backed Funding Certificates Trust	287	283	0,00
1,328 % fällig am 10.09.2022	300	302	0,00	RMAC Securities PLC	€ 1.097	1.275	0,01	0,792 % fällig am 25.06.2034			
1,338 % fällig am 20.01.2023	13.700	13.591	0,09	0,000 % fällig am 12.06.2044	€ 461	616	0,00	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust	4.350	4.820	0,03
1,456 % fällig am 14.01.2027				0,234 % fällig am 12.06.2044	€ 127	127	0,00	0,707 % fällig am 25.02.2036	19	19	0,00
Tesco Corporate Treasury Services PLC	€ 8.900	10.886	0,07	Silverstone Master Issuer PLC				0,732 % fällig am 25.12.2034	11	10	0,00
1,375 % fällig am 24.10.2023				0,756 % fällig am 21.01.2070	\$ 127	127	0,00	0,752 % fällig am 25.10.2032	962	963	0,01
Tesco Property Finance PLC	€ 1.122	2.034	0,01	Southern Pacific Financing PLC	€ 587	779	0,01	1,092 % fällig am 25.10.2037	22	21	0,00
5,411 % fällig am 13.07.2044	684	1.269	0,01	0,344 % fällig am 10.03.2044				1,097 % fällig am 25.06.2035	1.972	1.960	0,01
5,661 % fällig am 13.10.2041	5.900	8.484	0,06	Stratton Mortgage Funding PLC	61.507	85.307	0,58	1,142 % fällig am 25.08.2037	2.754	2.620	0,02
5,744 % fällig am 13.04.2040	7.650	14.204	0,10	0,948 % fällig am 20.07.2060	22.515	31.243	0,21	CIT Mortgage Loan Trust	9.249	9.348	0,06
5,801 % fällig am 13.10.2040				0,949 % fällig am 12.03.2052				1,442 % fällig am 25.10.2037	4.404	4.439	0,03
Virgin Media Secured Finance PLC	5.900	7.643	0,05					1,542 % fällig am 25.10.2037 ^			
5,000 % fällig am 15.04.2027								Citigroup Mortgage Loan Trust	76	66	0,00
Virgin Money UK PLC	€ 6.400	7.643	0,05								
0,375 % fällig am 27.05.2024											
		848.540	5,77								
NON-AGENCY-MBS											
Alba PLC											
0,000 % fällig am 15.12.2038	128	148	0,00								

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
2,707 % fällig am 20.02.2036	\$ 532	\$ 534	0,00	0,553 % fällig am 20.05.2046 ^	\$ 3.244	\$ 2.815	0,02	0,512 % fällig am 25.04.2036	\$ 523	\$ 513	0,00
3,173 % fällig am 20.10.2046 ^	153	131	0,00	0,652 % fällig am 25.02.2037	1.145	1.010	0,01	0,532 % fällig am 25.06.2045	72	68	0,00
3,348 % fällig am 20.01.2047 ^	169	162	0,00	0,731 % fällig am 20.11.2035	673	647	0,01	0,632 % fällig am 25.04.2036 ^	54	102	0,00
5,750 % fällig am 25.11.2035	16	16	0,00	0,732 % fällig am 25.11.2035	13	12	0,00	0,632 % fällig am 25.11.2045	123	112	0,00
Banc of America Mortgage Trust				0,733 % fällig am 20.12.2035	2.173	2.077	0,02	GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates			
2,684 % fällig am 25.09.2033	9	9	0,00	0,751 % fällig am 20.11.2035	41	39	0,00	2,549 % fällig am 25.10.2033	12	12	0,00
2,769 % fällig am 25.09.2035	33	32	0,00	0,772 % fällig am 25.10.2046 ^	822	611	0,01	GS Mortgage Securities Corp.			
BCAP LLC Trust				0,842 % fällig am 25.07.2036	328	171	0,00	1,629 % fällig am 10.02.2046 (a)	12.136	231	0,00
0,262 % fällig am 25.01.2037 ^	32	32	0,00	1,616 % fällig am 25.11.2035	411	383	0,00	GS Mortgage Securities Corp. Trust			
0,532 % fällig am 25.05.2047 ^	258	269	0,00	1,632 % fällig am 25.11.2035	332	307	0,00	0,973 % fällig am 15.07.2031	5.000	4.991	0,04
0,868 % fällig am 26.01.2047	516	488	0,00	2,156 % fällig am 25.11.2035	318	303	0,00	2,081 % fällig am 10.11.2045 (a)	58.323	1.019	0,01
5,250 % fällig am 26.04.2037	748	560	0,00	2,678 % fällig am 25.10.2035 ^	21	19	0,00	GSMSC Pass-Through Trust			
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				5,250 % fällig am 25.06.2035 ^	236	225	0,00	7,500 % fällig am 25.10.2036	56	23	0,00
2,370 % fällig am 25.02.2036	87	88	0,00	5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	1.076	1.011	0,01	GSR Mortgage Loan Trust			
2,427 % fällig am 25.02.2036 ^	75	64	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035	1.983	1.760	0,01	0,322 % fällig am 25.05.2037	12.056	8.271	0,06
2,485 % fällig am 25.08.2033	7	7	0,00	5,750 % fällig am 25.03.2037 ^	229	180	0,00	1,790 % fällig am 25.04.2032	97	87	0,00
2,500 % fällig am 25.08.2033	78	80	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2036	2.216	1.523	0,01	1,840 % fällig am 25.03.2033	87	89	0,00
2,518 % fällig am 25.10.2033	45	46	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	210	137	0,00	2,118 % fällig am 25.06.2034	28	29	0,00
2,665 % fällig am 25.05.2034	135	126	0,00	6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	161	145	0,00	2,825 % fällig am 25.11.2035	33	33	0,00
2,721 % fällig am 25.05.2034	75	75	0,00	6,250 % fällig am 25.08.2037 ^	566	434	0,00	2,924 % fällig am 25.09.2035	60	61	0,00
2,893 % fällig am 25.02.2034	11	11	0,00	6,500 % fällig am 25.08.2032	12	12	0,00	2,927 % fällig am 25.01.2036 ^	56	58	0,00
3,156 % fällig am 25.05.2047 ^	149	148	0,00	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				5,500 % fällig am 25.01.2037	285	333	0,00
3,257 % fällig am 25.08.2035 ^	112	110	0,00	0,552 % fällig am 25.05.2035	528	468	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2032	0	0	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				0,672 % fällig am 25.04.2035	59	56	0,00	HarborView Mortgage Loan Trust			
0,412 % fällig am 25.02.2034	79	77	0,00	0,732 % fällig am 25.03.2035	1.505	1.395	0,01	0,283 % fällig am 19.09.2037	702	686	0,01
0,812 % fällig am 25.08.2035	12.100	11.692	0,08	0,752 % fällig am 25.02.2035	311	313	0,00	0,298 % fällig am 19.12.2036	10.339	9.722	0,07
2,624 % fällig am 25.05.2035	58	60	0,00	0,772 % fällig am 25.02.2035	119	111	0,00	0,493 % fällig am 19.09.2046 ^	857	789	0,01
2,715 % fällig am 25.08.2036 ^	14	10	0,00	0,792 % fällig am 25.02.2036 ^	42	23	0,00	0,573 % fällig am 19.03.2036 ^	155	154	0,00
2,725 % fällig am 25.01.2036	2.136	2.114	0,02	0,852 % fällig am 25.09.2034	39	40	0,00	0,593 % fällig am 19.01.2036	403	296	0,00
3,008 % fällig am 25.09.2035 ^	1.997	1.564	0,01	2,195 % fällig am 20.02.2036 ^	67	60	0,00	0,793 % fällig am 19.01.2035	140	129	0,00
3,018 % fällig am 25.03.2036	312	213	0,00	2,575 % fällig am 25.04.2035	176	157	0,00	0,966 % fällig am 19.12.2036 ^	389	377	0,00
3,089 % fällig am 25.11.2036 ^	3.191	2.145	0,02	2,800 % fällig am 25.11.2034	187	189	0,00	1,593 % fällig am 19.10.2035	264	207	0,00
3,133 % fällig am 25.11.2035 ^	760	664	0,01	2,880 % fällig am 20.04.2036	1.439	1.375	0,01	2,116 % fällig am 19.10.2035	469	333	0,00
3,344 % fällig am 25.11.2036 ^	551	385	0,00	2,929 % fällig am 20.02.2036 ^	48	39	0,00	2,562 % fällig am 19.08.2036 ^	76	76	0,00
3,389 % fällig am 25.08.2036 ^	1.394	921	0,01	2,958 % fällig am 25.08.2034 ^	26	26	0,00	2,659 % fällig am 19.07.2035 ^	66	56	0,00
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				2,992 % fällig am 25.08.2034 ^	19	19	0,00	HomeBanc Mortgage Trust			
0,252 % fällig am 25.12.2046	483	473	0,00	3,991 % fällig am 25.09.2033 ^	12	12	0,00	0,452 % fällig am 25.12.2036	11	11	0,00
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				4,366 % fällig am 19.01.2034	36	38	0,00	0,632 % fällig am 25.10.2035	470	471	0,00
2,986 % fällig am 26.12.2046 ^	2.062	1.812	0,01	5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	87	67	0,00	0,752 % fällig am 25.10.2035	133	134	0,00
Chase Mortgage Finance Trust				5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	409	308	0,00	HSI Asset Loan Obligation Trust			
2,485 % fällig am 25.02.2037	212	216	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2036	373	283	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	59	54	0,00
3,032 % fällig am 25.03.2037 ^	66	66	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2037	1.256	863	0,01	Impac CMB Trust			
3,059 % fällig am 25.07.2037	53	50	0,00	6,500 % fällig am 25.12.2037	690	436	0,00	1,092 % fällig am 25.07.2033	14	13	0,00
3,067 % fällig am 25.03.2037 ^	749	755	0,01	6,500 % fällig am 25.11.2047	521	369	0,00	Impac Secured Assets Trust			
Citicorp Mortgage Securities Trust				Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				0,352 % fällig am 25.01.2037	5.934	5.641	0,04
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	104	104	0,00	0,452 % fällig am 25.03.2035 ^	1.047	995	0,01	IndyMac Mortgage Loan Trust			
Citigroup Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 25.03.2035 ^	63	64	0,00	0,272 % fällig am 25.02.2037 ^	2.018	2.001	0,01
1,613 % fällig am 25.08.2036	9.871	4.484	0,03	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				0,332 % fällig am 25.08.2037	157	157	0,00
2,470 % fällig am 25.05.2035	10	10	0,00	0,714 % fällig am 25.03.2032	62	60	0,00	0,492 % fällig am 25.06.2046	1.281	1.173	0,01
2,530 % fällig am 25.10.2035	12	12	0,00	6,500 % fällig am 25.04.2033	10	10	0,00	2,485 % fällig am 25.01.2036 ^	64	63	0,00
2,996 % fällig am 25.08.2035	106	110	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				2,789 % fällig am 25.10.2035	124	107	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				2,148 % fällig am 25.07.2033	8	9	0,00	2,868 % fällig am 25.03.2036	688	654	0,01
2,210 % fällig am 25.09.2035	238	249	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				2,880 % fällig am 25.12.2034	74	77	0,00
2,220 % fällig am 25.09.2035	19	20	0,00	5,579 % fällig am 25.04.2037 ^	73	31	0,00	2,931 % fällig am 25.03.2036 ^	2.597	2.329	0,02
3,343 % fällig am 25.08.2035 ^	521	530	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Trust				2,969 % fällig am 25.06.2036	185	185	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates				3,310 % fällig am 25.06.2050	4.975	4.473	0,03	2,986 % fällig am 25.08.2035 ^	121	112	0,00
2,351 % fällig am 25.09.2035 ^	680	653	0,01	3,850 % fällig am 25.09.2057	14.090	14.762	0,10	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust			
CitiMortgage Alternative Loan Trust				Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				0,834 % fällig am 15.04.2047 (a)	30.376	492	0,00
0,692 % fällig am 25.02.2037	2.262	1.931	0,01	0,242 % fällig am 25.03.2037 ^	2.350	2.353	0,02	JPMorgan Alternative Loan Trust			
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	406	411	0,00	0,282 % fällig am 25.08.2047	4.469	4.241	0,03	0,572 % fällig am 25.10.2036	4.062	4.036	0,03
Commercial Mortgage Trust				0,332 % fällig am 25.08.2036 ^	2.252	2.188	0,02	2,849 % fällig am 25.12.2035 ^	821	699	0,01
0,702 % fällig am 10.03.2046 (a)	21.812	209	0,00	0,392 % fällig am 25.09.2047 ^	3.456	3.155	0,02	5,500 % fällig am 25.11.2036 ^	13	8	0,00
1,455 % fällig am 10.01.2046 (a)	11.134	155	0,00	0,422 % fällig am 25.08.2037 ^	3.862	3.306	0,02	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			
3,545 % fällig am 10.02.2036	28.500	30.907	0,21	2,620 % fällig am 25.10.2035	80	79	0,00	1,083 % fällig am 15.12.2047 (a)	47.273	553	0,00
3,590 % fällig am 10.11.2047	15.500	16.701	0,11	Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				4,070 % fällig am 15.11.2043	22	22	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				0,192 % fällig am 25.10.2036 ^	9	7	0,00	JPMorgan Mortgage Trust			
0,252 % fällig am 25.02.2047	183	171	0,00	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				1,923 % fällig am 25.11.2033	65	68	0,00
0,262 % fällig am 25.05.2047	4.537	4.316	0,03	0,283 % fällig am 19.10.2036	1.581	1.412	0,01	2,282 % fällig am 25.06.2036 ^	275	230	0,00
0,273 % fällig am 20.02.2047 ^	6.634	5.203	0,04	0,933 % fällig am 19.09.2044	43	42	0,00	2,456 % fällig am 25.12.2034	244	243	0,00
0,288 % fällig am 20.12.2046 ^	3.294	2.883	0,02	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				2,577 % fällig am 25.07.2035	154	158	0,00
0,302 % fällig am 25.07.2046 ^	71	67	0,00	2,591 % fällig am 25.04.2035	119	126	0,00	2,662 % fällig am 25.02.2036 ^	170	141	0,00
0,332 % fällig am 25.06.2036	1.313	1.275	0,01	6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	191	108	0,00	2,663 % fällig am 25.07.2035	61	62	0,00
0,373 % fällig am 20.09.2046	1.285	870	0,01	6,250 % fällig am 25.08.2037 ^	205	139	0,00	2,801 % fällig am 25.08.2034	180	182	0,00
0,442 % fällig am 25.05.2037 ^	623	211	0,00	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				2,889 % fällig am 25.02.2036	515	454	0,00
0,492 % fällig am 25.05.2036	83	74	0,00	2,861 % fällig am 25.08.2035	67	53	0,00	Lehman XS Trust			
0,512 % fällig am 25.05.2035	44	43	0,00	GreenPoint Mortgage Funding Trust				0,272 % fällig am 25.12.2036	4.002	4.123	0,03
0,513 % fällig am 20.03.2046	2.171	1.849	0,01	0,272 % fällig am 25.01.2037	817	790	0,01	0,552 % fällig am 25.05.2046	3.778	4.192	0,03
0,513 % fällig am 20.07.2046 ^	340	270	0,00	0,412 %							

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- WER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- WER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- WER- MÖGENS
0,492 % fällig am 25.10.2046	\$ 492	\$ 476	0,00	2,848 % fällig am 25.11.2035 ^	\$ 76	\$ 72	0,00	3,186 % fällig am 25.06.2033	\$ 6	\$ 6	0,00
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				2,925 % fällig am 25.08.2035	151	146	0,00	Wells Fargo Alternative Loan Trust			
2,876 % fällig am 21.11.2034	131	133	0,00	2,978 % fällig am 25.07.2035 ^	1.055	987	0,01	3,022 % fällig am 28.12.2037 ^	432	427	0,00
MASTR Alternative Loan Trust				3,123 % fällig am 25.09.2034	29	29	0,00	6,250 % fällig am 25.07.2037 ^	757	759	0,01
0,492 % fällig am 25.03.2036 ^	681	38	0,00	Structured Asset Mortgage Investments Trust				Wells Fargo Commercial Mortgage Trust			
MASTR Asset Securitization Trust				0,212 % fällig am 25.08.2036	2.818	2.646	0,02	1,890 % fällig am 15.10.2045 (a)	15.590	240	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	200	172	0,00	0,252 % fällig am 25.01.2037	1.651	1.598	0,01				
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				0,272 % fällig am 25.09.2047	2.527	2.425	0,02				
0,773 % fällig am 15.11.2031	79	81	0,00	0,272 % fällig am 25.09.2047	2.128	2.170	0,02				
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				0,292 % fällig am 25.10.2036	4.875	4.724	0,03	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
0,513 % fällig am 15.12.2030	84	82	0,00	0,302 % fällig am 25.09.2047 ^	2.808	3.075	0,02	Fannie Mae			
2,610 % fällig am 20.10.2029	29	30	0,00	0,312 % fällig am 25.09.2047	31	29	0,00	0,152 % fällig am 25.12.2036	267	265	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				0,472 % fällig am 25.06.2036	84	85	0,00	0,212 % fällig am 25.03.2034	71	71	0,00
0,252 % fällig am 25.01.2037	9.885	4.199	0,03	0,512 % fällig am 25.05.2036	767	672	0,01	0,242 % fällig am 25.08.2034	30	30	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0,532 % fällig am 25.05.2046	2.842	2.782	0,02	0,442 % fällig am 25.09.2042 - 25.03.2044	57	57	0,00
0,752 % fällig am 25.06.2028	29	29	0,00	0,593 % fällig am 19.07.2035	3.140	1.648	0,01	0,492 % fällig am 25.06.2029 - 25.06.2036	366	369	0,00
1,882 % fällig am 25.02.2033	105	103	0,00	0,612 % fällig am 25.05.2046 ^	53	52	0,00	0,560 % fällig am 25.08.2050	17.821	17.901	0,12
1,974 % fällig am 25.06.2037	97	93	0,00	0,652 % fällig am 25.02.2036 ^	581	559	0,00	0,645 % fällig am 25.08.2022 (a)	29.883	80	0,00
2,116 % fällig am 25.12.2034	225	230	0,00	0,673 % fällig am 19.07.2034	34	35	0,00	0,742 % fällig am 25.09.2023	2	2	0,00
Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust				0,753 % fällig am 19.09.2032	35	35	0,00	0,781 % fällig am 25.05.2022 (a)	49.586	100	0,00
2,798 % fällig am 25.04.2037 ^	929	950	0,01	0,793 % fällig am 19.03.2034	7	7	0,00	2,096 % fällig am 25.05.2035	1	1	0,00
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust				1,516 % fällig am 25.12.2035 ^	94	93	0,00	2,576 % fällig am 25.01.2022 (a)	2.283	200	0,00
1,098 % fällig am 15.12.2048 (a)	48.919	512	0,00	1,616 % fällig am 25.08.2047 ^	1.550	1.519	0,01	6,000 % fällig am 25.04.2023 - 25.07.2044	863	997	0,01
1,459 % fällig am 15.02.2046 (a)	51.584	816	0,01	2,927 % fällig am 25.05.2047 ^	2.903	2.609	0,02	Freddie Mac			
1,539 % fällig am 15.08.2045 (a)	6.169	55	0,00	Structured Asset Securities Corp.				0,352 % fällig am 25.08.2031	1	1	0,00
3,732 % fällig am 15.05.2048	8.100	8.871	0,06	0,372 % fällig am 25.01.2036	13	13	0,00	0,372 % fällig am 25.09.2031	69	68	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				0,523 % fällig am 15.12.2031	1	1	0,00
0,352 % fällig am 25.04.2035	335	333	0,00	0,382 % fällig am 25.10.2036	642	578	0,00	0,553 % fällig am 15.10.2040	2.432	2.461	0,02
2,888 % fällig am 25.11.2037	628	543	0,00	0,442 % fällig am 25.09.2037	13	13	0,00	0,573 % fällig am 15.06.2041	3.759	3.817	0,03
3,056 % fällig am 25.11.2035 ^	35	29	0,00	0,494 % fällig am 25.06.2047 ^	1.437	1.293	0,01	0,673 % fällig am 15.12.2037	93	95	0,00
MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust				0,494 % fällig am 25.06.2047 ^	12	12	0,00	0,904 % fällig am 25.09.2022 (a)	34.248	277	0,00
0,322 % fällig am 25.06.2047	5.736	5.674	0,04	1,544 % fällig am 25.03.2037 ^	914	859	0,01	1,069 % fällig am 25.11.2022 (a)	33.511	374	0,00
New Century Alternative Mortgage Loan Trust				2,224 % fällig am 25.09.2037	41	41	0,00	1,316 % fällig am 25.10.2044	1.260	1.295	0,01
6,173 % fällig am 25.07.2036	5.578	2.140	0,02	UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust				1,328 % fällig am 25.02.2045	89	90	0,00
New Residential Mortgage Loan Trust				1,045 % fällig am 10.03.2046 (a)	75.092	760	0,01	1,516 % fällig am 25.07.2044	31	32	0,00
3,500 % fällig am 25.12.2057	4.092	4.255	0,03	1,742 % fällig am 10.12.2045 (a)	77.355	1.070	0,01	2,204 % fällig am 01.10.2034	24	24	0,00
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				2,344 % fällig am 01.10.2033	27	28	0,00
2,327 % fällig am 25.10.2035	37	35	0,00	0,552 % fällig am 25.04.2045	25	25	0,00	2,364 % fällig am 01.09.2035	25	27	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust				0,632 % fällig am 25.12.2045	22	23	0,00	2,429 % fällig am 01.08.2035	30	31	0,00
0,476 % fällig am 25.09.2046	1.487	637	0,01	0,672 % fällig am 25.10.2045	111	111	0,00	3,000 % fällig am 01.11.2026 - 01.04.2045	550	581	0,00
Residential Accredited Loans, Inc. Trust				0,712 % fällig am 25.01.2045	266	266	0,00	3,500 % fällig am 01.08.2026 - 01.04.2049	9.159	9.689	0,07
0,242 % fällig am 25.02.2047	470	241	0,00	0,732 % fällig am 25.01.2045	62	62	0,00	4,000 % fällig am 01.09.2024 - 01.09.2041	11	11	0,00
0,342 % fällig am 25.08.2037	724	687	0,01	0,832 % fällig am 25.11.2034	239	231	0,00	5,000 % fällig am 15.08.2035 - 01.12.2039	719	813	0,01
0,392 % fällig am 25.06.2037 ^	1.490	1.365	0,01	0,912 % fällig am 25.12.2045	361	355	0,00	5,500 % fällig am 01.06.2037 - 01.10.2039	54	62	0,00
0,412 % fällig am 25.03.2047	2.141	2.057	0,01	0,938 % fällig am 25.12.2046	28	28	0,00	6,000 % fällig am 15.04.2036	1.913	2.265	0,02
0,452 % fällig am 25.06.2046	4.877	1.584	0,01	0,996 % fällig am 25.10.2046 ^	2.804	2.648	0,02	7,000 % fällig am 01.10.2037	8	9	0,00
0,512 % fällig am 25.04.2046	3.792	1.496	0,01	1,096 % fällig am 25.06.2046	857	865	0,01	Ginnie Mae			
1,402 % fällig am 25.11.2037	2.189	2.094	0,02	1,116 % fällig am 25.02.2046	2.064	2.080	0,02	0,857 % fällig am 20.01.2066	2.358	2.396	0,02
3,188 % fällig am 25.08.2035 ^	46	25	0,00	1,116 % fällig am 25.08.2046	104	104	0,00	0,937 % fällig am 20.08.2066	5.616	5.727	0,04
6,000 % fällig am 25.06.2036	501	481	0,00	1,161 % fällig am 25.08.2046	104	104	0,00	2,000 % fällig am 20.01.2025 - 20.01.2030	4	4	0,00
Residential Asset Securitization Trust				0,912 % fällig am 25.11.2045	361	355	0,00	2,125 % fällig am 20.11.2026	1	1	0,00
0,492 % fällig am 25.01.2046 ^	12	4	0,00	0,912 % fällig am 25.12.2045	4.636	4.522	0,03	2,250 % fällig am 20.09.2023 - 20.09.2026	8	8	0,00
0,592 % fällig am 25.03.2035	694	525	0,00	0,938 % fällig am 25.12.2046	28	28	0,00	2,875 % fällig am 20.04.2027 - 20.05.2030	20	21	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036	2.193	2.080	0,02	0,996 % fällig am 25.10.2046 ^	2.804	2.648	0,02	3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047	1.367	1.398	0,01
5,750 % fällig am 25.04.2037 ^	1.297	931	0,01	1,096 % fällig am 25.06.2046	857	865	0,01	4,500 % fällig am 15.04.2039	44	49	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	797	459	0,00	1,116 % fällig am 25.02.2046	2.064	2.080	0,02	5,000 % fällig am 20.04.2038	18	21	0,00
6,250 % fällig am 25.10.2036 ^	644	629	0,01	1,161 % fällig am 25.08.2046	104	104	0,00	5,500 % fällig am 20.08.2035 - 15.02.2039	246	280	0,00
6,500 % fällig am 25.08.2036 ^	1.113	552	0,00	1,516 % fällig am 25.08.2042	0	0	0,00	Ginnie Mae, TBA			
6,600 % fällig am 25.05.2036	1.209	727	0,01	1,593 % fällig am 27.02.2034	111	114	0,00	4,000 % fällig am 01.08.2051	1.800	1.903	0,01
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				1,593 % fällig am 25.01.2047	490	487	0,00	Small Business Administration			
3,148 % fällig am 25.09.2035 ^	271	205	0,00	1,843 % fällig am 25.10.2046	12	12	0,00	4,760 % fällig am 01.09.2025	21	22	0,00
6,500 % fällig am 25.03.2032	9	9	0,00	2,022 % fällig am 25.08.2035	28	28	0,00	4,840 % fällig am 01.05.2025	12	13	0,00
Sequoia Mortgage Trust				2,344 % fällig am 25.03.2033	11	11	0,00	5,090 % fällig am 01.10.2025	13	14	0,00
0,793 % fällig am 19.10.2026	50	50	0,00	2,409 % fällig am 25.03.2034	7	7	0,00	5,110 % fällig am 01.04.2025	2	3	0,00
0,793 % fällig am 20.07.2033	262	262	0,00	2,571 % fällig am 25.06.2033	48	49	0,00	5,490 % fällig am 01.05.2028	21	23	0,00
0,853 % fällig am 20.10.2027	3	3	0,00	2,724 % fällig am 25.12.2035	324	330	0,00	5,600 % fällig am 01.09.2028	10	11	0,00
1,984 % fällig am 20.01.2047 ^	364	278	0,00	2,730 % fällig am 25.12.2036 ^	548	541	0,00	5,680 % fällig am 01.06.2028	5	6	0,00
2,647 % fällig am 20.04.2035	59	62	0,00	2,786 % fällig am 25.09.2033	21	21	0,00	5,980 % fällig am 01.05.2022	0	0	0,00
2,947 % fällig am 20.07.2037	1.013	931	0,01	2,924 % fällig am 25.05.2037 ^	1.869	1.861	0,01	6,220 % fällig am 01.12.2028	74	83	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				2,927 % fällig am 25.08.2034	91	94	0,00				
0,412 % fällig am 25.10.2035	517	513	0,00	2,931 % fällig am 25.03.2036	79	79	0,00				
0,532 % fällig am 25.05.2037	12	12	0,00	3,029 % fällig am 25.09.2036 ^	3.870	3.826	0,03				
2,386 % fällig am 25.04.2034	162	164	0,00	3,082 % fällig am 25.09.2036	331	319	0,00				
2,485 % fällig am 25.09.2034	8	8	0,00	3,183 % fällig am 25.03.2036 ^	1.262	1.268	0,01				
2,537 % fällig am 25.02.2034	84	85	0,00	3,259 % fällig am 25.05.2037 ^	1.228	1.098	0,01				
2,724 % fällig am 25.09.2034	316	330	0,00	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
2,768 % fällig am 25.12.2035	539	495	0,00	0,542 % fällig am 25.04.2035	169	136	0,00				
				0,592 % fällig am 25.07.2046 ^	3	9	0,00				

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Tennessee Valley Authority 5,880 % fällig am 01.04.2036	\$ 500	\$ 744	0,01	1,750 % fällig am 15.01.2028 (l)(m)	\$ 26.762	\$ 32.362	0,22	INVESTMENTFONDS			
Uniform Mortgage-Backed Security 1,328 % fällig am 01.11.2042				2,375 % fällig am 15.01.2027	1.324	1.622	0,01	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
- 01.10.2044	69	72	0,00	2,500 % fällig am 15.01.2029 (l)	50.113	64.590	0,44	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – Global Bond Ex-US Fund (h)	13.048.894	\$ 137.927	0,94
1,527 % fällig am 01.09.2040	19	19	0,00	3,875 % fällig am 15.04.2029 (l)	32.156	45.247	0,31				
1,664 % fällig am 01.01.2033	30	30	0,00	U.S. Treasury Notes				PIMCO Funds: Global Investors Series plc – PIMCO European High Yield Bond Fund (h)	1.355.380	17.376	0,12
1,766 % fällig am 01.10.2034	9	9	0,00	2,000 % fällig am 30.11.2022 (l)	5.228	5.364	0,04				
1,795 % fällig am 01.04.2033	60	60	0,00	2,000 % fällig am 30.04.2024 (l)	2.650	2.768	0,02				
1,800 % fällig am 01.12.2034	55	58	0,00	2,000 % fällig am 15.08.2025 (l)	1.100	1.158	0,01	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – UK Corporate Bond Fund (h)	7.715.431	111.914	0,76
1,818 % fällig am 01.04.2033	57	59	0,00	2,250 % fällig am 15.11.2027 (l)	1.165	1.247	0,01				
1,895 % fällig am 01.09.2037	10	10	0,00	2,375 % fällig am 15.05.2029 (l)	350	378	0,00	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (h)	322.146	3.286	0,02
1,905 % fällig am 01.10.2034	23	24	0,00	2,625 % fällig am 31.12.2025 (l)	150	162	0,00				
2,109 % fällig am 01.08.2033	25	25	0,00	2,625 % fällig am 15.02.2029 (l)	1.055	1.157	0,01	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (h)	55.446	552	0,00
2,185 % fällig am 01.08.2036	1	1	0,00	2,875 % fällig am 31.10.2023 (l)	990	1.049	0,01				
2,454 % fällig am 01.06.2035	10	11	0,00	2,875 % fällig am 30.04.2025 (l)	209.500	227.267	1,54				
2,500 % fällig am 01.05.2030				3,125 % fällig am 15.11.2028 (l)	1.340	1.516	0,01	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h)	345.274	4.637	0,03
- 01.02.2051	226.724	235.353	1,60	Summe USA		5.179.204	35,24			275.692	1,87
2,545 % fällig am 01.08.2035	80	81	0,00	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
2,581 % fällig am 01.11.2034	410	438	0,00	ARGENTINA TREASURY BILLS				PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (h)	3.455.880	407.907	2,77
2,633 % fällig am 01.12.2030	3	3	0,00	38,001 % fällig am 30.07.2021 (d)(e)	ARS 24.205	139	0,00				
2,640 % fällig am 01.06.2030	7	7	0,00	ISRAEL TREASURY BILLS				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)	5.291.340	537.327	3,66
3,000 % fällig am 01.01.2027				(0,041) % fällig am 02.03.2022 (d)(e)	ILS 135.000	41.426	0,28				
- 01.03.2060	65.385	70.018	0,48	(0,031) % fällig am 02.02.2022 (d)(e)	19.600	6.015	0,04				
3,500 % fällig am 01.11.2034				(0,030) % fällig am 02.03.2022 (d)(e)	53.100	16.294	0,11				
- 01.01.2059	96.441	103.486	0,70	(0,028) % fällig am 30.11.2021 (d)(e)	151.200	46.406	0,32				
4,000 % fällig am 01.01.2026				(0,020) % fällig am 02.02.2022 (d)(e)	92.500	28.386	0,19	Summe Investmentfonds		\$ 1.220.926	8,30
- 01.07.2050	41.449	44.241	0,30	(0,020) % fällig am 02.03.2022 (d)(e)	84.700	25.991	0,18				
4,500 % fällig am 01.08.2023				0,000 % fällig am 06.04.2022 (d)(e)	107.000	32.834	0,22				
- 01.03.2046	2.214	2.419	0,02	0,006 % fällig am 08.06.2022 (d)(e)	113.400	34.799	0,24				
5,000 % fällig am 01.03.2022	0	0	0,00	0,011 % fällig am 06.04.2022 (d)(e)	25.200	7.733	0,05				
5,500 % fällig am 01.06.2023				Summe kurzfristige Instrumente		240.023	1,63				
- 01.11.2039	57	66	0,00	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 16.276.256	110,73				
6,500 % fällig am 01.06.2036											
- 01.06.2037	101	107	0,00								
7,000 % fällig am 01.11.2036	44	44	0,00								
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA											
2,000 % fällig am 01.07.2051	19.550	19.725	0,13								
2,500 % fällig am 01.07.2051	35.078	36.267	0,25								
3,000 % fällig am 01.08.2051	32.100	33.441	0,23								
3,500 % fällig am 01.08.2036											
- 01.08.2051	257.100	270.918	1,84								
4,000 % fällig am 01.07.2051	1.415.758	1.508.817	10,27								
4,500 % fällig am 01.08.2051	5.500	5.923	0,04								
5,500 % fällig am 01.07.2051	3.000	3.343	0,02								
		2.389.746	16,26								
US-SCHATZOBIGLATIONEN											
U.S. Treasury Bonds											
1,375 % fällig am 15.11.2040 (l)	105.850	95.124	0,65								
1,625 % fällig am 15.11.2050 (l)	181.110	162.716	1,10								
1,875 % fällig am 15.02.2041 (l)	316.700	310.119	2,11								
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)											
0,375 % fällig am 15.01.2027 (l)(m)	38.683	42.837	0,29								
0,375 % fällig am 15.07.2027	142	158	0,00								
0,500 % fällig am 15.01.2028 (l)	74.926	84.051	0,57								
0,750 % fällig am 15.07.2028	8.190	9.403	0,07								

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03.2022	293	\$ (13)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2021	1.037	319	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	322	145	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	4.746	7.076	0,05
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	4.506	(4.495)	(0,03)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	38	162	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	2.913	(2.023)	(0,01)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	13.631	209	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	552	1.201	0,01

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2021	1.896	\$ (676)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	6.297	(1.769)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	13.003	17.307	0,12
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	8	(35)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2021	360	3.184	0,02
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	175	(383)	0,00
				\$ 20.209	0,14
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 20.209	0,14

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.12.2027	€ 5.700	\$ 56	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	3.200	(1)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	7.400	(236)	0,00
Ryder System, Inc.	1,000	20.06.2022	\$ 1.800	(29)	0,00
Shell International Finance BV	1,000	20.12.2026	€ 8.900	40	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2022	6.750	70	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2025	2.900	166	0,00
				\$ 66	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.HY-36 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2026	\$ 98.225	\$ (842)	(0,01)
CDX.IG-35 5-Year Index	(1,000)	20.12.2025	20.700	(22)	0,00
CDX.IG-36 10-Year Index	(1,000)	20.06.2031	55.700	(213)	0,00
				\$ (1.077)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettver- mögens
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000 %	20.06.2026	\$ 93.500	\$ 194	0,00

ZINSSWAPS - BASISWAPS

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
3-Month USD-LIBOR ⁽⁴⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	07.03.2024	\$ 110.900	\$ 9	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,071 %	12.06.2022	87.800	(24)	0,00
3-Month USD-LIBOR ⁽⁴⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,073 %	27.04.2023	339.800	(57)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,084 %	26.04.2022	538.800	(78)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,084 %	12.06.2022	80.500	(34)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,085 %	19.06.2022	405.400	(134)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,086 %	12.04.2023	400	0	0,00
3-Month USD-LIBOR ⁽⁴⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,088 %	06.09.2024	611.900	(89)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,091 %	18.03.2022	3.216.900	(1.140)	(0,01)
3-Month USD-LIBOR ⁽⁴⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,102 %	04.10.2024	300.600	(44)	0,00
3-Month USD-LIBOR ⁽⁴⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,105 %	27.09.2024	350.000	(79)	0,00
				\$ (1.670)	(0,01)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,250 %	15.09.2023	£ 70.500	\$ (86)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	81.900	(138)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	48.900	456	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	45.285	(601)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	02.11.2025	¥ 100.000	2	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,840	03.01.2022	BRL 506.700	1.249	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,848	03.01.2022	417.000	1.022	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,850	03.01.2022	382.300	948	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859 %	03.01.2022	BRL	77.300	\$ 188	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,860	03.01.2022		47.400	117	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,865	03.01.2022		90.000	218	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022		381.800	926	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,871	03.01.2022		486.100	1.177	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,880	03.01.2022		728.300	1.769	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,884	03.01.2022		108.200	257	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,300	03.01.2022		6.349.900	(7.692)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,345	03.01.2022		126.500	(216)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,350	03.01.2022		2.753.300	(4.626)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022		995.200	2.367	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,390	03.01.2022		93.500	(162)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,700	03.01.2022		1.791.700	(2.240)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	CAD	57.400	36	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025		84.100	1.252	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030		286.700	(1.816)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	16.06.2051		5.600	76	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029		81.400	95	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029		107.300	(194)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,200	18.12.2049		28.800	(401)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,110	16.12.2023	NZD	600	(7)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024		10.000	(67)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK	260.100	(298)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029		56.700	(13)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,200	15.01.2022	\$	883.400	(834)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,250	30.03.2023		63.900	(38)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,400	30.03.2026		463.285	(5.626)	(0,04)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,400	15.01.2028		582.150	(21.924)	(0,15)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026		32.800	(91)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028		59.180	141	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,550	15.01.2031		839.600	53.618	0,36
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022		385.575	(991)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	30.03.2031		419.420	(5.840)	(0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031		114.250	1.837	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031		353.300	(10.763)	(0,07)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025		169.000	(3.603)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030		494.520	22.349	0,15
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,120	02.02.2031		42.800	1.030	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,160	02.02.2031		51.500	1.042	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,249	31.08.2024		179.400	(3.332)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025		31.330	(800)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	09.06.2041		43.050	2.779	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050		15.600	1.896	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051		97.150	8.330	0,06
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,298	25.08.2024		155.100	(3.120)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,305	21.08.2023		180.550	(4.498)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,306	21.08.2023		3.950	24	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,325	02.12.2050		30.200	4.238	0,03
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,360	17.09.2024		53.950	(1.135)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,460	02.02.2051		42.600	(2.668)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,540	26.02.2022		221.600	(2.664)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,620	27.01.2052		12.500	536	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,635	31.08.2051		21.450	(695)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,665	27.10.2051		4.500	160	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,720	15.10.2031		72.800	(1.446)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,760	25.08.2051		22.600	54	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,935	22.06.2051		22.800	(657)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,940	15.06.2051		21.900	(659)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,950	04.10.2031		16.420	738	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,950	31.08.2051		15.850	(705)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,968	23.06.2051		21.000	(764)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,990	31.08.2051		17.750	(963)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.12.2051		32.600	(315)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	2,010	17.09.2051		15.250	(765)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	2,090	23.12.2051		19.200	(1.393)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	20.06.2023	ZAR	263.900	813	0,01
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD	128.300	4.685	0,03
Zahlung	6-Month CHF-LIBOR	0,500	16.09.2025	CHF	459.450	(2.419)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK	158.300	60	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€	820.500	1.639	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050		7.450	1.175	0,01
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,060	17.11.2032		50.300	(2.008)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052		17.650	2.677	0,02
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	27.01.2032		32.980	(84)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,205	27.01.2032		41.660	(181)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026		575.800	(1.018)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035		8.100	536	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2023		118.500	(51)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051		172.950	687	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,000	17.03.2031	¥	14.710.000	319	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,200	19.06.2029		6.440.000	(391)	0,00

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR		0,400 %	19.06.2039	¥ 13.160.000	\$ (2.342)	(0,02)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR		0,500	19.06.2049	2.790.000	(874)	(0,01)
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR		1,500	10.03.2026	NOK 1.386.800	(904)	(0,01)
Zahlung	6-Month NOK-NIBOR		1,900	10.03.2031	733.300	2.195	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		4,870	07.07.2025	MXN 393.200	(1.170)	(0,01)
Erhalt	UKRPI		3,000	15.11.2050	£ 14.100	4.084	0,03
Erhalt	UKRPI		3,051	15.11.2050	12.900	3.723	0,03
Erhalt	UKRPI		3,143	15.11.2050	6.000	1.294	0,01
Zahlung	UKRPI		3,217	15.11.2040	34.200	(4.910)	(0,03)
Zahlung	UKRPI		3,272	15.11.2040	12.900	(1.775)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		3,273	15.11.2040	18.260	(2.513)	(0,02)
Zahlung	UKRPI		3,340	15.11.2040	14.740	(1.596)	(0,01)
Erhalt	UKRPI		3,397	15.11.2030	20.100	987	0,01
Erhalt	UKRPI		3,445	15.11.2030	18.260	886	0,01
Erhalt	UKRPI		3,510	15.11.2030	8.740	324	0,00
Zahlung	UKRPI		3,700	15.04.2031	49.050	(1.134)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		3,740	15.03.2031	28.100	(11)	0,00
						\$ 18.784	0,13
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 16.297	0,11

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermö- gens
BOA	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,016	15.07.2021	66.000	\$ 990	\$ 95	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,016	06.08.2021	61.900	898	186	0,00
CBK	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,004	25.01.2022	189.200	2.498	1.272	0,01
FAR	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,020	30.09.2021	82.400	1.730	190	0,00
GLM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,004	25.01.2022	207.400	2.624	1.394	0,01
							\$ 8.740	\$ 3.137	0,02

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermö- gens
BPS	Put – OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	26.800	\$ 2.027	\$ 3.993	0,03
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	12.100	68	2	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,641	07.07.2021	14.800	82	2	0,00
					\$ 2.177	\$ 3.997	0,03

VERKAUFSoPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	7.500	\$ (34)	\$ (21)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	20.200	(20)	(4)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	38.400	(40)	(3)	0,00
BPS	Put – OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	4.600	(29)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	33.300	(39)	(6)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	14.750	(20)	(6)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	35.400	(44)	(33)	0,00
BRC	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	23.000	(17)	(17)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	23.000	(28)	(8)	0,00
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	41.600	(23)	(27)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	21.07.2021	41.600	\$ (55)	\$ (2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	32.900	(36)	(3)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	25.400	(27)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	132.150	(185)	(36)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	59.700	(68)	(14)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	26.600	(29)	(5)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	35.600	(39)	(6)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	41.900	(57)	(16)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	43.200	(42)	(29)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	146.000	(156)	(88)	0,00
CBK	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	5.400	(24)	(15)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	32.100	(35)	(5)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	19.800	(19)	(4)	0,00
DUB	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	31.400	(25)	(23)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	31.400	(38)	(11)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	93.900	(96)	(23)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	34.900	(39)	(7)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	41.200	(45)	(7)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	15.500	(20)	(6)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	50.400	(57)	(47)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	15.09.2021	5.200	(30)	(12)	0,00
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	20.10.2021	8.400	(49)	(36)	0,00
	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	16.300	(13)	(11)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	18.800	(19)	(4)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	39.500	(38)	(6)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	21.000	(21)	(6)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	33.500	(35)	(8)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	17.800	(17)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	1.200	(1)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	25.500	(26)	(4)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	21.500	(21)	(3)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	46.500	(49)	(30)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	43.300	(46)	(25)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	22.500	(29)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	25.400	(26)	(2)	0,00
JPM	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	39.300	(51)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	28.600	(35)	(19)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	25.000	(31)	(15)	0,00
MYC	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	5.000	(12)	(1)	0,00
						\$ (1.935)	\$ (661)	0,00

DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Call – OTC USD versus CAD	CAD 1,265	11.02.2022	77.946	\$ (770)	\$ (967)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BOA	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,880 %	15.09.2021	376.100	\$ (1.867)	\$ 0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	15.07.2021	66.000	(442)	(183)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	15.07.2021	66.000	(548)	(14)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	06.08.2021	61.900	(412)	(442)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	06.08.2021	61.900	(473)	(54)	0,00
BPS	Put – OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	26.800	(2.027)	(3.854)	(0,03)
BRC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,000	07.02.2022	185.400	(241)	(29)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	07.02.2022	185.400	(241)	(506)	0,00
DUB	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,020	21.12.2021	181.500	(828)	(19)	0,00
FAR	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,025	30.09.2021	107.700	(774)	(35)	0,00
FBF	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,399	26.08.2021	423.900	(3.765)	(5)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,000	07.02.2022	148.200	(197)	(23)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	07.02.2022	148.200	(197)	(404)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	13.07.2021	19.500	(91)	(145)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	13.07.2021	19.500	(91)	(1)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	25.01.2022	78.550	(2.089)	(1.005)	(0,01)
MYC	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,448	23.08.2021	370.100	(3.296)	(2)	0,00
	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,020	21.12.2021	284.100	(1.306)	(29)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	20.200	(152)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	15.07.2021	16.600	(38)	(32)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	15.07.2021	16.600	(38)	(12)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	25.01.2022	86.800	(1.293)	(1.111)	(0,01)
RYL	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,000	07.02.2022	826.000	(1.066)	(130)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	07.02.2022	826.000	(1.066)	(2.252)	(0,02)
						\$ (22.538)	\$ (10.287)	(0,07)	

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettover-mögens
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽¹⁾	1-Year USD-LIBOR	0,000 %	07.10.2022	256.250	\$ (264)	\$ (33)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽¹⁾	1-Year USD-LIBOR	0,000	08.10.2022	117.500	(116)	(15)	0,00
						\$ (380)	\$ (48)	0,00

⁽¹⁾ Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

⁽²⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettover-mögens
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	12.300	\$ (53)	\$ (11)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,547	07.07.2021	5.000	(12)	(3)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,641	07.07.2021	30.400	(99)	(13)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,766	07.07.2021	12.000	(37)	(3)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,609	05.08.2021	30.000	(94)	(58)	0,00
					\$ (295)	\$ (88)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettover-mögens
BOA	Japan Government International Bond	(1,000) %	20.06.2022	\$ 5.400	\$ (187)	\$ 134	\$ (53)	0,00
BPS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	31.100	(1.113)	808	(305)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	22.300	(544)	132	(412)	0,00
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	37.000	(706)	44	(662)	(0,01)
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	14.100	(487)	348	(139)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	48.550	(1.225)	328	(897)	(0,01)
CBK	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	21.200	(751)	543	(208)	0,00
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	10.700	(207)	15	(192)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	28.800	(1.019)	736	(283)	0,00
HUS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	31.800	(1.077)	765	(312)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	34.100	(851)	221	(630)	(0,01)
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	11.200	(268)	61	(207)	0,00
					\$ (8.435)	\$ 4.135	\$ (4.300)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettover-mögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 11.810	\$ (285)	\$ 474	\$ 189	0,00
BRC	Abu Dhabi Government International Bond	1,000	20.06.2026	8.400	240	15	255	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	17.350	(421)	698	277	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	4.020	(98)	162	64	0,00
FBF	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	8.200	(200)	331	131	0,00
GST	Abu Dhabi Government International Bond	1,000	20.06.2026	5.250	152	8	160	0,00
MYC	Abu Dhabi Government International Bond	1,000	20.06.2026	12.150	338	31	369	0,01
	Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2021	€ 8.500	60	(16)	44	0,00
					\$ (214)	\$ 1.703	\$ 1.489	0,01

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettover-mögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUS 106.300	\$ 80.086	\$ 526	\$ (1.102)	\$ (576)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD- LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD- LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	AUS 105.500	\$ 72.795	\$ (26)	\$ 6.748	\$ 6.722	0,04
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD- LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD- LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	101.200	69.828	(205)	6.663	6.458	0,04
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD- LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD- LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	65.900	47.343	287	1.690	1.977	0,02
						\$ 582	\$ 13.999	\$ 14.581	0,10

TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
CIB	Zahlung	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	k. A.	0,050 %	CAD 125.200	05.08.2021	\$ 0	\$ 7.279	\$ 7.279	0,05

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnung s-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowert zunahme/ (-abnahme)	% des Nettöver- mögens	
BOA	07.2021	CHF	2.960	\$ 3.294	\$ 92	\$ 0	0,00	
	07.2021	DKK	1.318.702	209.850	0	(450)	0,00	
	07.2021	NOK	505.917	59.010	218	0	218	0,00
	07.2021	\$	43.222	AUD 57.395	0	(133)	(133)	0,00
	07.2021		9.841	CAD 12.120	0	(53)	(53)	0,00
	07.2021		1.163	€ 974	0	(8)	(8)	0,00
	07.2021		2.413	£ 1.736	0	(15)	(15)	0,00
	07.2021		1.325	¥ 146.300	0	(7)	(7)	0,00
	08.2021	AUD	53.323	\$ 40.158	119	0	119	0,00
	08.2021	CZK	3.143	151	5	0	5	0,00
	08.2021	\$	59.019	NOK 505.917	0	(217)	(217)	0,00
	08.2021		3.728	RUB 280.351	83	0	83	0,00
	09.2021	CNH	4.646.115	\$ 722.623	7.079	0	7.079	0,05
	09.2021	CNY	245.260	38.132	368	0	368	0,00
	09.2021	PLN	8.990	2.368	6	0	6	0,00
	09.2021	\$	102	HKD 794	0	0	0	0,00
	09.2021		347	PLN 1.285	0	(9)	(9)	0,00
	09.2021		4.158	RUB 303.337	0	(51)	(51)	0,00
	11.2021	RON	1.269	\$ 311	7	0	7	0,00
	BPS	07.2021	AUD	212.121	164.846	5.597	0	5.597
07.2021		DKK	1.140.657	181.077	0	(830)	(830)	(0,01)
07.2021		€	2.806.647	3.433.520	105.116	0	105.116	0,72
07.2021		\$	2.981	CAD 3.607	0	(68)	(68)	0,00
07.2021			21.072	€ 17.688	0	(96)	(96)	0,00
07.2021			6.318	£ 4.544	0	(41)	(41)	0,00
07.2021			8.640	NZD 12.348	0	(11)	(11)	0,00
07.2021			154	RUB 11.492	3	0	3	0,00
08.2021		NZD	12.348	\$ 8.639	11	0	11	0,00
08.2021		\$	33.927	MXN 723.587	2.266	0	2.266	0,02
09.2021		MYR	162.519	\$ 39.067	59	0	59	0,00
09.2021		\$	403	THB 12.602	0	(10)	(10)	0,00
11.2021		ILS	60.736	\$ 18.588	6	(93)	(87)	0,00
11.2021		MXN	9.758	483	1	0	1	0,00
BRC	07.2021	SEK	6.991	843	26	0	26	0,00
	07.2021	\$	1.340	BRL 7.088	72	0	72	0,00
	07.2021		3.811	€ 3.129	0	(100)	(100)	0,00
	08.2021	¥	674.783	\$ 6.159	77	0	77	0,00
BSS	09.2021	PLN	5.906	1.552	1	0	1	0,00
	08.2021	CLP	4.120.528	6.084	434	0	434	0,00
CBK	07.2021	BRL	14.249	2.901	61	0	61	0,00
	07.2021	DKK	1.023.139	162.260	0	(905)	(905)	(0,01)
	07.2021	MXN	8.308	415	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	PEN	125.814	34.018	1.141	0	1.141	0,01
	07.2021	\$	15.574	DKK 97.955	47	0	47	0,00
	07.2021		332	MXN 6.541	0	(4)	(4)	0,00
	07.2021		60.569	NOK 505.917	0	(1.778)	(1.778)	(0,01)
	07.2021		11.812	PEN 47.019	469	0	469	0,00
	07.2021		2.752	RUB 212.596	150	0	150	0,00
	08.2021	PEN	47.019	\$ 11.824	0	(487)	(487)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2021	\$	2.892	BRL 14.249	\$ 0	\$ (61)	(61) 0,00
	08.2021		3.401	RUB 255.583	74	0	74 0,00
	09.2021	CNH	13.447	\$	2.093	0	22 0,00
	09.2021	PEN	378.767	101.492	2.335	0	2.335 0,02
	09.2021	ZAR	5.068	370	18	0	18 0,00
	10.2021	PEN	5.940	1.636	81	0	81 0,00
	11.2021	ILS	349.489	106.706	13	(791)	(778) (0,01)
	11.2021	PEN	49.688	13.117	115	0	115 0,00
	12.2021		41.264	11.075	285	0	285 0,00
	01.2022	ILS	23.748	7.273	0	(38)	(38) 0,00
	02.2022		112.124	34.243	0	(280)	(280) 0,00
	03.2022		272.856	83.071	0	(986)	(986) (0,01)
	04.2022		132.197	40.432	0	(319)	(319) 0,00
	06.2022		113.436	34.993	5	(21)	(16) 0,00
GLM	07.2021	PEN	52.755	14.444	659	0	659 0,01
	07.2021	\$	1.881	€ 1.552	0	(41)	(41) 0,00
	07.2021		5.522	RUB 426.155	296	0	296 0,00
	08.2021	COP	21.856.782	\$ 5.736	0	(105)	(105) 0,00
	08.2021	\$	4.765	RUB 357.029	89	0	89 0,00
	09.2021	PLN	10.484	\$ 2.767	12	0	12 0,00
	09.2021	\$	10.001	PLN 38.063	0	(1)	(1) 0,00
	09.2021		5.284	RUB 387.228	0	(41)	(41) 0,00
	09.2021		794	TWD 21.746	0	(10)	(10) 0,00
	09.2021	ZAR	3.077	\$ 224	10	0	10 0,00
	11.2021	\$	13.586	PEN 50.923	0	(262)	(262) 0,00
	01.2022	ILS	145.958	\$ 44.859	77	(157)	(80) 0,00
	02.2022	CAD	18.196	15.075	380	0	380 0,00
HUS	07.2021	BRL	3.010	609	9	0	9 0,00
	07.2021	€	50.576	60.262	284	0	284 0,00
	07.2021	£	9.745	13.808	346	0	346 0,00
	07.2021	¥	49.591.873	454.609	7.797	0	7.797 0,05
	07.2021	\$	11.776	€ 9.706	0	(266)	(266) 0,00
	07.2021		24.296	£ 17.326	0	(361)	(361) 0,00
	08.2021		607	BRL 3.010	0	(9)	(9) 0,00
	08.2021		7.660	RUB 576.750	182	0	182 0,00
	09.2021	KRW	26.112.642	\$ 23.439	335	0	335 0,00
	09.2021	PEN	5.000	1.353	44	0	44 0,00
	09.2021	PLN	10.779	2.814	0	(18)	(18) 0,00
	09.2021	\$	2.295	CNH 14.741	0	(25)	(25) 0,00
	09.2021		2.181	RUB 159.713	0	(18)	(18) 0,00
	10.2021	PEN	2.288	\$ 608	9	0	9 0,00
	11.2021	ILS	43.198	13.317	36	0	36 0,00
IND	07.2021	DKK	1.500	240	1	0	1 0,00
JPM	07.2021	CAD	239.609	197.929	4.431	0	4.431 0,03
	07.2021	NZD	33.544	24.480	1.041	0	1.041 0,01
	07.2021	\$	135.042	DKK 839.379	0	(1.182)	(1.182) (0,01)
	07.2021		2.259	£ 1.628	0	(10)	(10) 0,00
	08.2021	CZK	11.751	\$ 564	18	0	18 0,00
	09.2021	\$	45.059	IDR 649.437.270	0	(787)	(787) (0,01)
	10.2021	DKK	718.219	\$ 115.487	748	0	748 0,01
MYI	08.2022	ILS	91.605	28.317	15	0	15 0,00
	07.2021	BRL	3.748	758	11	0	11 0,00
	07.2021	CHF	33	36	0	0	0 0,00
	07.2021	€	309	368	1	0	1 0,00
	07.2021	£	69	96	0	0	0 0,00
	07.2021	¥	25.603.994	235.204	4.517	0	4.517 0,03
	07.2021	NOK	2	0	0	0	0 0,00
	07.2021	NZD	14.220	10.072	136	0	136 0,00
	07.2021	SGD	470	350	0	0	0 0,00
	07.2021	\$	29.856	AUD 39.470	0	(223)	(223) 0,00
	07.2021		2.605	BRL 13.918	169	0	169 0,00
	07.2021		9	CHF 8	0	0	0 0,00
	07.2021		177.415	DKK 1.104.707	0	(1.242)	(1.242) (0,01)
	07.2021		563	€ 472	0	(3)	(3) 0,00
	07.2021		16.401	£ 11.815	0	(80)	(80) 0,00
	07.2021		1.566	¥ 171.500	0	(21)	(21) 0,00
	07.2021		2.731	RUB 209.216	125	0	125 0,00
	08.2021	AUD	39.470	\$ 29.860	223	0	223 0,00
	08.2021	\$	756	BRL 3.748	0	(11)	(11) 0,00
	09.2021	CNH	2.996.640	\$ 466.681	5.171	0	5.171 0,04
	10.2021	DKK	1.104.707	177.723	1.241	0	1.241 0,01
RBC	07.2021	\$	1.602	CAD 1.948	0	(29)	(29) 0,00
	07.2021		1.018	£ 735	0	(2)	(2) 0,00
SCX	07.2021	AUD	2.575	\$ 1.993	60	0	60 0,00
	07.2021	\$	1.546	CAD 1.913	0	(1)	(1) 0,00
	07.2021		1.410	¥ 154.300	0	(20)	(20) 0,00
	08.2021	CZK	1.575	\$ 76	2	0	2 0,00
	10.2021	\$	6	PEN 22	0	0	0 0,00
	12.2021	SGD	1.080	\$ 816	13	0	13 0,00
SOG	07.2021	\$	202.068	DKK 1.258.263	0	(1.406)	(1.406) (0,01)
	07.2021		3.126	RUB 242.836	189	0	189 0,00
	08.2021		4.250	320.515	108	0	108 0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
SSB	10.2021	DKK	1.258.263	\$ 202.417	\$ 1.404	\$ 1.404	0,01	
	07.2021	\$	5.172	£ 3.648	0	(132)	0,00	
	08.2021	£	969.591	\$ 1.340.009	449	0	0,00	
TOR	09.2021	\$	3	PLN 10	0	0	0,00	
	07.2021		343.693	¥ 38.020.016	0	(1.140)	(0,01)	
UAG	08.2021	¥	38.020.016	\$ 343.785	1.141	0	0,01	
	07.2021	AUD	73.499	¥ 56.973	1.793	0	1.793	0,01
	07.2021	CHF	377		9	0	9	0,00
	07.2021	£	999.207	1.415.745	35.391	0	35.391	0,24
	07.2021	\$	145.134	AUD 191.330	0	(1.494)	(1.494)	(0,01)
	07.2021		4.388	€ 3.611	0	(105)	(105)	0,00
	07.2021		331.561	¥ 36.703.751	0	(866)	(866)	(0,01)
	07.2021		8.971	RUB 687.932	420	0	420	0,00
	08.2021	AUD	191.330	\$ 145.153	1.489	0	1.489	0,01
	08.2021	¥	36.703.751	331.648	866	0	866	0,01
09.2021	\$	2.151	RUB 157.790	0	(15)	(15)	0,00	
				\$ 198.209	\$ (17.946)	\$ 180.263	1,22	

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	CAD	25.538	\$ 20.629	\$ 6	\$ 0	0,00	
	07.2021	\$	21.035	CAD 25.426	0	(502)	0,00	
	08.2021		20.629	25.538	0	(6)	0,00	
BPS	07.2021		21.537	26.019	0	(525)	(0,01)	
CBK	07.2021	CAD	25.845	\$ 21.016	144	0	144	0,00
	08.2021	\$	21.015	CAD 25.845	0	(144)	(144)	0,00
HUS	07.2021		39	47	0	(1)	0,00	
JPM	07.2021		21.301	25.787	0	(477)	(0,01)	
				\$ 150	\$ (1.655)	\$ (1.505)	(0,01)	

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	CHF	259	\$ 289	\$ 9	\$ 0	0,00	
	07.2021	\$	357.747	CHF 320.927	0	(10.555)	(0,07)	
BPS	07.2021	CHF	296	\$ 322	2	0	0,00	
BRC	07.2021	\$	2.012	CHF 1.808	0	(57)	0,00	
CBK	07.2021	CHF	320.727	\$ 348.380	1.405	0	1.405	0,01
	07.2021	\$	358.122	CHF 321.101	0	(10.742)	(10.742)	(0,07)
GLM	08.2021		348.674	320.727	0	(1.404)	(1.404)	(0,01)
	07.2021	CHF	2.106	\$ 2.342	64	0	64	0,00
	07.2021	\$	158	CHF 145	0	(1)	(1)	0,00
MYI	07.2021	CHF	196	\$ 213	1	0	1	0,00
	07.2021	\$	350.838	CHF 316.095	0	(8.873)	(8.873)	(0,06)
SCX	07.2021	CHF	246	\$ 272	5	0	5	0,00
	07.2021	\$	2.923	CHF 2.681	0	(23)	(23)	0,00
SSB	07.2021	CHF	2.895	\$ 3.219	87	0	87	0,00
	07.2021	\$	482	CHF 434	0	(13)	(13)	0,00
UAG	07.2021	CHF	79	\$ 88	2	0	2	0,00
	07.2021	\$	1.675	CHF 1.510	0	(42)	(42)	0,00
				\$ 1.575	\$ (31.710)	\$ (30.135)	(0,20)	

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional GBP (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, Investor USD (Currency Exposure) thesaurierend, Class E USD (Currency Exposure) thesaurierend, Class E USD (Currency Exposure) ausschüttend, H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Class W USD (Currency Exposure) thesaurierend und Class W USD (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	€	57	\$ 68	\$ 1	\$ 0	0,00	
	07.2021	HKD	126	16	0	0	0,00	
	07.2021	SGD	1.635	1.218	1	0	1	0,00
	07.2021	\$	493	CZK 10.277	0	(15)	(15)	0,00
	07.2021		1.495	MXN 29.825	3	0	3	0,00
	08.2021		16	HKD 126	0	0	0	0,00
	08.2021		1.218	SGD 1.635	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07.2021	CNY	291.813	\$ 45.100	0	(69)	(69)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende		Zu erhaltende		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
		Währung		Währung							
	07.2021	DKK	3.891	\$	633	\$	12	\$	12	0,00	
	07.2021	€	782		943		15		15	0,00	
	07.2021	MXN	29.825		1.472		0	(26)	(26)	0,00	
	07.2021	\$	6.798	AUD	8.747		0	(231)	(231)	0,00	
	07.2021		299	€	245		0	(8)	(8)	0,00	
	07.2021		2.488	IDR	35.692.862		0	(31)	(31)	0,00	
	07.2021		81.391	¥	8.901.587		0	(1.189)	(1.189)	(0,01)	
	07.2021		1.026	NZD	1.414		0	(38)	(38)	0,00	
	07.2021		1.236	SGD	1.635		0	(20)	(20)	0,00	
	08.2021		44.990	CNY	291.813		82	0	82	0,00	
	08.2021		1.467	MXN	29.825		25	0	25	0,00	
BRC	07.2021	€	117	\$	143		4	0	4	0,00	
	07.2021	\$	3.210	CHF	2.884		0	(90)	(90)	0,00	
	07.2021		2.842	SEK	23.557		0	(87)	(87)	0,00	
CBK	07.2021	COP	2.356.862	\$	623		0	(8)	(8)	0,00	
	07.2021	CZK	10.277		480		3	0	3	0,00	
	07.2021	\$	2.344	AUD	3.031		0	(69)	(69)	0,00	
	07.2021		625	COP	2.356.862		6	0	6	0,00	
	07.2021		935	ILS	3.034		0	(4)	(4)	0,00	
	08.2021		622	COP	2.356.862		8	0	8	0,00	
	08.2021		480	CZK	10.277		0	(3)	(3)	0,00	
GLM	07.2021	HUF	96.176	\$	326		1	0	1	0,00	
	07.2021	KRW	8.418.282		7.443		0	(18)	(18)	0,00	
	07.2021	MYR	7.651		1.836		0	(7)	(7)	0,00	
	07.2021	THB	69.857		2.186		6	0	6	0,00	
	07.2021	\$	583	AUD	755		0	(16)	(16)	0,00	
	07.2021		31.062	£	21.972		0	(709)	(709)	(0,01)	
	07.2021		2.230	THB	69.857		0	(50)	(50)	0,00	
	07.2021		150	TWD	4.196		0	0	0	0,00	
	08.2021	TWD	4.196	\$	151		0	0	0	0,00	
	08.2021	\$	325	HUF	96.176		0	(1)	(1)	0,00	
	08.2021		7.442	KRW	8.418.282		8	0	8	0,00	
	08.2021		1.834	MYR	7.651		5	0	5	0,00	
	08.2021		2.183	THB	69.857		0	(4)	(4)	0,00	
HUS	07.2021	€	716	\$	860		11	0	11	0,00	
	07.2021	£	23.683		32.779		62	0	62	0,00	
	07.2021	IDR	35.692.862		2.461		3	0	3	0,00	
	07.2021	ILS	2.994		919		0	0	0	0,00	
	07.2021	RUB	64.704		892		7	0	7	0,00	
	07.2021	\$	1.133	CAD	1.368		0	(28)	(28)	0,00	
	07.2021		11.032	€	9.056		0	(292)	(292)	0,00	
	07.2021		869	RUB	64.113		9	0	9	0,00	
	08.2021		32.781	£	23.683		0	(62)	(62)	0,00	
	08.2021		2.452	IDR	35.692.862		0	(6)	(6)	0,00	
	08.2021		919	ILS	2.994		0	0	0	0,00	
	08.2021		888	RUB	64.704		0	(6)	(6)	0,00	
	07.2021		3.301	CNY	21.128		0	(31)	(31)	0,00	
IND	07.2021		16	HKD	126		0	0	0	0,00	
JPM	07.2021	€	92	\$	110		0	0	0	0,00	
MYI	07.2021	PLN	4.946		1.304		5	0	5	0,00	
	07.2021	\$	336	HUF	96.176		0	(11)	(11)	0,00	
	07.2021		6.260	¥	687.345		0	(67)	(67)	0,00	
	07.2021		1.852	MYR	7.651		0	(9)	(9)	0,00	
	07.2021		460	NOK	3.800		0	(18)	(18)	0,00	
	07.2021		1.347	PLN	4.946		0	(48)	(48)	0,00	
	08.2021		1.305		4.946		0	(5)	(5)	0,00	
SCX	07.2021	TWD	4.196	\$	151		1	0	1	0,00	
	07.2021	\$	1.673	DKK	10.315		0	(28)	(28)	0,00	
	07.2021		145.699	€	119.096		0	(4.462)	(4.462)	(0,03)	
	07.2021		2.419	£	1.711		0	(55)	(55)	0,00	
	07.2021		42.326	CNY	270.685		0	(428)	(428)	(0,01)	
SOG	07.2021		17.731	CAD	21.422		0	(432)	(432)	0,00	
TOR	07.2021	AUD	8.440	\$	6.402		66	0	66	0,00	
UAG	07.2021	\$	7.533	KRW	8.418.282		0	(72)	(72)	0,00	
	07.2021		9	RUB	636		0	0	0	0,00	
	08.2021		6.403	AUD	8.440		0	(66)	(66)	0,00	
							\$	(8.820)	\$	(8.476)	(0,06)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende		Zu erhaltende		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
		Währung		Währung						
BOA	07.2021	€	12.431	\$	15.080	\$	338	\$	338	0,00
BPS	07.2021		8.962		10.763		135		135	0,00
	07.2021	\$	1.652.013	€	1.350.382		0	(50.594)	(50.594)	(0,34)
BRC	07.2021	€	3.117	\$	3.797		100		100	0,00
GLM	07.2021		1.497		1.814		39		39	0,00
HUS	07.2021		12.374		14.952		278		278	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MYI	07.2021	\$ 71.033	€ 58.859	\$ 0	\$ (1.232)	\$ (1.232)	(0,01)
	07.2021	€ 2.599	\$ 3.095	12	0	12	0,00
RBC	07.2021	\$ 182.048	€ 148.809	0	(5.576)	(5.576)	(0,04)
SCX	07.2021	€ 1.989	\$ 2.420	61	0	61	0,00
	07.2021	\$ 1.927.349	€ 1.575.446	0	(59.028)	(59.028)	(0,40)
TOR	07.2021	1.742.939	1.424.706	0	(53.379)	(53.379)	(0,36)
UAG	07.2021	€ 921	\$ 1.121	28	0	28	0,00
				\$ 991	\$ (169.809)	\$ (168.818)	(1,15)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) thesaurierend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 261	\$ 365	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	07.2021	\$ 1.217	£ 865	0	(23)	(23)	0,00
BRC	07.2021	£ 210	\$ 294	4	0	4	0,00
	07.2021	\$ 4.189	£ 2.972	0	(82)	(82)	0,00
GLM	07.2021	222.058	157.073	0	(5.070)	(5.070)	(0,03)
HUS	07.2021	£ 169.732	\$ 235.048	573	0	573	0,00
	07.2021	\$ 1.151	£ 813	0	(28)	(28)	0,00
	08.2021	228.723	165.240	0	(432)	(432)	0,00
MYI	07.2021	£ 2.716	\$ 3.775	24	0	24	0,00
	07.2021	\$ 2.803	£ 2.013	0	(22)	(22)	0,00
RBC	07.2021	74.511	52.516	0	(1.963)	(1.963)	(0,01)
RYL	07.2021	£ 336	\$ 474	10	0	10	0,00
SCX	07.2021	\$ 148.181	£ 104.238	0	(4.182)	(4.182)	(0,03)
SSB	07.2021	£ 165.399	\$ 228.575	84	0	84	0,00
	07.2021	\$ 609	£ 438	0	(4)	(4)	0,00
	08.2021	228.368	165.240	0	(77)	(77)	0,00
UAG	07.2021	222.551	157.073	0	(5.563)	(5.563)	(0,04)
				\$ 699	\$ (17.446)	\$ (16.747)	(0,11)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional ILS (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 31	ILS 100	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	07.2021	31	102	0	0	0	0,00
GLM	07.2021	0	1	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	ILS 101	\$ 31	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 31	ILS 102	0	0	0	0,00
	08.2021	31	101	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional NOK (Hedged) thesaurierend, Investor NOK (Hedged) thesaurierend, Class E NOK (Hedged) thesaurierend und Class W NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	NOK 1.258.838	\$ 146.831	\$ 543	\$ 0	\$ 543	0,00
	08.2021	\$ 146.852	NOK 1.258.838	0	(541)	(541)	0,00
BPS	07.2021	204	1.686	0	(8)	(8)	0,00
CBK	07.2021	142.859	1.193.264	0	(4.191)	(4.191)	(0,03)
HUS	07.2021	0	4	0	0	0	0,00
MYI	07.2021	NOK 207	\$ 25	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 144.141	NOK 1.201.954	0	(4.463)	(4.463)	(0,03)
SCX	07.2021	NOK 11	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 346	NOK 2.922	0	(7)	(7)	0,00
SSB	07.2021	140.162	1.170.594	0	(4.129)	(4.129)	(0,03)
				\$ 544	\$ (13.339)	\$ (12.795)	(0,09)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	NZD 102.345	\$ 71.606	\$ 92	\$ 0	\$ 92	0,00
	07.2021	\$ 2.983	NZD 4.111	0	(111)	(111)	0,00
	08.2021	71.601	102.345	0	(92)	(92)	0,00
GLM	07.2021	2.472	3.545	7	(2)	5	0,00
JPM	07.2021	77.266	106.338	0	(2.962)	(2.962)	(0,02)
MYI	07.2021	69.984	96.473	0	(2.573)	(2.573)	(0,02)
SCX	07.2021	NZD 208	\$ 149	4	0	4	0,00
	07.2021	\$ 68.022	NZD 94.197	0	(2.202)	(2.202)	(0,01)
				\$ 103	\$ (7.942)	\$ (7.839)	(0,05)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend, M Retail SEK (Hedged) thesaurierend, Class R SEK (Hedged) thesaurierend und Class W SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 2	SEK 15	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2021	39.882	330.640	0	(1.220)	(1.220)	(0,01)
BRC	07.2021	46.647	386.702	0	(1.429)	(1.429)	(0,01)
HUS	07.2021	159	1.363	0	0	0	0,00
RBC	07.2021	46.647	386.702	0	(1.430)	(1.430)	(0,01)
SCX	07.2021	SEK 1.277	\$ 155	5	0	5	0,00
SSB	07.2021	\$ 5	SEK 40	0	0	0	0,00
UAG	07.2021	533	4.432	0	(15)	(15)	0,00
		SEK 1.587	\$ 192	6	0	6	0,00
				\$ 11	\$ (4.094)	\$ (4.083)	(0,03)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowert zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 46.933	\$ 34.956	\$ 40	\$ 0	\$ 40	0,00
	08.2021	\$ 34.953	SGD 46.933	0	(40)	(40)	0,00
BPS	07.2021	34.780	46.010	0	(551)	(551)	(0,01)
GLM	07.2021	373	500	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	60	81	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	34.733	45.954	0	(546)	(546)	0,00
MYI	07.2021	SGD 46.962	\$ 34.938	1	0	1	0,00
	08.2021	\$ 34.935	SGD 46.962	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2021	33.945	44.990	0	(475)	(475)	0,00
SSB	07.2021	SGD 306	\$ 230	2	0	2	0,00
UAG	07.2021	\$ 2.352	SGD 3.127	0	(26)	(26)	0,00
	07.2021	227	301	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 43	\$ (1.644)	\$ (1.601)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (57.604) (0,39)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Ginnie Mae, TBA			
3,500 % fällig am 01.07.2051	\$ 1.500	\$ (1.574)	(0,01)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2051 (j)	112.800	(113.901)	(0,77)
2,000 % fällig am 01.08.2051 (j)	129.100	(130.108)	(0,89)
2,500 % fällig am 01.07.2051 (j)	49.628	(51.334)	(0,35)
2,500 % fällig am 01.08.2051 (j)	68.000	(70.205)	(0,48)
3,000 % fällig am 01.08.2051 (j)	6.000	(6.251)	(0,04)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (373.373)	(2,54)
Summe Anlagen		\$ 17.102.711	116,35
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (2.403.478)	(16,35)
Nettovermögen		\$ 14.699.233	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(h) Mit dem Fonds verbunden.

(i) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(j) Zum 30. Juni 2021 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

(k) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettover- mögens
Deutsche Bank AG	3,729 %	14.01.2032	21.01.2021	\$ 2.006	\$ 2.038	0,01
Morgan Stanley	0,735	03.02.2023	30.01.2020	53.692	57.415	0,39
				\$ 55.698	\$ 59.453	0,40

(l) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.041.336 und Barmittel in Höhe von USD 40 als Sicherheiten verpfändet.

(m) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 45.976 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 10.591 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 144.941 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 150.390 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 16.266.169	\$ 10.087	\$ 16.276.256
Investmentfonds	683.599	537.327	0	1.220.926
Finanzderivate ⁽³⁾	2.212	(23.310)	0	(21.098)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(373.373)	0	(373.373)
Summen	\$ 685.811	\$ 16.406.813	\$ 10.087	\$ 17.102.711

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 23.450.429	\$ 97.784	\$ 23.548.213
Investmentfonds	811.196	538.060	0	1.349.256
Pensionsgeschäfte	0	19.238	0	19.238
Finanzderivate ⁽³⁾	5.433	123.127	(28)	128.532
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(1.765.552)	0	(1.765.552)
Summen	\$ 816.629	\$ 22.365.302	\$ 97.756	\$ 23.279.687

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettover- mögens
BRC	(4,000) %	12.01.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (6.375)	\$ (7.517)	(0,05)
		15.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(2.107)	(2.497)	(0,02)
		30.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(2.223)	(2.636)	(0,02)
BSN	0,040	10.06.2021	12.07.2021	\$ (109.125)	(109.127)	(0,74)
CIB	0,040	25.05.2021	20.07.2021	(119.629)	(119.634)	(0,81)
GRE	0,030	15.06.2021	15.07.2021	(37.241)	(37.241)	(0,25)
	0,040	02.06.2021	14.07.2021	(88.116)	(88.119)	(0,60)
	0,040	08.06.2021	08.07.2021	(21.232)	(21.233)	(0,14)
	0,050	05.05.2021	06.07.2021	(55.248)	(55.252)	(0,38)
	0,050	14.06.2021	26.07.2021	(143.771)	(143.774)	(0,98)
	0,050	16.06.2021	28.07.2021	(385.408)	(385.416)	(2,62)
	0,060	06.05.2021	07.07.2021	(6.312)	(6.312)	(0,04)
	0,060	30.06.2021	07.07.2021	(12.999)	(12.999)	(0,09)
	0,070	22.06.2021	06.07.2021	(1.701)	(1.701)	(0,01)
IND	0,040	10.06.2021	09.07.2021	(39.062)	(39.063)	(0,27)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (1.032.521)	(7,02)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	% des Nettover- mögens
TDM	0,070 %	30.06.2021	02.07.2021	\$ (46.114)	\$ (46.114)	(0,31)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (46.114)	(0,31)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (576)	\$ 390	\$ (186)
BOA	(3.989)	2.720	(1.269)
BPS	56.917	(49.980)	6.937
BRC	(3.515)	3.190	(325)
BSS	434	(590)	(156)
CBK	(8.028)	9.250	1.222
CIB	7.279	(7.870)	(591)
DUB	(143)	(170)	(313)
FAR	155	(250)	(95)
FBF	43	0	43
GLM	463	4.780	5.243
GST	(381)	380	(1)
HUS	5.713	(3.920)	1.793
IND	(30)	0	(30)
JPM	594	(630)	(36)
MYC	1.155	730	1.885
MYI	(6.032)	4.230	(1.802)
RBC	(9.000)	8.000	(1.000)
RYL	(2.372)	2.570	198
SAL	(86)	120	34
SCX	(70.332)	62.250	(8.082)
SOG	(133)	300	167
SSB	(3.774)	3.480	(294)
TOR	(53.810)	47.380	(6.430)
UAG	31.844	(28.750)	3.094

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	74,86	70,48
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	34,17	71,99
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,70	1,98
Investmentfonds	8,30	8,27
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,14	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,11	0,37
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,39)	0,39
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,54)	(10,83)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(7,02)	(9,74)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,31)	(0,54)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Australien	2,43	2,57
Österreich	0,08	0,08
Belgien	0,02	0,10
Brasilien	0,02	0,39
Kanada	2,87	2,09
Cayman Inseln	3,76	4,21
Chile	k. A.	0,08
China	8,52	6,98
Dänemark	3,61	4,05
Finnland	0,01	0,01
Frankreich	2,99	3,07
Deutschland	3,59	3,13
Hongkong	0,36	0,51
Ungarn	0,00	0,02
Indien	0,10	0,09
Indonesien	0,07	0,07
Irland	3,35	1,90
Israel	1,82	1,83
Italien	2,56	2,71

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Japan	10,12	9,97
Jersey, Kanalinseln	0,09	0,08
Kasachstan	0,00	0,00
Kuwait	0,43	0,40
Litauen	0,06	0,10
Luxemburg	0,89	1,01
Malaysia	0,45	0,49
Mauritius	0,04	0,04
Mexiko	0,11	0,11
Multinational	0,14	0,12
Niederlande	2,44	2,19
Neuseeland	0,21	0,32
Norwegen	0,13	0,22
Panama	k. A.	0,05
Peru	1,10	1,20
Polen	k. A.	0,06
Portugal	0,01	0,01
Katar	1,10	1,02
Rumänien	0,19	0,11
Russland	0,09	0,10
Saudi-Arabien	0,88	0,81
Serbien	0,10	k. A.
Singapur	0,28	0,36
Slowenien	0,36	0,43
Südafrika	0,08	0,07
Südkorea	0,98	0,94
Spanien	2,96	4,01
Supranational	0,53	0,31
Schweden	k. A.	0,08
Schweiz	1,05	0,67
Vereinigte Arabische Emirate	0,33	0,53
Großbritannien	12,55	12,18
USA	35,24	68,33
Kurzfristige Instrumente	1,63	4,24
Investmentfonds	8,30	8,27
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,14	0,03
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,01)	(0,08)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps – Basisswaps	(0,01)	(0,01)
Zinsswaps	0,13	0,46
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswaptionen	0,02	0,06
Optionen auf Wertpapiere	0,03	0,01
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Devisenoptionen	(0,01)	(0,01)
Zinsswaptionen	(0,07)	(0,02)
Zinsscaps	0,00	0,01
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,03)	(0,03)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,00
Cross-Currency Swaps	0,10	0,14
Total Return Swaps auf Wertpapiere	0,05	0,05
Devisenterminkontrakte	1,22	(0,97)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,71)	1,17
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,54)	(10,83)
Sonstige Aktiva und Passiva	(16,35)	(42,80)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
BESCHREIBUNG				BESCHREIBUNG				BESCHREIBUNG			
UNTERTRAGBARE WERTPAPIERE				Beschreibung				International Development Association			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Credit Suisse Group AG							
BANKEN UND FINANZEN				3,750 % fällig am 26.03.2025	\$ 250	\$ 271	0,02	0,350 % fällig am 22.04.2036	€ 3.700	\$ 4.359	0,26
Aegon Bank NV				3,869 % fällig am 12.01.2029	2.000	2.204	0,13	Intesa Sanpaolo SpA			
0,625 % fällig am 21.06.2024	€ 2.800	\$ 3.389	0,21	4,194 % fällig am 01.04.2031	300	337	0,02	0,750 % fällig am 04.12.2024	1.400	1.703	0,10
AerCap Ireland Capital DAC				4,550 % fällig am 17.04.2026	2.200	2.493	0,15	JPMorgan Chase & Co.			
4,625 % fällig am 01.07.2022	\$ 1.300	1.352	0,08	7,500 % fällig am 17.07.2023 (e)(g)	700	763	0,05	3,797 % fällig am 23.07.2024	\$ 3.500	3.730	0,23
AIB Group PLC				7,500 % fällig am 11.12.2023 (e)(g)	1.400	1.556	0,09	Jyske Realkredit A/S			
2,875 % fällig am 30.05.2031	€ 2.600	3.301	0,20	CTP NV				1,000 % fällig am 01.04.2022	DKK 51.300	8.272	0,50
Alexandria Real Estate Equities, Inc.				0,500 % fällig am 21.06.2025	€ 3.100	3.663	0,22	1,000 % fällig am 01.10.2050	11.230	1.709	0,10
2,000 % fällig am 18.05.2032	\$ 9.000	8.778	0,53	1,250 % fällig am 21.06.2029	3.900	4.577	0,28	1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
Asian Development Bank				Deutsche Bank AG				2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
1,500 % fällig am 04.05.2028	CAD 11.700	9.430	0,57	0,050 % fällig am 20.11.2024	3.300	3.947	0,24	KBC Group NV			
4,700 % fällig am 01.07.2022	MXN 79.400	3.995	0,24	0,750 % fällig am 17.02.2027	1.400	1.672	0,10	0,875 % fällig am 27.06.2023	€ 400	486	0,03
Aviation Capital Group LLC				1,375 % fällig am 17.02.2032	1.800	2.168	0,13	Kilroy Realty LP			
2,875 % fällig am 20.01.2022	\$ 700	707	0,04	1,625 % fällig am 20.01.2027	7.000	8.734	0,53	4,750 % fällig am 15.12.2028	\$ 1.000	1.163	0,07
4,125 % fällig am 01.08.2025	1.000	1.081	0,07	1,750 % fällig am 18.01.2021	€ 2.000	2.778	0,17	Kookmin Bank			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				2,222 % fällig am 18.09.2024	\$ 1.500	1.541	0,09	0,052 % fällig am 15.07.2025	€ 2.100	2.515	0,15
6,000 % fällig am 15.01.2026 (e)(g)	€ 2.000	2.715	0,17	2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 1.600	2.310	0,14	LeasePlan Corp. NV			
Banco de Sabadell S.A.				2,625 % fällig am 12.02.2026	€ 300	390	0,02	0,250 % fällig am 23.02.2026	5.800	6.860	0,42
1,125 % fällig am 11.03.2027	2.700	3.293	0,20	3,300 % fällig am 16.11.2022	€ 1.900	1.969	0,12	1,375 % fällig am 07.03.2024	1.350	1.664	0,10
Banco Santander S.A.				3,547 % fällig am 18.09.2031	500	533	0,03	Lloyds Bank PLC			
0,625 % fällig am 24.06.2029	3.500	4.149	0,25	4,100 % fällig am 13.01.2026	4.200	4.609	0,28	4,875 % fällig am 30.03.2027	€ 1.100	1.868	0,11
1,849 % fällig am 25.03.2026	\$ 1.000	1.011	0,06	4,250 % fällig am 14.10.2021	1.000	1.011	0,06	Lloyds Banking Group PLC			
4,375 % fällig am 14.01.2026 (e)(g)	€ 400	491	0,03	4,625 % fällig am 30.10.2027 (e)(g)	€ 1.000	1.235	0,08	0,500 % fällig am 12.11.2025	€ 500	602	0,04
Bank of America Corp.				Deutsche Pfandbriefbank AG				0,625 % fällig am 15.01.2032	€ 600	720	0,04
0,455 % fällig am 24.08.2025	1.700	2.052	0,12	1,049 % fällig am 29.09.2023	€ 1.100	1.545	0,09	3,900 % fällig am 12.03.2024	\$ 500	542	0,03
Bank of Scotland PLC				2,500 % fällig am 31.05.2022	\$ 2.600	2.652	0,16	4,550 % fällig am 16.08.2028	300	350	0,02
7,281 % fällig am 31.05.2026 (e)	€ 50	85	0,01	3,375 % fällig am 22.11.2021	€ 2.600	7.692	0,47	4,650 % fällig am 24.03.2026	1.700	1.926	0,12
Barclays Bank PLC				Dexia Credit Local S.A.				5,125 % fällig am 27.12.2024 (e)(g)	€ 600	881	0,05
7,625 % fällig am 21.11.2022 (g)	\$ 3.950	4.310	0,26	0,500 % fällig am 17.01.2025	€ 1.100	1.341	0,08	7,625 % fällig am 27.06.2023 (e)(g)	200	303	0,02
Barclays PLC				Digital Dutch Finco BV				7,875 % fällig am 27.06.2029 (e)(g)	200	353	0,02
0,625 % fällig am 14.11.2023	€ 2.300	2.760	0,17	0,625 % fällig am 15.07.2025	2.100	2.541	0,15	Low Income Investment Fund			
1,700 % fällig am 03.11.2026	€ 2.200	3.087	0,19	1,000 % fällig am 15.01.2032	3.750	4.412	0,27	3,386 % fällig am 01.07.2026	\$ 750	796	0,05
2,375 % fällig am 06.10.2023	400	565	0,03	Digital Euro Finco LLC				3,711 % fällig am 01.07.2029	1.950	2.092	0,13
3,125 % fällig am 17.01.2024	1.200	1.749	0,11	2,500 % fällig am 16.01.2026	1.100	1.434	0,09	Marsh & McLennan Cos., Inc.			
3,650 % fällig am 16.03.2025	\$ 1.000	1.085	0,07	Digital Intrepid Holding BV				3,500 % fällig am 10.03.2025	500	544	0,03
4,375 % fällig am 12.01.2026	2.900	3.249	0,20	0,625 % fällig am 15.07.2031	3.000	3.443	0,21	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
4,836 % fällig am 09.05.2028	1.400	1.575	0,10	DNB Boligkredit A/S				0,978 % fällig am 09.06.2024	€ 2.200	2.696	0,16
7,250 % fällig am 15.03.2023 (e)(g)	€ 1.400	2.091	0,13	0,625 % fällig am 19.06.2025	1.600	1.970	0,12	Mizuho Financial Group, Inc.			
7,875 % fällig am 15.03.2022 (e)(g)	\$ 1.400	1.462	0,09	3,250 % fällig am 28.06.2023	\$ 1.400	1.479	0,09	0,214 % fällig am 07.10.2025	1.600	1.913	0,12
7,875 % fällig am 15.09.2022 (e)(g)	€ 700	1.039	0,06	Erste Group Bank AG				0,956 % fällig am 16.10.2024	4.200	5.149	0,31
8,000 % fällig am 15.06.2024 (e)(g)	\$ 2.100	2.390	0,15	4,250 % fällig am 15.10.2027 (e)(g)	€ 600	763	0,05	1,177 % fällig am 11.09.2024	\$ 200	203	0,01
BlueHub Loan Fund, Inc.				Europäische Investitionsbank				Morgan Stanley			
2,890 % fällig am 01.01.2027	900	928	0,06	0,750 % fällig am 15.11.2024	€ 1.900	2.656	0,16	0,735 % fällig am 03.02.2023 (h)	CAD 4.600	3.720	0,23
3,099 % fällig am 01.01.2030	1.900	1.951	0,12	0,750 % fällig am 15.07.2027	AUD 5.000	3.646	0,22	Nationwide Building Society			
BNP Paribas S.A.				2,700 % fällig am 12.01.2023	3.600	2.806	0,17	0,450 % fällig am 24.02.2031	€ 1.500	2.073	0,13
2,219 % fällig am 09.06.2026	3.600	3.713	0,23	3,300 % fällig am 03.02.2028	1.000	844	0,05	1,700 % fällig am 13.02.2023	\$ 2.000	2.044	0,12
BOC Aviation Ltd.				Europäische Union				3,622 % fällig am 26.04.2023	1.300	1.333	0,08
2,750 % fällig am 18.09.2022	200	204	0,01	0,000 % fällig am 06.07.2026 (a)(b)	€ 1.900	2.297	0,14	3,766 % fällig am 08.03.2024	1.500	1.576	0,10
Brookfield Finance, Inc.				0,000 % fällig am 04.07.2031 (b)	2.300	2.723	0,17	4,302 % fällig am 08.03.2029	300	339	0,02
2,724 % fällig am 15.04.2031	3.350	3.452	0,21	0,700 % fällig am 06.07.2051 (a)	800	961	0,06	4,363 % fällig am 01.08.2024	1.100	1.181	0,07
CA Immobilien Anlagen AG				0,750 % fällig am 04.01.2047	100	122	0,01	5,750 % fällig am 20.06.2027 (e)(g)	€ 200	310	0,02
1,000 % fällig am 27.10.2025	€ 2.600	3.154	0,19	Ford Motor Credit Co. LLC				5,875 % fällig am 20.12.2024 (e)(g)	400	609	0,04
CaixaBank S.A.				0,000 % fällig am 07.12.2022	200	236	0,01	Natwest Group PLC			
1,500 % fällig am 03.12.2026	€ 700	969	0,06	3,219 % fällig am 09.01.2022	\$ 900	911	0,06	0,750 % fällig am 15.11.2025	€ 3.100	3.753	0,23
Caja Rural de Navarra SCC				3,370 % fällig am 17.11.2023	2.700	2.802	0,17	2,000 % fällig am 04.03.2025	800	998	0,06
0,875 % fällig am 08.05.2025	€ 2.000	2.465	0,15	Goldman Sachs Group, Inc.				2,359 % fällig am 22.05.2024	\$ 4.500	4.639	0,28
Castellum AB				0,010 % fällig am 21.04.2023	€ 3.200	3.797	0,23	4,600 % fällig am 28.06.2031 (e)(g)	2.300	2.317	0,14
2,125 % fällig am 20.11.2023	700	871	0,05	0,093 % fällig am 09.09.2022	1.100	1.307	0,08	4,892 % fällig am 18.05.2029	1.800	2.111	0,13
Ceetrus S.A.				Host Hotels & Resorts LP				5,076 % fällig am 27.01.2030	1.100	1.306	0,08
2,750 % fällig am 26.11.2026	1.500	1.946	0,12	3,375 % fällig am 15.12.2029	\$ 800	840	0,05	5,125 % fällig am 12.05.2027 (e)(g)	€ 1.900	2.832	0,17
Charles Schwab Corp.				HSBC Bank Canada				6,000 % fällig am 29.12.2025 (e)(g)	\$ 700	782	0,05
0,750 % fällig am 18.03.2024	\$ 500	503	0,03	3,300 % fällig am 28.11.2021	1.000	1.013	0,06	8,000 % fällig am 10.08.2025 (e)(g)	200	237	0,01
CNH Industrial Capital LLC				HSBC Holdings PLC				8,625 % fällig am 15.08.2021 (e)(g)	2.600	2.625	0,16
3,875 % fällig am 15.10.2021	100	101	0,01	3,033 % fällig am 22.11.2023	2.000	2.072	0,13	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
Community Preservation Corp.				3,803 % fällig am 11.03.2025	300	323	0,02	1,000 % fällig am 01.04.2022	DKK 27.500	4.435	0,27
2,867 % fällig am 01.02.2030	3.300	3.451	0,21	3,973 % fällig am 22.05.2030	200	224	0,01	1,000 % fällig am 01.10.2050	43.409	6.630	0,40
CPI Property Group S.A.				4,300 % fällig am 08.03.2026	1.600	1.806	0,11	1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,625 % fällig am 23.04.2027	€ 1.200	1.466	0,09	5,875 % fällig am 28.09.2026 (e)(g)	€ 590	916	0,06	2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
Credit Suisse AG				ING Groep NV				2,500 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
0,250 % fällig am 05.01.2026	1.800	2.142	0,13	1,125 % fällig am 07.12.2028	5.500	7.451	0,45	NTT Finance Corp.			
0,450 % fällig am 19.05.2025	1.300	1.565	0,10	5,750 % fällig am 16.11.2026 (e)(g)	\$ 800	887	0,05	1,900 % fällig am 21.07.2021	\$ 700	701	0,04
6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	\$ 2.200	2.435	0,15	6,875 % fällig am 16.04.2022 (e)(g)	400	417	0,03	Nykredit Realkredit A/S			
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung								0,000 % fällig am 01.10.2022	€ 1.300	1.549	0,09
2,250 % fällig am 17.01.2023	CAD 3.700	3.072	0,19					0,375 % fällig am 17.01.2028	1.400	1.642	0,10

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS		
1,000 % fällig am 01.07.2022	DKK 75.000	\$ 12.137	0,74	Broadcom, Inc.				Tesco Corporate Treasury Services PLC					
1,000 % fällig am 01.10.2050	166.353	25.301	1,54	2,450 % fällig am 15.02.2031	\$ 1.600	\$ 1.574	0,09	0,375 % fällig am 27.07.2029	€ 3.400	\$ 3.942	0,24		
1,000 % fällig am 01.10.2053	73.833	11.188	0,68	2,600 % fällig am 15.02.2033	700	685	0,04	2,750 % fällig am 27.04.2030	£ 1.400	2.070	0,13		
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	Campbell Soup Co.				VMware, Inc.					
1,500 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	3,650 % fällig am 15.03.2023	58	61	0,00	4,650 % fällig am 15.05.2027	\$ 1.000	1.149	0,07		
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	Central Nippon Expressway Co. Ltd.				Zoetis, Inc.					
2,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	0,616 % fällig am 15.02.2022	1.600	1.604	0,10	3,900 % fällig am 20.08.2028	500	569	0,03		
2,500 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	2,091 % fällig am 14.09.2021	1.400	1.405	0,08						
Prologis International Funding S.A.				2,567 % fällig am 02.11.2021	1.500	1.510	0,09						
1,750 % fällig am 15.03.2028	€ 2.300	2.981	0,18	2,849 % fällig am 03.03.2022	500	508	0,03				94.015	5,71	
Realkredit Danmark A/S				Chanel Ceres PLC				VERSORGUNGSUNTERNEHMEN					
2,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 0	0	0,00	0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 3.200	3.829	0,23	Anglian Water Services Financing PLC					
Royal Bank of Canada				Charter Communications Operating LLC				1,625 % fällig am 10.08.2025	£ 3.000	4.298	0,26		
0,520 % fällig am 30.01.2025	£ 1.000	1.394	0,08	4,464 % fällig am 23.07.2022	\$ 2.200	2.278	0,14	AT&T, Inc.					
0,629 % fällig am 03.10.2024	4.000	5.593	0,34	Conagra Brands, Inc.				3,100 % fällig am 01.02.2043	\$ 600	589	0,04		
Santander UK Group Holdings PLC				4,300 % fällig am 01.05.2024	600	658	0,04	Avangrid, Inc.					
0,391 % fällig am 28.02.2025	€ 900	1.077	0,07	Continental Wind LLC				3,150 % fällig am 01.12.2024	2.000	2.141	0,13		
1,089 % fällig am 15.03.2025	\$ 1.900	1.907	0,12	6,000 % fällig am 28.02.2033	1.999	2.297	0,14	Azure Power Solar Energy Pvt Ltd.					
2,896 % fällig am 15.03.2032	1.900	1.960	0,12	Dell International LLC				5,650 % fällig am 24.12.2024	1.400	1.489	0,09		
3,625 % fällig am 14.01.2026	£ 300	456	0,03	6,200 % fällig am 14.09.2021	2.500	3.217	0,19	British Telecommunications PLC					
3,823 % fällig am 03.11.2028	\$ 300	330	0,02	2,500 % fällig am 15.11.2024	1.800	1.893	0,11	9,625 % fällig am 15.12.2030	600	930	0,06		
4,750 % fällig am 15.09.2025	1.300	1.461	0,09	ERAC USA Finance LLC				British Transco International Finance BV					
Santander UK PLC				2,600 % fällig am 01.12.2021	100	101	0,01	0,000 % fällig am 04.11.2021 (b)	400	400	0,02		
0,050 % fällig am 12.01.2027	€ 600	719	0,04	Frontier Finance PLC				Clearway Energy Operating LLC					
0,600 % fällig am 12.02.2027	£ 700	982	0,06	8,000 % fällig am 23.03.2022	€ 188	265	0,02	3,750 % fällig am 15.02.2031	3.200	3.188	0,19		
SELP Finance SARL				HCA, Inc.				4,750 % fällig am 15.03.2028	1.200	1.260	0,08		
0,875 % fällig am 27.05.2029	€ 6.400	7.612	0,46	5,250 % fällig am 15.06.2026	\$ 900	1.043	0,06	DTE Electric Co.					
Shinhan Bank Co. Ltd.				Hilton Domestic Operating Co., Inc.				1,900 % fällig am 01.04.2028	7.500	7.621	0,46		
0,250 % fällig am 16.10.2024	3.100	3.714	0,23	4,875 % fällig am 15.01.2030	1.300	1.390	0,08	Enel Finance International NV					
Shriram Transport Finance Co. Ltd.				0,400 % fällig am 28.05.2031	€ 3.000	3.593	0,22	0,000 % fällig am 17.06.2024 (b)	€ 1.200	1.432	0,09		
5,950 % fällig am 24.10.2022	\$ 700	717	0,04	Infineon Technologies AG				1,000 % fällig am 20.10.2027	£ 1.800	2.445	0,15		
Societe Generale S.A.				2,000 % fällig am 24.06.2032	2.100	2.770	0,17	Greenko Dutch BV					
0,875 % fällig am 22.09.2028	€ 2.700	3.255	0,20	0,697 % fällig am 15.09.2022	\$ 1.700	1.702	0,10	3,850 % fällig am 29.03.2026	\$ 6.500	6.668	0,40		
Standard Chartered PLC				Liberty Utilities Finance GP				Greenko Solar Mauritius Ltd.					
1,214 % fällig am 23.03.2025 (h)	\$ 2.800	2.814	0,17	2,075 % fällig am 15.09.2030	3.000	2.898	0,18	5,550 % fällig am 29.01.2025	6.800	7.006	0,42		
2,678 % fällig am 29.06.2032	2.500	2.514	0,15	Macquarie University				India Green Power Holdings					
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				3,500 % fällig am 07.09.2028	AUD 800	664	0,04	4,000 % fällig am 22.02.2027	1.500	1.509	0,09		
0,010 % fällig am 10.09.2025	€ 3.900	4.656	0,28	Marks & Spencer PLC				NextEra Energy Capital Holdings, Inc.					
0,409 % fällig am 07.11.2029	1.300	1.571	0,10	3,750 % fällig am 19.05.2026	£ 3.850	5.540	0,34	2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD 5.000	3.785	0,23		
0,550 % fällig am 06.11.2023	1.650	1.996	0,12	Medtronic Global Holdings S.C.A.				0,900 % fällig am 15.01.2026	\$ 6.000	5.893	0,36		
2,014 % fällig am 07.11.2022	\$ 5.200	5.319	0,32	0,000 % fällig am 02.12.2022 (b)	€ 1.200	1.431	0,09	Southern Power Co.					
2,440 % fällig am 18.06.2024	1.000	1.051	0,06	Nissan Motor Co. Ltd.				0,900 % fällig am 15.01.2026	\$ 6.000	5.893	0,36		
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				1,940 % fällig am 15.09.2023	400	494	0,03	Telstra Corp. Ltd.					
0,465 % fällig am 30.05.2024	€ 2.600	3.136	0,19	3,043 % fällig am 15.09.2023	\$ 1.100	1.148	0,07	4,800 % fällig am 12.10.2021	500	506	0,03		
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				3,201 % fällig am 17.09.2028	€ 1.100	1.479	0,09					51.160	3,10
0,010 % fällig am 15.10.2027	2.500	2.952	0,18	3,522 % fällig am 17.09.2025	\$ 1.700	1.816	0,11	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel				605.693	36,77
Tesco Property Finance PLC				4,810 % fällig am 17.09.2030	900	1.017	0,06						
5,411 % fällig am 13.07.2044	£ 374	678	0,04	Panasonic Corp.				KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL					
5,801 % fällig am 13.10.2040	192	357	0,02	2,536 % fällig am 19.07.2022	4.613	4.705	0,29	Chicago Transit Authority, Illinois Revenue Bonds, (BABs), Series 2010					
UBS AG				Pearson Funding PLC				6,200 % fällig am 01.12.2040	100	138	0,01		
5,125 % fällig am 15.05.2024 (g)	\$ 1.300	1.436	0,09	3,750 % fällig am 04.06.2030	£ 2.000	3.088	0,19						
7,625 % fällig am 17.08.2022 (g)	3.100	3.336	0,20	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN					
UBS Group AG				4,500 % fällig am 22.01.2030	1.700	1.747	0,11	Fannie Mae					
2,859 % fällig am 15.08.2023	2.500	2.566	0,16	Renault S.A.				0,565 % fällig am 25.08.2050	1.471	1.478	0,09		
UniCredit Spa				1,125 % fällig am 04.10.2027	€ 1.000	1.110	0,07	Freddie Mac					
2,200 % fällig am 22.07.2027	€ 2.800	3.534	0,21	ReNew Power Pvt Ltd.				3,500 % fällig am 01.05.2048	8.649	9.283	0,56		
7,500 % fällig am 03.06.2026 (e)(g)	400	564	0,03	5,875 % fällig am 05.03.2027	\$ 3.200	3.423	0,21	4,000 % fällig am 01.06.2048	6.761	7.285	0,44		
9,250 % fällig am 03.06.2022 (e)(g)	500	636	0,04	Ryder System, Inc.				Ginnie Mae					
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.				2,875 % fällig am 01.06.2022	1.700	1.736	0,10	1,029 % fällig am 20.04.2067	288	293	0,02		
3,150 % fällig am 12.05.2025	\$ 700	729	0,04	Schaeffler AG				3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047	82	84	0,01		
Weyerhaeuser Co.				3,375 % fällig am 12.10.2028	€ 1.000	1.310	0,08	Uniform Mortgage-Backed Security					
7,375 % fällig am 15.03.2032	1.300	1.878	0,11	Scottish Hydro Electric Transmission PLC				2,500 % fällig am 01.01.2051	9.203	9.565	0,58		
Workspace Group PLC				2,250 % fällig am 27.09.2035	£ 600	850	0,05	3,000 % fällig am 01.03.2050 - 01.03.2060	18.544	19.474	1,18		
2,250 % fällig am 11.03.2028	£ 2.200	3.026	0,18	SEB S.A.				3,500 % fällig am 01.11.2034 - 01.01.2059	6.590	7.099	0,43		
		460.518	27,96	1,375 % fällig am 16.06.2025	€ 3.100	3.796	0,23	4,000 % fällig am 01.07.2048	7.102	7.577	0,46		
INDUSTRIEWERTE				Southwest Airlines Co.				4,500 % fällig am 01.04.2049	72	77	0,01		
AbbVie, Inc.				5,250 % fällig am 04.05.2025	\$ 600	685	0,04	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA					
3,450 % fällig am 15.03.2022	\$ 900	915	0,06	Stora Enso Oyj				2,000 % fällig am 01.08.2051	8.000	8.062	0,49		
Amgen, Inc.				0,625 % fällig am 02.12.2030	€ 3.300	3.903	0,24	2,500 % fällig am 01.08.2051	4.000	4.130	0,25		
3,625 % fällig am 15.05.2022	1.600	1.629	0,10					3,000 % fällig am 01.08.2051	5.000	5.209	0,32		
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC								3,500 % fällig am 01.08.2051	6.200	6.530	0,40		
3,000 % fällig am 01.09.2029	€ 5.500	6.522	0,40					4,000 % fällig am 01.08.2051	117.500	125.229	7,60		
Boise Cascade Co.								4,500 % fällig am 01.08.2051	8.000	8.615	0,52		
4,875 % fällig am 01.07.2030	\$ 1.300	1.384	0,08									219.990	13,36

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
US-SCHATZIOBLIGATIONEN											
U.S. Treasury Bonds				Eurosail PLC				Structured Asset Securities Corp.			
1,375 % fällig am 15.11.2040	\$11.400	\$ 10.245	0,62	0,000 % fällig am 13.03.2045	€ 235	\$ 277	0,02	0,372 % fällig am 25.01.2036	\$ 162	\$ 152	0,01
1,625 % fällig am 15.11.2050	14.800	13.297	0,81	0,240 % fällig am 15.12.2044	€ 39	53	0,00	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
1,875 % fällig am 15.02.2041	39.800	38.973	2,37	Finsbury Square PLC				0,382 % fällig am 25.10.2036	357	321	0,02
U.S. Treasury Inflation Protected Securities				1,030 % fällig am 12.09.2068	765	1.060	0,06	TBW Mortgage-Backed Trust			
0,500 % fällig am 15.01.2028	9.200	10.321	0,63	1,079 % fällig am 16.09.2069	2.126	2.955	0,18	5,965 % fällig am 25.07.2037	2.725	1.327	0,08
2,500 % fällig am 15.01.2029	3.668	4.728	0,29	1,349 % fällig am 16.06.2070	3.544	4.948	0,30	Towd Point Mortgage Funding PLC			
3,875 % fällig am 15.04.2029 (d)	650	914	0,05	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				0,949 % fällig am 20.07.2045	€ 1.553	2.152	0,13
U.S. Treasury Notes				6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	\$ 40	22	0,00	1,111 % fällig am 20.10.2051	1.228	1.705	0,10
2,875 % fällig am 30.04.2025	5.700	6.183	0,37	Friary No. 6 PLC				Tower Bridge Funding PLC			
				0,769 % fällig am 21.11.2067	€ 1.044	1.456	0,09	1,419 % fällig am 20.09.2063	3.172	4.428	0,27
		84.661	5,14	GSR Mortgage Loan Trust				Trinidad Mortgage Securities PLC			
				2,725 % fällig am 25.10.2035 ^	\$ 28	28	0,00	0,888 % fällig am 24.01.2059	387	536	0,03
				2,824 % fällig am 25.11.2035	113	114	0,01	Trinity Square PLC			
NON-AGENCY-MBS											
Albion PLC				Harben Finance PLC				0,899 % fällig am 15.07.2059	2.700	3.736	0,23
0,729 % fällig am 17.08.2062	€ 553	770	0,05	0,881 % fällig am 20.08.2056	€ 304	420	0,03	Twin Bridges PLC			
American Home Mortgage Assets Trust				Hawksmoor Mortgages PLC				0,899 % fällig am 12.03.2055	3.700	5.147	0,31
0,282 % fällig am 25.10.2046	\$ 1.301	826	0,05	1,099 % fällig am 25.05.2053	3.812	5.294	0,32	1,030 % fällig am 12.12.2052	1.149	1.595	0,10
1,067 % fällig am 25.10.2046	97	79	0,00	Impac Secured Assets Trust				Uropa Securities PLC			
American Home Mortgage Investment Trust				3,352 % fällig am 25.01.2037	\$ 688	654	0,04	0,436 % fällig am 10.10.2040	321	420	0,03
1,836 % fällig am 25.09.2035	204	118	0,01	IndyMac Mortgage Loan Trust				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
Atlas Funding PLC				3,023 % fällig am 25.11.2036	3.510	3.523	0,21	1,127 % fällig am 25.02.2046	\$ 373	376	0,02
0,951 % fällig am 25.07.2058	€ 2.200	3.059	0,19	2,880 % fällig am 25.12.2034	181	187	0,01	2,745 % fällig am 25.09.2033	60	61	0,00
Avon Finance No. 2 PLC				JPMorgan Alternative Loan Trust				2,903 % fällig am 25.10.2035	122	122	0,01
0,949 % fällig am 20.09.2048	2.081	2.884	0,18	0,572 % fällig am 25.11.2036	323	321	0,02	3,019 % fällig am 25.02.2037 ^	3.539	3.510	0,21
Bear Stearns ALT-A Trust				JPMorgan Mortgage Trust				3,074 % fällig am 25.09.2036	85	82	0,01
3,071 % fällig am 25.11.2036 ^	\$ 751	505	0,03	3,023 % fällig am 25.08.2035	146	152	0,01	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				6,000 % fällig am 25.06.2037	899	628	0,04	0,542 % fällig am 25.04.2035	416	334	0,02
0,262 % fällig am 25.06.2047	1.245	1.189	0,07	Lanark Master Issuer PLC							
Brass PLC				0,902 % fällig am 22.12.2069	€ 500	691	0,04				
0,769 % fällig am 16.11.2066	€ 586	817	0,05	Lehman XS Trust							
Canada Square Funding PLC				0,877 % fällig am 25.03.2047	\$ 583	573	0,03	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
0,829 % fällig am 17.06.2058 (a)	2.400	3.322	0,20	Ludgate Funding PLC				Accunia European CLO DAC			
0,999 % fällig am 17.06.2058	4.992	6.938	0,42	0,250 % fällig am 01.01.2061	€ 52	70	0,00	0,950 % fällig am 15.07.2030	€ 500	593	0,04
1,149 % fällig am 17.10.2051	780	1.084	0,07	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
1,299 % fällig am 17.12.2057	2.003	2.808	0,17	2,255 % fällig am 25.10.2047	\$ 3.020	1.290	0,08	0,992 % fällig am 25.12.2034	\$ 127	124	0,01
Canterbury Finance PLC				Miravet SARL				0,992 % fällig am 25.08.2035	1.600	1.607	0,10
1,399 % fällig am 16.05.2056	2.100	2.930	0,18	0,307 % fällig am 26.05.2065	€ 1.779	2.116	0,13	Adagio CLO DAC			
Chase Mortgage Finance Trust				Mortimer BTL PLC				0,720 % fällig am 15.10.2031	€ 2.400	2.843	0,17
3,338 % fällig am 25.07.2037	\$ 10	9	0,00	0,749 % fällig am 23.06.2053	€ 2.900	4.011	0,24	AlbaCore EURO CLO DAC			
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				Mulcair Securities DAC				1,530 % fällig am 18.07.2031	900	1.071	0,07
0,649 % fällig am 16.01.2057	€ 1.190	1.649	0,10	New Residential Mortgage Loan Trust				ALME Loan Funding DAC			
Citigroup Commercial Mortgage Trust				3,500 % fällig am 25.12.2057	€ 1.179	1.404	0,09	0,750 % fällig am 15.01.2031	496	587	0,04
3,209 % fällig am 10.05.2049	\$ 2.100	2.271	0,14	Paragon Mortgages PLC				Aqueduct European CLO DAC			
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				1,099 % fällig am 15.05.2045	€ 642	895	0,05	0,640 % fällig am 20.07.2030	3.100	3.682	0,22
2,713 % fällig am 25.12.2035 ^	489	386	0,02	Pepper Residential Securities Trust				Arbour CLO DAC			
Commercial Mortgage Trust				1,205 % fällig am 16.09.2059	AUD 170	129	0,01	0,580 % fällig am 15.03.2029	466	552	0,03
3,590 % fällig am 10.11.2047	2.000	2.155	0,13	Real Estate Asset Liquidity Trust				Ares European CLO DAC			
4,228 % fällig am 10.05.2051	1.700	1.955	0,12	3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD 271	226	0,01	0,780 % fällig am 15.10.2031	2.700	3.202	0,19
Countrywide Alternative Loan Trust				Residential Accredited Loans, Inc. Trust				Argent Securities Trust			
0,302 % fällig am 25.07.2046 ^	594	557	0,03	0,392 % fällig am 25.06.2037 ^	\$ 411	377	0,02	0,452 % fällig am 25.04.2036	\$ 5.320	2.335	0,14
0,332 % fällig am 25.06.2036	103	100	0,01	1,405 % fällig am 25.11.2037	328	313	0,02	Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
0,332 % fällig am 25.08.2047	1.322	1.298	0,08	6,000 % fällig am 25.06.2036	501	481	0,03	1,530 % fällig am 16.01.2030	3.800	3.802	0,23
5,500 % fällig am 25.11.2034	240	252	0,02	Residential Mortgage Securities PLC				Babson Euro CLO BV			
6,250 % fällig am 25.12.2036	1.147	738	0,05	0,884 % fällig am 20.03.2050	€ 617	854	0,05	0,281 % fällig am 25.10.2029	€ 266	315	0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				1,034 % fällig am 20.12.2046	590	816	0,05	Bain Capital Euro DAC			
0,632 % fällig am 25.04.2046	2.021	756	0,05	1,299 % fällig am 20.06.2070	1.763	2.461	0,15	0,740 % fällig am 20.01.2032	2.000	2.369	0,14
0,672 % fällig am 25.03.2035 ^	435	385	0,02	RESIMAC Bastille Trust				Bayview Financial Asset Trust			
0,772 % fällig am 25.03.2035 ^	96	90	0,01	1,037 % fällig am 05.09.2057	\$ 296	297	0,02	1,592 % fällig am 25.03.2037	\$ 128	128	0,01
6,000 % fällig am 25.07.2036	317	241	0,01	RESIMAC Premier				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	735	477	0,03	1,156 % fällig am 07.02.2052	2.554	2.566	0,16	1,067 % fällig am 25.03.2035	605	605	0,04
6,000 % fällig am 25.03.2037	779	599	0,04	Ripon Mortgages PLC				BlueMountain Fuji EUR CLO DAC			
6,500 % fällig am 25.11.2047	95	67	0,00	0,881 % fällig am 20.08.2056	€ 2.196	3.040	0,18	0,720 % fällig am 15.01.2031	€ 2.000	2.369	0,14
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				RMAC PLC				0,910 % fällig am 15.01.2033	2.850	3.359	0,20
0,392 % fällig am 25.09.2047 ^	925	844	0,05	0,780 % fällig am 12.06.2046	1.020	1.411	0,09	Bumper UK Finance PLC			
Durham Mortgages B PLC				1,050 % fällig am 12.06.2046	562	780	0,05	0,649 % fällig am 20.12.2028	€ 494	683	0,04
0,688 % fällig am 31.03.2054	€ 1.146	1.582	0,10	0,250 % fällig am 12.06.2044	46	61	0,00	Caïm CLO BV			
Dutch Property Finance BV				Sequoia Mortgage Trust				0,650 % fällig am 20.10.2028	€ 409	486	0,03
0,124 % fällig am 28.07.2058	€ 3.100	3.690	0,22	3,042 % fällig am 20.07.2037	\$ 306	282	0,02	0,780 % fällig am 15.10.2031	1.300	1.542	0,09
EMF-UK PLC				Stratton Mortgage Funding PLC				Carlyle Euro CLO DAC			
1,060 % fällig am 13.03.2046	€ 294	407	0,02	0,901 % fällig am 25.09.2051	€ 3.654	5.062	0,31	0,700 % fällig am 15.01.2031	2.200	2.609	0,16
Eurohome UK Mortgages PLC				0,948 % fällig am 20.07.2060	4.522	6.272	0,38	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC			
0,230 % fällig am 15.06.2044	42	57	0,00	0,949 % fällig am 12.03.2052	2.882	3.999	0,24	0,750 % fällig am 15.11.2031	1.500	1.771	0,11
EuroMASTR PLC								Catamaran CLO Ltd.			
0,280 % fällig am 15.06.2040	58	77	0,00					1,444 % fällig am 22.04.2030	\$ 4.278	4.281	0,26

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-WERTS MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-WERTS MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-WERTS MÖGENS			
CIT Mortgage Loan Trust 1,442 % fällig am 25.10.2037	\$	3.278	3,314	0,20	NovaStar Mortgage Funding Trust 0,192 % fällig am 25.01.2037	\$	2.720	1,191	0,07	China Development Bank 3,050 % fällig am 25.08.2026	CNY	34.700	5,306	0,32
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,112 % fällig am 25.05.2035		1.751	1.730	0,11	0,632 % fällig am 25.05.2036		1.700	1,628	0,10	3,180 % fällig am 05.04.2026		20.600	3,175	0,19
Countrywide Asset-Backed Certificates 0,232 % fällig am 25.07.2037		2.753	2.611	0,16	OCF CLO Ltd. 1,308 % fällig am 20.07.2029		3.100	3,102	0,19	3,340 % fällig am 14.07.2025		43.600	6,783	0,41
0,312 % fällig am 25.09.2037 ^		295	297	0,02	Option One Mortgage Loan Trust 0,232 % fällig am 25.01.2037		307	231	0,01	3,500 % fällig am 13.08.2026		29.000	4,533	0,28
0,342 % fällig am 25.02.2036		810	786	0,05	0,272 % fällig am 25.04.2037		3.382	2,131	0,13	3,680 % fällig am 26.02.2026		67.600	10,642	0,65
1,067 % fällig am 25.01.2036		3.034	3.057	0,19	OZLM Ltd. 1,186 % fällig am 16.05.2030		3.800	3,799	0,23	3,740 % fällig am 10.09.2025		10.200	1,608	0,10
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 0,552 % fällig am 25.05.2036		90	90	0,01	Palmer Square European Loan Funding DAC 0,870 % fällig am 15.02.2030	€	2.273	2,700	0,16	4,040 % fällig am 10.04.2027		32.100	5,136	0,31
Dryden Euro CLO BV 0,860 % fällig am 15.05.2034 (a)	€	1.250	1.482	0,09	1,150 % fällig am 15.01.2030		2.145	2,553	0,15	4,150 % fällig am 26.10.2025		2.400	3,85	0,02
Dryden Senior Loan Fund 1,084 % fällig am 15.10.2027	\$	441	441	0,03	Palmer Square Loan Funding Ltd. 1,056 % fällig am 15.11.2026	\$	341	341	0,02	4,240 % fällig am 24.08.2027		174.800	28,283	1,72
Encore Credit Receivables Trust 0,782 % fällig am 25.07.2035		527	521	0,03	PCL Funding PLC 1,099 % fällig am 15.09.2024	€	1.900	2,639	0,16	4,880 % fällig am 09.02.2028		26.400	4,434	0,27
Fieldstone Mortgage Investment Trust 0,772 % fällig am 25.02.2036		1.360	1.356	0,08	Penta CLO BV 0,790 % fällig am 04.08.2028	€	110	131	0,01	China Government Bond 2,740 % fällig am 04.08.2026		43.100	6,615	0,40
Fremont Home Loan Trust 1,157 % fällig am 25.06.2035		200	200	0,01	Pepper SPARKZ Trust No.3 1,055 % fällig am 17.08.2028	AUD	2.296	1,733	0,11	2,850 % fällig am 04.06.2027		31.000	4,749	0,29
Gallatin CLO Ltd. 1,236 % fällig am 21.01.2028		500	500	0,03	Renaissance Home Equity Loan Trust 5,762 % fällig am 25.08.2036 b	\$	725	405	0,02	2,950 % fällig am 16.06.2023		1.500	234	0,01
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 1,550 % fällig am 20.07.2031	€	2.100	2.494	0,15	Segovia European CLO DAC 0,880 % fällig am 20.07.2032 (a)	€	2.700	3,202	0,19	3,020 % fällig am 22.10.2025		152.900	23,760	1,44
Griffith Park CLO DAC 0,720 % fällig am 21.11.2031		1.000	1.182	0,07	Sorrento Park CLO DAC 0,409 % fällig am 16.11.2027		22	26	0,00	3,220 % fällig am 06.12.2025		40.000	6,276	0,38
Grosvenor Place CLO BV 0,720 % fällig am 30.10.2029		642	762	0,05	Soundview Home Loan Trust 0,412 % fällig am 25.11.2036	\$	1.449	1,447	0,09	3,280 % fällig am 03.12.2027		91.800	14,411	0,88
GSAMP Trust 0,592 % fällig am 25.05.2046	\$	1.400	1.359	0,08	0,497 % fällig am 25.12.2036		1.500	1,472	0,09	3,290 % fällig am 18.10.2023		4.500	707	0,04
1,142 % fällig am 25.10.2034		45	45	0,00	0,592 % fällig am 25.11.2036		1.200	1,162	0,07	3,820 % fällig am 18.11.2027		18.800	3,046	0,19
Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029	€	261	310	0,02	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 0,617 % fällig am 25.07.2036		1.460	1,419	0,09	CPPIB Capital, Inc. 1,500 % fällig am 23.06.2028	AUD	2.300	1,724	0,11
0,640 % fällig am 15.10.2031		3.200	3.792	0,23	Telos CLO Ltd. 1,460 % fällig am 17.01.2027		33	33	0,00	Development Bank of Japan, Inc. 1,875 % fällig am 02.10.2024	\$	3.900	4,042	0,25
0,650 % fällig am 26.06.2030		3.200	3.791	0,23	Terwin Mortgage Trust 1,032 % fällig am 25.11.2033		5	5	0,00	2,500 % fällig am 11.10.2022		2.600	2,667	0,16
0,760 % fällig am 15.07.2031		3.300	3.925	0,24	TICP CLO Ltd. 1,028 % fällig am 20.04.2028		780	780	0,05	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 2,500 % fällig am 11.10.2022		700	720	0,04
0,960 % fällig am 20.10.2031		1.200	1.422	0,09	Toro European CLO DAC 0,920 % fällig am 15.07.2030	€	700	831	0,05	France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€	7.700	8,731	0,53
Home Equity Asset Trust 0,767 % fällig am 25.02.2036	\$	1.200	1.192	0,07	Utah State Board of Regents 0,856 % fällig am 25.01.2057	\$	46	46	0,00	Hong Kong Government International Bond 2,375 % fällig am 02.02.2051	\$	2.400	2,345	0,14
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 0,312 % fällig am 25.04.2037		328	285	0,02	Vendome Funding CLO DAC 1,860 % fällig am 20.07.2031	€	2.000	2,374	0,14	Israel Government International Bond 0,000 % fällig am 30.11.2021	ILS	48.400	14,853	0,90
2,042 % fällig am 25.03.2035		1.295	1.297	0,08	Venture CLO Ltd. 1,064 % fällig am 15.04.2027	\$	169	169	0,01	0,000 % fällig am 22.07.2022 (b)	€	4.600	5,473	0,33
ICG U.S. CLO Ltd. 1,584 % fällig am 22.10.2031		3.100	3.107	0,19	1,288 % fällig am 20.01.2029		3.200	3,203	0,19	0,750 % fällig am 31.07.2022	ILS	4.400	1,361	0,08
Jubilee CLO BV 0,258 % fällig am 15.12.2029	€	986	1.166	0,07	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 0,437 % fällig am 25.01.2037		3.300	3,195	0,19	2,000 % fällig am 31.03.2027		7.800	2,584	0,16
Laurelin DAC 0,720 % fällig am 20.10.2031		1.500	1.777	0,11			150,055	9,11		3,375 % fällig am 15.01.2050	\$	1.900	2,034	0,12
Long Beach Mortgage Loan Trust 0,692 % fällig am 25.01.2036	\$	871	799	0,05	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 0,437 % fällig am 25.01.2037		3.300	3,195	0,19	3,800 % fällig am 13.05.2060		3.700	4,223	0,26
Mackay Shields Euro CLO DAC 1,550 % fällig am 15.08.2033	€	1.100	1.306	0,08			150,055	9,11		4,125 % fällig am 17.01.2048		200	241	0,01
Madison Park Euro Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2032		3.200	3.800	0,23						5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS	40.200	12,738	0,77
Marathon CLO Ltd. 1,019 % fällig am 21.11.2027	\$	242	242	0,01	STAAITSEMISSIONEN					Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % fällig am 01.04.2026 (b)	€	1.500	1,771	0,11
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 0,212 % fällig am 25.02.2037		696	299	0,02	Action Logement Services 0,500 % fällig am 30.10.2034	€	2.100	2,464	0,15	1,500 % fällig am 30.04.2045		3.000	3,457	0,21
0,812 % fällig am 25.05.2036		84	84	0,01	Adif Alta Velocidad 0,550 % fällig am 30.04.2030		1.400	1,680	0,10	1,850 % fällig am 01.07.2025		6.400	8,160	0,50
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,162 % fällig am 25.10.2036		939	555	0,03	Agence Francaise de Developpement 0,000 % fällig am 28.10.2027 (b)		1.600	1,912	0,12	2,150 % fällig am 01.03.2072		200	232	0,01
0,342 % fällig am 25.07.2036		81	72	0,00	Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD	10.700	7,896	0,48	Italy Government International Bond 6,875 % fällig am 27.09.2023	\$	2.100	2,381	0,14
0,692 % fällig am 25.12.2034		478	453	0,03	0,000 % fällig am 21.12.2030		2.600	1,874	0,11	Japan Finance Organization for Municipalities 0,010 % fällig am 02.02.2028	€	3.600	4,272	0,26
0,767 % fällig am 25.09.2035		3.300	3.246	0,20	1,750 % fällig am 21.06.2051		6.400	4,249	0,26	2,625 % fällig am 20.04.2022	\$	1.900	1,936	0,12
1,052 % fällig am 25.09.2034		970	950	0,06	Autonomous Community of Andalusia 0,500 % fällig am 30.04.2031	€	4.000	4,705	0,29	3,000 % fällig am 12.03.2024		500	531	0,03
Morgan Stanley Structured Trust 0,392 % fällig am 25.06.2037		2.900	2.721	0,17	Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035		200	315	0,02	3,375 % fällig am 27.09.2023		200	212	0,01
Mountain View CLO Ltd. 0,984 % fällig am 15.10.2026		362	362	0,02	4,900 % fällig am 15.09.2021		8.800	10,546	0,64	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 (d)	¥	756.705	6,995	0,43
New Century Home Equity Loan Trust 0,827 % fällig am 25.06.2035		968	968	0,06	Autonomous Community of Madrid 0,420 % fällig am 30.04.2031		4.200	4,938	0,30	0,200 % fällig am 20.06.2036		340.000	3,037	0,18
0,857 % fällig am 25.02.2035		3.223	3.188	0,19	0,747 % fällig am 30.04.2022		900	1,078	0,07	0,500 % fällig am 20.09.2046		597.000	5,278	0,32
North Westerly CLO BV 0,910 % fällig am 20.04.2031	€	2.300	2.730	0,17	BNG Bank NV 3,300 % fällig am 17.07.2028	AUD	3.000	2,521	0,15	0,500 % fällig am 20.03.2049		2.000.000	17,364	1,05
					Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.12.2044 (d)	CAD	485	515	0,03	0,700 % fällig am 20.12.2048		1.262.000	11,557	0,70
										1,200 % fällig am 20.09.2035		398.000	4,070	0,25
										1,400 % fällig am 20.09.2034		350.000	3,650	0,22
										Korea Housing Finance Corp. 0,010 % fällig am 29.06.2026	€	1.300	1,549	0,09
										Lithuania Government International Bond 0,100 % fällig am 01.04.2023		3.800	4,542	0,28
										Malaysia Government International Bond 3,502 % fällig am 31.05.2027	MYR	2.200	547	0,03
										3,906 % fällig am 15.07.2026		2.200	560	0,03
										Malaysia Government Investment Issue 4,130 % fällig am 09.07.2029		1.200	307	0,02
										4,369 % fällig am 31.10.2028		1.900	496	0,03
										Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 27.04.2051	\$	500	569	0,03
										Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 0,875 % fällig am 21.03.2046	€	3.800	4,460	0,27

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS					
New Zealand Government International Bond 1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD	1.500	\$ 1,023	0,06	Tokyo Metropolitan Government 2,500 % fällig am 08.06.2022	\$	900	917	0,06	JAPAN TREASURY BILLS						
Northern Territory Treasury Corp. 2,000 % fällig am 21.04.2031	AUD	1.100	825	0,05	2,625 % fällig am 29.05.2024	\$	400	422	0,03	(0,102) % fällig am 13.09.2021 (b)(c)	¥	2.830.000	\$	25.503	1,55	
Ontario Teachers' Finance Trust 0,100 % fällig am 19.05.2028	€	4.500	5.349	0,33	Treasury Corp. of Victoria 4,250 % fällig am 20.12.2032	AUD	1.700	1.586	0,10	(0,099) % fällig am 05.07.2021 (b)(c)	850.000	7.659	0,46			
0,900 % fällig am 20.05.2041	1.400	1.666	0,10	United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.10.2050	£	1.500	1.761	0,11				33.162	2,01			
Peru Government International Bond 2,780 % fällig am 01.12.2060	\$	1.500	1.342	0,08						U.S. TREASURY BILLS						
5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN	1.100	255	0,02						0,008 % fällig am 14.09.2021 (b)(c)	\$	13.800	13.799	0,84		
5,400 % fällig am 12.08.2034	1.900	470	0,03							0,012 % fällig am 12.08.2021 (b)(c)	6.400	6.400	0,39			
5,940 % fällig am 12.02.2029	14.200	4.060	0,25							0,012 % fällig am 21.09.2021 (b)(c)	8.700	8.699	0,53			
6,150 % fällig am 12.08.2032	2.100	560	0,03	VORZUGSWERTPAPIERE						0,018 % fällig am 22.07.2021 (b)(c)	2.200	2.200	0,13			
6,350 % fällig am 12.08.2028	21.400	6.254	0,38	Nationwide Building Society 10,250 %		750	195	0,01		0,018 % fällig am 02.09.2021 (b)(c)	5.500	5.499	0,33			
Province of Quebec 1,650 % fällig am 03.03.2022	CAD	1.800	1.468	0,09						0,025 % fällig am 28.09.2021 (b)(c)	7.000	6.999	0,42			
2,450 % fällig am 01.03.2023	2.000	1.669	0,10							0,028 % fällig am 05.10.2021 (b)(c)	12.000	11.999	0,73			
3,500 % fällig am 01.12.2022	500	421	0,03	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE						0,030 % fällig am 05.10.2021 (b)(c)	3.900	3.899	0,24			
Qatar Government International Bond 3,750 % fällig am 16.04.2030	\$	300	340	0,02	COMMERCIAL PAPER					0,044 % fällig am 23.09.2021 (b)(c)	11.300	11.299	0,69			
Regie Autonome des Transports Parisiens 0,875 % fällig am 25.05.2027	€	300	375	0,02	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 0,051 % fällig am 10.09.2021	€	4.600	5.457	0,33	0,046 % fällig am 23.09.2021 (b)(c)	12.300	12.299	0,75			
Romania Government International Bond 1,375 % fällig am 02.12.2029	1.300	1.541	0,09	KURZFRISTIGE SCHULDTITEL						Summe kurzfristige Instrumente	156.964	9,53				
2,000 % fällig am 14.04.2033	500	590	0,04	Federal Home Loan Bank 0,014 % fällig am						Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	1.760.612	106,89			
2,625 % fällig am 02.12.2040	500	590	0,04	06.08.2021 (b)(c)	\$	7.900	7.900	0,48								
2,750 % fällig am 14.04.2041	600	709	0,04	0,018 % fällig am		8.200	8.199	0,50								
Russia Government International Bond 7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB	43.500	620	0,04	01.09.2021 (b)(c)		4.300	4.300	0,26							
Slovenia Government International Bond 5,250 % fällig am 18.02.2024	\$	928	1.044	0,06	0,020 % fällig am 16.07.2021 (b)(c)											
SNCF Réseau 1,875 % fällig am 30.03.2034	€	3.800	5.258	0,32	ISRAEL TREASURY BILLS											
Societe Du Grand Paris EPIC 0,700 % fällig am 15.10.2060	4.400	4.466	0,27	(0,031) % fällig am	ILS	8.300	2.547	0,15								
South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029	\$	1.000	1.063	0,06	02.02.2022 (b)(c)											
Spain Government International Bond 0,250 % fällig am 30.07.2024	€	2.400	2.906	0,18	(0,028) % fällig am 30.11.2021 (b)(c)	14.700	4.512	0,27								
0,500 % fällig am 31.10.2031	4.300	5.110	0,31	(0,020) % fällig am												
0,850 % fällig am 30.07.2037	3.800	4.441	0,27	02.02.2022 (b)(c)	7.900	2.424	0,15									
1,250 % fällig am 31.10.2030	5.800	7.450	0,45	0,006 % fällig am												
1,400 % fällig am 30.07.2028	4.300	5.583	0,34	08.06.2022 (b)(c)	14.900	4.573	0,28									
1,450 % fällig am 31.10.2071	500	523	0,03	0,011 % fällig am												
				06.04.2022 (b)(c)	2.600	798	0,05									
						14.854	0,90									

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettover-mögens
BPS	0,030 %	30.06.2021	01.07.2021	\$ 22.400	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.08.2028	\$ (22.879)	\$ 22.400	\$ 22.400	1,36
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (22.879)	\$ 22.400	\$ 22.400	1,36

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03.2022	14	\$ (1)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2021	73	15	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2021	7	(1)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	462	902	0,06
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	384	(478)	(0,03)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	3	13	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	27	20	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	664	4	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	71	157	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2021	199	(71)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	832	(192)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	1.641	1.864	0,11

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond ESG Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	18	\$ (88)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2021	47	387	0,02
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	8	(14)	0,00
				\$ 2.517	0,15
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 2.517	0,15

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

ZINSSWAPS - BASISWAPS

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
3-Month USD-LIBOR ⁽¹⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	07.03.2024	\$ 6.300	\$ 1	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,071 %	12.06.2022	1.100	(1)	0,00
3-Month USD-LIBOR ⁽¹⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,073 %	27.04.2023	13.700	(2)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,084 %	26.04.2022	21.400	(3)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,084 %	12.06.2022	1.300	(1)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,085 %	19.06.2022	5.300	(2)	0,00
3-Month USD-LIBOR ⁽¹⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,088 %	06.09.2024	46.500	(9)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,091 %	18.03.2022	160.300	(57)	0,00
3-Month USD-LIBOR ⁽¹⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,102 %	04.10.2024	13.400	(2)	0,00
3-Month USD-LIBOR ⁽¹⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,105 %	27.09.2024	14.200	(3)	0,00
				\$ (79)	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽¹⁾		0,250				
	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	%	15.09.2023	£ 7.000	(9)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	13.900	(5)	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	8.600	54	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	2.800	(99)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,684	30.04.2025	\$ 900	(77)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,696	30.04.2025	900	(77)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,710	30.04.2025	1.000	(86)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,714	30.04.2025	1.900	(164)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,850	03.01.2022	BRL 42.400	105	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022	110.600	269	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,860	03.01.2022	54.100	134	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	29.900	73	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,871	03.01.2022	41.300	100	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,300	03.01.2022	562.900	(685)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,345	03.01.2022	12.100	(21)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,350	03.01.2022	264.300	(443)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	89.400	212	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,700	03.01.2022	132.900	(176)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 5.200	(29)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,250	16.06.2031	5.500	30	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,270	03.03.2022	7.000	46	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2022	2.500	9	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	300	4	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	42.000	(1.101)	(0,07)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	0,908	16.12.2030	KRW 2.700.000	(164)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,500	17.03.2031	1.000.000	(23)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD 950	(6)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	SEK 11.700	(6)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,250	16.06.2023	\$ 24.900	(42)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,400	30.03.2026	53.200	(613)	(0,04)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,400	15.01.2028	31.000	(1.178)	(0,07)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	20.120	(29)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	3.100	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	5.300	13	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022	3.800	(10)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022	12.800	(32)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	30.03.2031	28.800	1.512	0,09
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	15.350	338	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	52.200	(1.579)	(0,10)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025	25.300	(549)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	35.000	1.512	0,09
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,150	30.03.2051	2.200	101	0,01
Erhalt ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR	1,249	31.08.2024	8.800	(163)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025	1.700	(34)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	09.06.2041	11.000	725	0,04

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,250 %	16.12.2050	\$ 1.100	\$ (95)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,250	16.06.2051	400	21	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,250	16.06.2051	14.700	898	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,325	02.12.2050	1.500	211	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,460	02.02.2051	4.400	(276)	(0,02)
Erhalt ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR		1,620	27.01.2052	1.150	49	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR		1,635	31.08.2051	1.050	(34)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR		1,720	15.10.2031	6.700	(133)	(0,01)
Erhalt ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR		1,760	25.08.2051	1.000	2	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,935	22.06.2051	2.200	(63)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,940	15.06.2051	2.300	(69)	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR		1,950	04.10.2031	1.740	78	0,01
Erhalt ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR		1,950	31.08.2051	1.650	(73)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,968	23.06.2051	2.400	(87)	(0,01)
Erhalt ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR		2,000	15.12.2051	3.700	(36)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR		2,010	17.09.2051	700	(35)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		7,250	20.06.2023	ZAR 11.400	35	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW		1,250	17.06.2030	AUD 8.100	296	0,02
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW		1,750	16.06.2031	6.450	(104)	(0,01)
Zahlung	6-Month CHF-LIBOR		0,500	16.09.2025	CHF 36.100	(197)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		1,913	30.01.2029	CZK 7.400	3	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,000	15.09.2031	€ 27.400	35	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,000	17.03.2036	900	11	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,054	27.05.2050	600	95	0,01
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,064	17.11.2052	1.300	197	0,01
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,190	27.01.2032	3.000	(8)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,205	27.01.2032	3.800	(17)	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,250	15.09.2026	29.800	(81)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,250	16.06.2028	3.700	67	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,250	15.09.2036	1.300	(1)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,450	15.12.2035	200	13	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,500	15.09.2023	79.100	37	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,500	15.09.2051	9.900	100	0,01
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR		0,000	17.03.2031	¥ 890.000	48	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR		0,035	29.11.2029	1.500.000	(69)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR		0,200	19.06.2029	1.060.000	(65)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR		0,400	19.06.2039	430.000	(77)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR		0,500	19.06.2049	210.000	(104)	(0,01)
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR		1,500	10.03.2026	NOK 128.200	(83)	(0,01)
Zahlung	6-Month NOK-NIBOR		1,900	10.03.2031	66.900	200	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		4,870	07.07.2025	MXN 20.400	(59)	0,00
Erhalt	UKRPI		3,000	15.11.2050	£ 1.300	377	0,02
Erhalt	UKRPI		3,051	15.11.2050	1.100	317	0,02
Erhalt	UKRPI		3,143	15.11.2050	600	129	0,01
Zahlung	UKRPI		3,217	15.11.2040	3.150	(453)	(0,03)
Zahlung	UKRPI		3,272	15.11.2040	1.100	(151)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		3,273	15.11.2040	1.550	(213)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		3,340	15.11.2040	1.470	(159)	(0,01)
Erhalt	UKRPI		3,397	15.11.2030	1.850	91	0,01
Erhalt	UKRPI		3,445	15.11.2030	1.550	75	0,00
Erhalt	UKRPI		3,510	15.11.2030	870	32	0,00
Zahlung	UKRPI		3,700	15.04.2031	5.500	(120)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		3,740	15.03.2031	2.700	(1)	0,00
						\$ (1.613)	(0,10)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (1.692)	(0,10)

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BOA	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,016 %	15.07.2021	6.200	\$ 93	\$ 9	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,016	06.08.2021	6.300	92	19	0,00
CBK	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,004	25.01.2022	17.200	227	115	0,01
FAR	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,020	30.09.2021	8.200	172	19	0,00
GLM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,004	25.01.2022	18.900	239	127	0,01
							\$ 823	\$ 289	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	2.200	\$ 166	\$ 328	0,02

VERKAUFSOPTIONEN

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call – OTC USD versus CAD	CAD 1,265	11.02.2022	7.980	\$ (78)	\$ (99)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,880 %	15.09.2021	17.500	\$ (87)	\$ 0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	15.07.2021	6.200	(42)	(17)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	15.07.2021	6.200	(51)	(1)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	06.08.2021	6.300	(42)	(45)	0,00
BPS	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	06.08.2021	6.300	(48)	(6)	0,00
	Put – OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	2.200	(166)	(316)	(0,02)
BRC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,000	07.02.2022	14.400	(19)	(2)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	07.02.2022	14.400	(19)	(39)	0,00
FAR	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,025	30.09.2021	10.700	(77)	(4)	0,00
FBF	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,399	26.08.2021	20.800	(185)	0	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,000	07.02.2022	14.500	(19)	(2)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	07.02.2022	14.500	(19)	(40)	0,00
MYC	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	25.01.2022	7.200	(192)	(92)	(0,01)
	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,448	23.08.2021	16.600	(148)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	15.07.2021	5.900	(13)	(12)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	15.07.2021	5.900	(13)	(4)	0,00
RYL	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	25.01.2022	7.900	(118)	(101)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,000	07.02.2022	75.200	(97)	(12)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	07.02.2022	75.200	(97)	(205)	(0,01)
							\$ (1.452)	\$ (898)	(0,05)

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,000 %	07.10.2022	11.500	\$ (12)	\$ (2)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,000	08.10.2022	6.000	(6)	(1)	0,00
						\$ (18)	\$ (3)	0,00

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	2.500	\$ (11)	\$ (2)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

⁽²⁾ Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Japan Government International Bond	(1,000) %	20.06.2022	\$ 100	\$ (4)	\$ 3	\$ (1)	0,00
BPS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	100	(3)	2	(1)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.500	(37)	9	(28)	0,00
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	600	(11)	0	(11)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	300	(10)	7	(3)	0,00
CBK	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.900	(48)	13	(35)	(0,01)
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	800	(29)	21	(8)	0,00
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.300	(25)	2	(23)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	500	(17)	12	(5)	0,00
HUS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	600	(15)	4	(11)	0,00
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	900	(22)	6	(16)	0,00
					\$ (221)	\$ 79	\$ (142)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festszinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 3.900	\$ 34	\$ 15	\$ 49	0,01
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.700	(41)	68	27	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.100	(27)	45	18	0,00
MYC	Abu Dhabi Government International Bond	1,000	20.06.2026	400	11	1	12	0,00
	Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2021	€ 700	5	(1)	4	0,00
					\$ (18)	\$ 128	\$ 110	0,01

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 14.600	USD 11.000	\$ 71	\$ (151)	\$ (80)	(0,01)
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	5.100	3.519	(1)	326	325	0,02
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	5.000	3.450	(10)	329	319	0,02
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	10.100	1.256	44	259	303	0,02
						\$ 104	\$ 763	\$ 867	0,05

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,718 %	19.06.2029	KRW 523.700	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,785	20.03.2029	3.569.000	0	16	16	0,00
SCX	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,785	20.03.2029	760.000	23	(19)	4	0,00
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,795	20.03.2029	554.000	0	3	3	0,00
						\$ 23	\$ 0	\$ 23	0,00

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	DKK	90.303	\$ 14.370	\$ 0	\$ (31)	0,00	
	07.2021	€	5.848	7.092	157	0	0,01	
	07.2021	¥	249.600	2.267	18	0	0,00	
	07.2021	MXN	1.596	81	1	0	0,00	
	07.2021	NOK	64.420	7.514	28	0	0,00	
	08.2021	\$	7.515	NOK 64.420	0	(28)	(28)	0,00
	08.2021		346	RUB 26.041	8	0	8	0,00
	09.2021	CNY	68.971	\$ 10.723	103	0	103	0,01
	09.2021	¥	2.830.000	25.889	375	0	375	0,02
	09.2021	PLN	311	82	0	(7)	0	0,00
	09.2021	\$	4.160	IDR 59.961.359	0	(73)	(73)	0,00
	09.2021		686	RUB 50.037	0	(8)	(8)	0,00
	BPS	07.2021	AUD	18.941	\$ 14.713	493	0	493
07.2021		DKK	15.165	2.451	33	0	33	0,00
07.2021		€	2.740	3.272	22	0	22	0,00
07.2021		£	1.540	2.139	12	0	12	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2021	NZD	\$	1.106	\$	41	0,00
	09.2021	MYR		1.980		3	0,00
	09.2021	\$	KRW	1.697.612		0	0,00
	11.2021	ILS	\$	1.333		0	0,00
BRC	11.2021	MXN		3.925		11	0,00
	07.2021	CHF		536		15	0,00
	09.2021	PLN		54		0	0,00
CBK	07.2021	DKK		11.104		0	0,00
	07.2021	PEN		2.986		82	0,00
	07.2021	\$	CAD	15.666		0	0,00
	07.2021	1.561	DKK	9.820		5	0,00
	07.2021	7.712	NOK	64.420		0	0,00
	07.2021	1.426	PEN	5.662		52	0,00
	07.2021	314	RUB	24.258		17	0,00
	08.2021	CAD	\$	12.738		87	0,01
	08.2021	\$	RUB	32.195		9	0,00
	10.2021	PEN	\$	6.092		230	0,01
	11.2021	ILS		19.335		28	0,00
	01.2022	PEN		2.230		104	0,01
	02.2022	ILS		4.954		0	0,00
	03.2022	PEN		2.605		71	0,00
	04.2022	ILS		801		0	0,00
	06.2022	14.889		4.593		0	0,00
	07.2022	DKK		12.480		98	0,01
GLM	08.2022	ILS		1.377		0	0,00
	07.2021	DKK		1.926		50	0,00
	07.2021	£		104.994		3.389	0,21
	07.2021	¥		850.000		7.790	0,13
	07.2021	\$	DKK	6.040		0	0,00
	07.2021	630	RUB	48.625		34	0,00
	08.2021	600		44.974		11	0,00
	09.2021	PLN	\$	86		0	0,00
	09.2021	\$	PLN	1.131		0	0,00
	09.2021	872	RUB	63.875		0	0,00
	11.2021	1.403	PEN	5.258		0	0,00
	01.2022	ILS	\$	13.037		16	0,00
	02.2022	CAD		1.543		39	0,00
HUS	07.2021	€		10.849		84	0,01
	07.2021	£		2.846		69	0,00
	07.2021	\$	CAD	6.260		0	0,00
	07.2021	1.315	€	1.085		0	0,00
	07.2021	150.461	£	108.686		0	0,00
	08.2021	£	\$	148.874		281	0,02
	08.2021	\$	RUB	63.077		20	0,00
	09.2021	CNH	\$	118.328		1.212	0,07
	09.2021	PEN		1.639		53	0,00
	09.2021	PLN		97		0	0,00
	09.2021	\$	KRW	12.496.503		0	0,00
	09.2021	3.610	MXN	80.115		183	0,01
	09.2021	360	RUB	26.346		0	0,00
	11.2021	ILS	\$	1.380		4	0,00
	07.2022	\$	DKK	2.060		0	0,00
JPM	07.2021	DKK	\$	17.385		159	0,01
	07.2021	\$	DKK	186.591		0	0,00
	10.2021	DKK	\$	30.003		194	0,01
MYI	07.2021	€		22		0	0,00
	07.2021	£		211		0	0,00
	07.2021	\$	AUD	3.223		0	0,00
	07.2021	14.735	DKK	91.750		0	0,00
	07.2021	98	€	82		0	0,00
	07.2021	220	£	159		0	0,00
	07.2021	255	RUB	19.559		12	0,00
	08.2021	AUD	\$	2.438		18	0,00
	10.2021	DKK		14.761		103	0,01
	04.2022	78.800		12.744		105	0,01
SCX	07.2021	€		391.996		12.002	0,73
	07.2021	£		208		5	0,00
	07.2021	¥		50.830		736	0,04
	07.2021	\$	AUD	2.220		0	0,00
	09.2021	CNH	\$	7.328		67	0,00
TOR	07.2021	CAD		18.148		442	0,03
UAG	07.2021	\$	£	64		0	0,00
	07.2021	AUD	\$	5.021		158	0,01
	07.2021	\$	AUD	15.622		0	0,00
	07.2021	963	RUB	73.845		45	0,00
	08.2021	AUD	\$	11.852		122	0,01
	09.2021	\$	RUB	26.028		0	0,00
				\$ 21.847	\$ (1.982)	\$ 19.865	1,21

ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	AUD 50.659	\$ 38.147	\$ 114	\$ 0	\$ 114	0,01
	07.2021	\$ 40.326	AUD 52.302	0	(1.060)	(1.060)	(0,07)
	08.2021	38.152	50.659	0	(113)	(113)	(0,01)
BPS	07.2021	26.459	34.056	0	(892)	(892)	(0,05)
BRC	07.2021	131	173	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07.2021	756	978	0	(22)	(22)	0,00
GLM	07.2021	576	747	0	(16)	(16)	0,00
HUS	07.2021	1.671	2.166	0	(44)	(44)	0,00
MYI	07.2021	AUD 21.440	\$ 16.218	121	0	121	0,01
	07.2021	\$ 1.122	AUD 1.482	0	(9)	(9)	0,00
	08.2021	16.220	21.440	0	(121)	(121)	(0,01)
RBC	07.2021	390	503	0	(12)	(12)	0,00
SCX	07.2021	937	1.220	0	(21)	(21)	0,00
SSB	07.2021	387	501	0	(11)	(11)	0,00
TOR	07.2021	7.857	10.150	0	(237)	(237)	(0,02)
UAG	07.2021	AUD 33.943	\$ 25.748	265	0	265	0,02
	07.2021	\$ 35.946	AUD 46.379	0	(1.127)	(1.127)	(0,07)
	08.2021	25.751	33.943	0	(264)	(264)	(0,02)
				\$ 500	\$ (3.951)	\$ (3.451)	(0,21)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 8.216	CHF 7.371	\$ 0	(242)	(242)	(0,02)
BPS	07.2021	CHF 62	\$ 68	0	0	0	0,00
BRC	07.2021	\$ 69	CHF 62	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07.2021	CHF 7.006	\$ 7.610	31	0	31	0,00
	07.2021	\$ 7.576	CHF 6.793	0	(227)	(227)	(0,01)
GLM	08.2021	7.616	7.006	0	(31)	(31)	0,00
	07.2021	CHF 32	\$ 36	1	0	1	0,00
MYI	07.2021	\$ 76	CHF 68	0	(2)	(2)	0,00
	07.2021	7.412	6.678	0	(188)	(188)	(0,01)
SCX	07.2021	51	47	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	125	112	0	(3)	(3)	0,00
UAG	07.2021	CHF 119	\$ 131	2	0	2	0,00
				\$ 34	\$ (695)	\$ (661)	(0,04)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€ 1.779	\$ 2.148	\$ 39	\$ 0	\$ 39	0,00
	07.2021	\$ 929	€ 763	0	(24)	(24)	0,00
BPS	07.2021	€ 1.633	\$ 1.951	15	0	15	0,00
	07.2021	\$ 166.439	€ 136.112	0	(5.024)	(5.024)	(0,30)
BRC	07.2021	€ 231	\$ 282	7	0	7	0,00
GLM	07.2021	196	237	5	0	5	0,00
HUS	07.2021	4.079	4.902	64	0	64	0,00
MYI	07.2021	\$ 2.365	€ 1.957	0	(43)	(43)	0,00
	07.2021	291	245	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2021	€ 277	\$ 337	9	0	9	0,00
	07.2021	\$ 191.198	€ 156.288	0	(5.857)	(5.857)	(0,35)
TOR	07.2021	191.198	156.288	0	(5.856)	(5.856)	(0,36)
UAG	07.2021	€ 180	\$ 219	6	0	6	0,00
				\$ 145	\$ (16.805)	\$ (16.660)	(1,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	\$ 457	£ 326	\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00
BRC	07.2021	£ 1.133	\$ 1.582	17	0	17	0,00
	07.2021	\$ 79	£ 56	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2021	31.308	22.146	0	(715)	(715)	(0,04)
HUS	07.2021	£ 23.218	\$ 32.136	61	0	61	0,00
	07.2021	\$ 205	£ 145	0	(5)	(5)	0,00
MYI	08.2021	32.139	23.218	0	(61)	(61)	0,00
	07.2021	£ 80	\$ 111	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 91	£ 64	0	(2)	(2)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
RYL	07.2021	\$ 33	£ 24	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
SCX	07.2021	\$ 31.493	\$ 22.155	0	(887)	(887)	(0,06)
SSB	07.2021	£ 23.218	\$ 32.086	11	0	11	0,00
	07.2021	\$ 146	£ 104	0	(3)	(3)	0,00
	08.2021	\$ 32.089	\$ 23.218	0	(11)	(11)	0,00
UAG	07.2021	\$ 31.377	\$ 22.146	0	(784)	(784)	(0,05)
				\$ 90	\$ (2.476)	\$ (2.386)	(0,15)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	NOK 1.115.945	\$ 130.164	\$ 482	\$ 0	\$ 482	0,03
	08.2021	\$ 130.183	NOK 1.115.945	0	(480)	(480)	(0,03)
BPS	07.2021	\$ 736	\$ 6.120	0	(25)	(25)	0,00
CBK	07.2021	\$ 61.086	\$ 510.239	0	(1.792)	(1.792)	(0,11)
GLM	07.2021	\$ 174.532	\$ 1.462.380	0	(4.590)	(4.590)	(0,28)
HUS	07.2021	\$ 2.456	\$ 20.903	0	(27)	(27)	0,00
JPM	07.2021	\$ 3.363	\$ 27.963	0	(113)	(113)	(0,01)
MYI	07.2021	NOK 413.951	\$ 48.305	200	0	200	0,01
	07.2021	\$ 163.993	NOK 1.367.471	0	(5.081)	(5.081)	(0,31)
	08.2021	\$ 41.343	\$ 354.728	0	(114)	(114)	(0,01)
SCX	07.2021	\$ 1.172	\$ 10.017	1	(9)	(8)	0,00
SSB	07.2021	\$ 86.512	\$ 722.438	0	(2.558)	(2.558)	(0,15)
UAG	07.2021	\$ 39.562	\$ 330.242	0	(1.185)	(1.185)	(0,07)
				\$ 683	\$ (15.974)	\$ (15.291)	(0,93)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 16.019	NZD 22.181	\$ 0	\$ (520)	\$ (520)	(0,03)
GLM	07.2021	\$ 1	\$ 1	0	0	0	0,00
MYI	07.2021	\$ 16.452	\$ 22.674	0	(608)	(608)	(0,04)
RYL	07.2021	NZD 22.728	\$ 15.869	0	(13)	(13)	0,00
	08.2021	\$ 15.868	NZD 22.728	13	0	13	0,00
SCX	07.2021	\$ 16.379	\$ 22.674	0	(536)	(536)	(0,03)
				\$ 13	\$ (1.677)	\$ (1.664)	(0,10)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 19.451	SEK 161.471	\$ 0	\$ (571)	\$ (571)	(0,03)
CBK	07.2021	\$ 10.287	\$ 85.269	0	(317)	(317)	(0,02)
GLM	07.2021	SEK 180.037	\$ 21.076	24	0	24	0,00
	07.2021	\$ 19.452	SEK 161.471	0	(571)	(571)	(0,03)
	08.2021	\$ 21.082	\$ 180.037	0	(24)	(24)	0,00
MYI	07.2021	\$ 9.165	\$ 76.202	0	(254)	(254)	(0,02)
SCX	07.2021	\$ 6.984	\$ 59.996	31	0	31	0,00
UAG	07.2021	SEK 182.185	\$ 21.369	66	0	66	0,00
	08.2021	\$ 21.376	SEK 182.185	0	(66)	(66)	0,00
				\$ 121	\$ (1.803)	\$ (1.682)	(0,10)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (21.457) (1,30)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 13.100	\$ (13.228)	(0,80)
2,000 % fällig am 01.08.2051	9.250	(9.322)	(0,57)
3,000 % fällig am 01.08.2051	12.800	(13.335)	(0,81)
3,500 % fällig am 01.07.2035	500	(534)	(0,03)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (36.419)	(2,21)
Summe Anlagen		\$ 1.732.538	105,19
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (85.447)	(5,19)
Nettovermögen		\$ 1.647.091	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
 (b) Nullkuponwertpapier.
 (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
 (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
 (f) Mit dem Fonds verbunden.
 (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (h) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
Morgan Stanley	0,735 %	03.02.2023	30.01.2020	\$ 3.479	\$ 3.720	0,23
Standard Chartered PLC	1,214	23.03.2025	16.03.2021	2.800	2.814	0,17
				\$ 6.279	\$ 6.534	0,40

Barmittel in Höhe von USD 14.662 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 25.210 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.760.612	\$ 0	\$ 1.760.612
Investmentfonds	6.577	0	0	6.577
Pensionsgeschäfte	0	22.400	0	22.400
Finanzderivate ⁽³⁾	618	(21.250)	0	(20.632)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(36.419)	0	(36.419)
Summen	\$ 7.195	\$ 1.725.343	\$ 0	\$ 1.732.538

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.046.272	\$ 6.369	\$ 2.052.641
Investmentfonds	6.629	0	0	6.629
Pensionsgeschäfte	0	50.741	0	50.741
Finanzderivate ⁽³⁾	941	23.452	0	24.393
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(123.927)	0	(123.927)
Summen	\$ 7.570	\$ 1.996.538	\$ 6.369	\$ 2.010.477

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (80)	\$ 0	\$ (80)
BOA	(1.867)	1.910	43
BPS	(5.360)	4.780	(580)
BRC	20	0	20
CBK	(1.698)	1.170	(528)
FAR	13	0	13
FBF	0	0	0
GLM	(2.090)	1.800	(290)
GST	(28)	30	2
HUS	1.226	(1.330)	(104)
JPM	(37)	260	223
MYC	199	10	209
MYI	(5.940)	5.030	(910)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
RBC	\$ (12)	\$ 0	\$ (12)
RYL	(218)	250	32
SCX	5.527	(4.580)	947
SSB	(2.575)	2.120	(455)
TOR	(5.651)	4.930	(721)
UAG	(2.886)	2.580	(306)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	69,61	61,44
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	35,65	72,79
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,63	1,75
Investmentfonds	0,40	0,44
Pensionsgeschäfte	1,36	3,36
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,15	0,06
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,10)	0,17
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,30)	1,38
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,21)	(8,21)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(1,69)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,36)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	36,77	37,85
Kommunalanleihen und Wechsel	0,01	0,35
US-Regierungsbehörden	13,36	43,84
US-Schatzobligationen	5,14	4,41
Non-Agency-MBS	8,40	6,91
Forderungsbesicherte Wertpapiere	9,11	6,65
Staatsemissionen	24,56	24,31
Vorzugswertpapiere	0,01	0,01
Kurzfristige Instrumente	9,53	11,65
Investmentfonds	0,40	0,44
Pensionsgeschäfte	1,36	3,36
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,15	0,06
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps – Basisswaps	0,00	(0,01)
Zinsswaps	(0,10)	0,18
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,02	0,04
Optionen auf Wertpapiere	0,02	0,01
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,05)	(0,02)
Zinsscaps	0,00	0,00
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,00
Cross-Currency Swaps	0,05	0,11
Zinsswaps	0,00	0,02
Devisenterminkontrakte	1,21	(0,95)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,54)	2,19
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,21)	(8,21)
Sonstige Aktiva und Passiva	(5,19)	(33,18)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS					
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								
AUSTRALIEN				AUSTRALIEN				AUSTRALIEN								
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE								
Pepper SPARKZ Trust No.3 1,062 % fällig am 17.08.2028	AUD	1.578	\$ 1.191	0,12	Telos CLO Ltd. 1,460 % fällig am 17.01.2027	\$	419	\$ 419	0,04	Realkredit Danmark A/S 2,000 % fällig am 01.10.2047	\$	0	\$ 0	0,00		
					Tralee CLO Ltd. 1,298 % fällig am 20.10.2028		2.464	2.464	0,24	2,500 % fällig am 01.04.2036		0	0	0,00		
					Venture CLO Ltd. 1,084 % fällig am 15.04.2027		424	423	0,04	2,500 % fällig am 01.04.2047		0	0	0,00		
					1,238 % fällig am 20.07.2030		2.500	2.498	0,25	Summe Dänemark		34.827	3,43			
					WhiteHorse Ltd. 1,120 % fällig am 17.04.2027		53	53	0,01	FINNLAND						
					1,074	0,10	16.939	1,67	STAATSEMISSIONEN							
									FINNLAND							
									STAATSEMISSIONEN							
									Finnvera Oyj 0,625 % fällig am 22.09.2022				€	600	722	0,07
									FRANKREICH							
									UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
									UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
									BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig am 30.06.2027				\$	1.300	1.300	0,13
									CNP Assurances 4,875 % fällig am 07.10.2030				(g)(i)	800	841	0,08
									Danone S.A. 3,000 % fällig am 15.06.2022					1.400	1.436	0,14
									Summe Frankreich						3.577	0,35
									STAATSEMISSIONEN							
									FRANCE							
									Government International Bond							
									0,500 % fällig am 25.05.2072				€	1.300	1.192	0,12
									(k)							
									0,750 % fällig am 25.05.2052				(k)	8.200	9.298	0,92
									2,000 % fällig am 25.05.2048				(k)	11.500	17.568	1,73
									3,250 % fällig am 25.05.2045				(k)	2.200	4.067	0,40
									SNCF Reseau 0,750 % fällig am 25.05.2036					3.100	3.744	0,37
									Summe Frankreich						35.869	3,54
									Summe Frankreich						39.446	3,89
									DEUTSCHLAND							
									UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
									UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
									Deutsche Bank AG 0,050 % fällig am 20.11.2024					4.900	5.860	0,58
									1,000 % fällig am 19.11.2025					1.000	1.211	0,12
									1,375 % fällig am 03.09.2026					3.400	4.181	0,41
									1,375 % fällig am 17.02.2032					1.500	1.807	0,18
									1,625 % fällig am 20.01.2027					3.300	4.118	0,41
									1,750 % fällig am 19.11.2030					1.100	1.380	0,14
									2,625 % fällig am 16.12.2024				£	600	866	0,08
									3,729 % fällig am 14.01.2032							
									(j)				\$	300	306	0,03
									3,961 % fällig am 26.11.2025					2.100	2.272	0,22
									4,250 % fällig am 14.10.2021					3.700	3.740	0,37
									Deutsche Pfandbriefbank AG 3,375 % fällig am 22.11.2021					2.400	2.429	0,24
									IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK) 3,625 % fällig am 15.05.2025				€	1.300	1.568	0,15
									(c)							
									Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 5,000 % fällig am 19.03.2024				AUD	100	84	0,01
									Landwirtschaftliche Rentenbank 4,250 % fällig am 24.01.2023					1.500	1.197	0,12
									5,375 % fällig am 23.04.2024				NZD	1.100	861	0,08
									Summe Deutschland						31.880	3,14
									GUERNSEY, KANALINSELN							
									UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
									UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
									Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,800 % fällig am 15.09.2022				\$	400	416	0,04
									HONGKONG							
									UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
									UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
									Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd. 3,950 % fällig am 05.02.2023					600	620	0,06
									Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 1,697 % fällig am 25.05.2023					600	603	0,06
									Summe Hongkong						1.223	0,12
									INDIEN							
									UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
									UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
									Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,700 % fällig am 27.02.2022					900	912	0,09

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-ERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-ERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-ERMÖGENS
State Bank of India				STAATSEMISSIONEN				NON-AGENCY-MBS			
4,000 % fällig am 24.01.2022	\$	600	0,06	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				Miravet SARL			
Summe Indien		1.522	0,15	0,000 % fällig am 01.04.2026 (d)	€	1.300	0,15	0,307 % fällig am 26.05.2065	€	1.217	0,15
				1,450 % fällig am 15.11.2024		13.100	1,62	Summe Luxemburg		9.991	0,99
				1,500 % fällig am 30.04.2045		900	0,10				
IRLAND				1,850 % fällig am 01.07.2025 (k)		5.600	0,70	MALAYSIA			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				2,150 % fällig am 01.03.2072 (k)		2.200	0,25	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Accunia European CLO DAC				Italy Government International Bond				Petronas Capital Ltd.			
0,750 % fällig am 15.07.2030	€	800	0,09	6,000 % fällig am 04.08.2028	£	100	0,02	2,480 % fällig am 28.01.2032	\$	400	0,04
Armada Euro CLO DAC				Summe Italien		43.130	4,25	3,500 % fällig am 21.04.2030		400	0,04
0,720 % fällig am 15.07.2031		800	0,09					4,550 % fällig am 21.04.2050		300	0,04
Black Diamond CLO DAC								4,800 % fällig am 21.04.2060		300	0,04
0,650 % fällig am 03.10.2029		1.175	0,14							1.612	0,16
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				JAPAN				STAATSEMISSIONEN			
0,700 % fällig am 15.01.2031		1.500	0,17	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Malaysia Government International Bond			
Dryden Euro CLO BV				Central Nippon Expressway Co. Ltd.				3,502 % fällig am 31.05.2027	MYR	2.900	0,07
0,860 % fällig am 15.05.2034 (b)		1.200	0,14	0,616 % fällig am 15.02.2022	\$	1.400	0,14	3,906 % fällig am 15.07.2026		4.400	0,11
Griffith Park CLO DAC				1,125 % fällig am 11.09.2024		200	0,02	Malaysia Government Investment Issue			
0,720 % fällig am 21.11.2031		1.000	0,12	2,567 % fällig am 02.11.2021		2.200	0,22	4,130 % fällig am 09.07.2029		1.200	0,03
Harvest CLO DAC				Mizuho Financial Group, Inc.				4,369 % fällig am 31.10.2028		2.100	0,06
0,630 % fällig am 18.11.2029		1.251	0,15	3,922 % fällig am 11.09.2024		1.500	0,15			2.696	0,27
0,760 % fällig am 15.07.2031		2.100	0,25	Nissan Motor Co. Ltd.				Summe Malaysia		4.308	0,43
0,960 % fällig am 20.10.2031		1.000	0,12	3,522 % fällig am 17.09.2025		200	0,02				
Laurelin DAC				4,345 % fällig am 17.09.2027		200	0,02	MEXIKO			
0,720 % fällig am 20.10.2031		2.100	0,24	4,810 % fällig am 17.09.2030		1.000	0,11	STAATSEMISSIONEN			
OAK Hill European Credit Partners DAC				ORIX Corp.				Mexico Government International Bond			
0,740 % fällig am 20.10.2031		2.200	0,26	3,250 % fällig am 04.12.2024		400	0,04	4,000 % fällig am 15.03.2115	€	400	0,05
Palmer Square European Loan Funding DAC				Sumitomo Mitsui Banking Corp.							
1,150 % fällig am 15.01.2030		1.287	0,15	0,409 % fällig am 14.09.2021	€	1.800	0,21	MULTINATIONAL			
Segovia European CLO DAC				2,014 % fällig am 07.11.2022	\$	6.000	0,61	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
0,880 % fällig am 20.07.2032 (b)		2.000	0,23	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				Preferred Term Securities Ltd.			
Sorrento Park CLO DAC				0,010 % fällig am 15.10.2027	€	2.000	0,23	0,525 % fällig am 23.06.2035	\$	1.267	0,12
0,409 % fällig am 16.11.2027		115	0,01			19.082	1,88			1.175	0,12
Toro European CLO DAC				STAATSEMISSIONEN				NIEDERLANDE			
0,650 % fällig am 15.04.2030		2.300	0,27	Development Bank of Japan, Inc.				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
0,900 % fällig am 15.10.2030		2.447	0,29	1,875 % fällig am 02.10.2024	\$	1.200	0,12	Cairn CLO BV			
Summe Irland		27.610	2,72	1,750 % fällig am 17.10.2024		400	0,04	0,600 % fällig am 30.04.2031	€	1.600	0,18
				Japan Bank for International Cooperation				0,780 % fällig am 15.10.2031		850	0,10
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Japan Finance Organization for Municipalities				Dryden Euro CLO BV			
AIB Group PLC				3,375 % fällig am 27.09.2023		1.800	0,19	0,660 % fällig am 15.04.2033		1.200	0,14
4,750 % fällig am 12.10.2023	\$	400	0,04	Japan Government International Bond				Jubilee CLO BV			
PartnerRe Ireland Finance DAC				0,100 % fällig am 10.03.2028 (f)	¥	776.884	7,182	0,252 % fällig am 15.12.2029		493	0,06
1,250 % fällig am 15.09.2026	€	1.100	0,14	0,500 % fällig am 20.09.2046		721.000	6,375	0,295 % fällig am 12.07.2028		1.344	0,16
Summe Irland		29.416	2,90	0,500 % fällig am 20.03.2049		1.506.000	13,075	0,600 % fällig am 15.04.2030		1.200	0,14
				1,400 % fällig am 20.09.2034		3.220.000	33,582	0,650 % fällig am 15.04.2031		800	0,09
ISRAEL				Tokyo Metropolitan Government						8.862	0,87
STAATSEMISSIONEN				0,750 % fällig am 16.07.2025	\$	800	0,08	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Israel Government International Bond				2,500 % fällig am 08.06.2022		4.500	4,583	Enel Finance International NV			
0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS	43.800	1,33	2,625 % fällig am 29.05.2024		400	0,04	2,650 % fällig am 10.09.2024	\$	1.100	0,11
0,750 % fällig am 31.07.2022		6.400	0,19					3,625 % fällig am 25.05.2027		300	0,03
2,000 % fällig am 31.03.2027		7.600	0,25	JERSEY, KANALINSELN				ING Groep NV			
3,800 % fällig am 13.05.2060	\$	2.500	0,28	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,750 % fällig am 16.11.2026	(g)(l)	1.100	0,12
4,125 % fällig am 17.01.2048		700	0,08	AA Bond Co. Ltd.				LeasePlan Corp. NV			
5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS	6.100	0,19	2,750 % fällig am 31.07.2043	£	200	0,03	0,125 % fällig am 13.09.2023	€	2.300	0,27
Summe Israel		23.569	2,32			281	0,03	Stichting AK Rabobank Certificaten			
				LUXEMBURG				2,188 % (g)		371	0,06
ITALIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Volkswagen Financial Services NV			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Aroundtown S.A.				1,125 % fällig am 18.09.2023	£	200	0,03
AMCO - Asset Management Co. SpA				0,000 % fällig am 16.07.2026 (d)	€	800	0,09	1,875 % fällig am 07.09.2021		800	0,11
1,500 % fällig am 17.07.2023	€	2.000	0,24	0,375 % fällig am 23.09.2022		1.300	1,551	Volkswagen International Finance NV			
Atlantia SpA				2,000 % fällig am 02.11.2026		700	0,09	1,009 % fällig am 16.11.2024	€	2.800	0,34
1,875 % fällig am 12.02.2028		600	0,07	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL				1,125 % fällig am 02.10.2023		1.800	0,22
Banca Carige SpA				2,200 % fällig am 24.07.2025		700	0,09			13.076	1,29
0,957 % fällig am 25.05.2022		1.100	0,13	CPI Property Group S.A.				NON-AGENCY-MBS			
1,161 % fällig am 25.10.2021		1.000	0,12	2,750 % fällig am 12.05.2026		2.100	2,714	Jubilee Place BV			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				Logicor Financing SARL				0,463 % fällig am 17.10.2057		1.834	0,22
0,875 % fällig am 08.10.2027		200	0,03	1,500 % fällig am 14.11.2022		1.300	1,570	Summe Niederlande		24.139	2,38
2,000 % fällig am 29.01.2024		2.200	0,27				8.543				
2,625 % fällig am 28.04.2025		100	0,01								
4,000 % fällig am 10.07.2022 (k)		700	0,08								
UniCredit SpA											
7,500 % fällig am 03.06.2026 (g)(l)		1.000	0,14								
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$	2.800	0,32								
Summe Italien		14.314	1,41								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS			
NEUSEELAND				SINGAPUR				SUPRANATIONAL						
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
New Zealand Government International Bond				BOC Aviation Ltd.				Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung						
1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD	1.300	887	0,09	2.750 % fällig am 18.09.2022	\$	200	204	0,02	0,500 % fällig am 21.12.2023	AUD	3.100	2.320	0,23
					3,500 % fällig am 18.09.2027		500	533	0,05	Europäische Investitionsbank				
NORWEGEN				SLOWENIEN				SCHWEIZ						
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Norway Government International Bond				DBS Bank Ltd.				0,500 % fällig am 21.07.2023						
1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK	6.300	752	0,07	3,300 % fällig am 27.11.2021		900	911	0,09	Europäische Union				
					Summe Singapur			1.648	0,16	0,000 % fällig am 06.07.2026				
PERU				SÜDKOREA				VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Banco de Credito del Peru				Slovenia Government International Bond				3,625 % fällig am 09.09.2024						
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	2.400	648	0,06	5,250 % fällig am 18.02.2024	\$	1.748	1.965	0,19	6,500 % fällig am 08.08.2023				
					Summe Slowenien			3.124	0,31	(i)				
PORTUGAL				SÜDAFRIKA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Banco Espirito Santo S.A.				South Africa Government International Bond				3,750 % fällig am 25.07.2023						
4,000 % fällig am 21.01.2019	€	400	76	0,01	4,850 % fällig am 30.09.2029	€	700	744	0,07	Credit Suisse Group AG				
4,750 % fällig am 15.01.2018	€	700	133	0,01	Summe Südafrika			21.975	2,17	1,319 % fällig am 14.12.2023				
Summe Portugal			209	0,02						3,800 % fällig am 09.06.2023				
KATAR				SPANIEN				VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
STAATSEMISSIONEN				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Qatar Government International Bond				BBVA Consumer Auto				5,125 % fällig am 15.05.2024	(i)					
3,750 % fällig am 16.04.2030	\$	800	907	0,09	0,270 % fällig am 20.07.2031	€	1.459	1.736	0,17	7,625 % fällig am 17.08.2022	(i)			
4,000 % fällig am 14.03.2029			3.700	4,266	0,22					Summe Schweiz				
4,500 % fällig am 23.04.2028			1.900	2.246	0,22					15.312	1,51			
Summe Katar			7.419	0,73										
RUMÄNIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Romania Government International Bond				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				1,134 % fällig am 16.04.2022						
1,375 % fällig am 02.12.2029	€	700	830	0,08	5,875 % fällig am 24.09.2023			1.000	1,284	0,13	First Abu Dhabi Bank PJSC			
2,000 % fällig am 14.04.2033			700	825	0,08						1,134 % fällig am 16.04.2022			
2,625 % fällig am 02.12.2040			600	707	0,07						Summe Vereinigte Arabische Emirate			
Summe Rumänien			2.362	0,23							2.302	0,23		
RUSSLAND				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN						
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Russia Government International Bond				Banco Santander S.A.				Emirate of Abu Dhabi Government International Bond						
1,125 % fällig am 20.11.2027			900	1.063	0,10			3,125 % fällig am 16.04.2030						
7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB	120.600	1.719	0,17	0,875 % fällig am 22.07.2025			3,875 % fällig am 16.04.2050						
Summe Russland			2.782	0,27	1,125 % fällig am 11.03.2027			200	218	0,02				
SAUDI-ARABIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				GROSSBRITANNIEN						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE						
Saudi Arabian Oil Co.				Banco Santander S.A.				Bumper UK Finance PLC						
3,250 % fällig am 24.11.2050	\$	500	487	0,05	1,750 % fällig am 24.10.2023			0,650 % fällig am 20.12.2028	£	853	1.180	0,12		
3,500 % fällig am 24.11.2070			900	876	0,09			Summe Großbritannien						
Summe Saudi-Arabien			1.363	0,14				7,625 % fällig am 21.11.2022						
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Saudi Government International Bond				CaixaBank S.A.				Barclays Bank PLC						
4,000 % fällig am 17.04.2025			6.100	6.746	0,66			7,625 % fällig am 21.11.2022						
4,375 % fällig am 16.04.2029			600	696	0,07			(i)						
Summe Saudi-Arabien			7.442	0,73				Barclays PLC						
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Saudi Government International Bond				IE2 Holdco S.A.U.				2,375 % fällig am 06.10.2023	£	1.800	2.542	0,25		
4,000 % fällig am 17.04.2025			6.100	6.746	0,66			4,375 % fällig am 12.01.2026	\$	200	224	0,02		
4,375 % fällig am 16.04.2029			600	696	0,07			4,610 % fällig am 15.02.2023		2.300	2.359	0,23		
Summe Saudi-Arabien			8.805	0,87				4,836 % fällig am 09.05.2028		1.500	1.687	0,17		
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Saudi Government International Bond				Merlin Properties Socimi S.A.				7,125 % fällig am 15.06.2025						
4,000 % fällig am 17.04.2025			6.100	6.746	0,66			8,000 % fällig am 15.06.2024	£	300	475	0,05		
4,375 % fällig am 16.04.2029			600	696	0,07			(g)(i)						
Summe Saudi-Arabien			8.805	0,87				2,200		2.504	0,25			
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Saudi Government International Bond				FCE Bank PLC				0,869 % fällig am 13.09.2021	€	600	712	0,07		
4,000 % fällig am 17.04.2025			6.100	6.746	0,66			1,615 % fällig am 11.05.2023		400	484	0,05		
4,375 % fällig am 16.04.2029			600	696	0,07									
Summe Saudi-Arabien			8.805	0,87										

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS		
Frontier Finance PLC				1,054 % fällig am 12.06.2046			0,18	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust					
8,000 % fällig am 23.03.2022	£	525	\$ 742	0,07	Stratton Mortgage Funding PLC	1.334	1.853	0,152 % fällig am 25.12.2036 ^	\$	15	\$ 5	0,00	
HSBC Holdings PLC				0,948 % fällig am 20.07.2060	£	3.452	\$ 4.788	SLC Student Loan Trust					
1,155 % fällig am 18.05.2024	\$	1.000	1.014	0,10	0,949 % fällig am 12.03.2052	1.711	2.374	1,022 % fällig am 25.11.2042		803	807	0,08	
3,803 % fällig am 11.03.2025		1.700	1.829	0,18	Towd Point Mortgage Funding PLC			Soundview Home Loan Trust					
3,950 % fällig am 18.05.2024		400	425	0,04	0,949 % fällig am 20.07.2045	3.537	4.903	0,497 % fällig am 25.12.2036		3.000	2.944	0,29	
4,583 % fällig am 19.06.2029		1.300	1.503	0,15	1,111 % fällig am 20.10.2051	1.939	2.693	0,592 % fällig am 25.11.2036		2.700	2.615	0,26	
4,750 % fällig am 04.07.2029 (g)(i)	£	500	672	0,07	Trinity Square PLC			0,797 % fällig am 25.11.2035		618	619	0,06	
Lloyds Bank PLC				0,899 % fällig am 15.07.2059	1.700	2.353	0,23	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust					
4,875 % fällig am 30.03.2027	£	1.100	1.868	0,18	Uropa Securities PLC			1,592 % fällig am 25.04.2035		63	64	0,01	
Lloyds Banking Group PLC				0,284 % fällig am 10.06.2059	294	397	0,04	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust					
3,900 % fällig am 12.03.2024	\$	1.100	1.193	0,12	0,434 % fällig am 10.06.2059	76	101	0,437 % fällig am 25.01.2037		2.600	2.517	0,25	
4,582 % fällig am 10.12.2025		900	1.012	0,10	0,634 % fällig am 10.06.2059	60	80						
7,625 % fällig am 27.06.2023 (g)(i)	£	800	1.212	0,12	0,834 % fällig am 10.06.2059	63	85						
7,875 % fällig am 27.06.2029 (g)(i)		200	353	0,03			49,018	4,83					
Marks & Spencer PLC								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
4,250 % fällig am 08.12.2023		600	882	0,09	AKTIEN			AbbVie, Inc.					
Nationwide Building Society					VORZUGSWERTPAPIERE			1,500 % fällig am 15.11.2023	€	100	123	0,01	
3,766 % fällig am 08.03.2024	\$	4.300	4.517	0,45	Nationwide Building Society			American Tower Corp.					
5,875 % fällig am 20.12.2024 (g)(i)	£	500	762	0,08	10,250 %	2.470	642	2,950 % fällig am 15.01.2025	\$	1.400	1.490	0,15	
NatWest Group PLC								3,800 % fällig am 15.08.2029		800	892	0,09	
1,626 % fällig am 15.05.2023	\$	2.200	2.224	0,22				AT&T, Inc.					
Natwest Group PLC								2,875 % fällig am 02.03.2025 (g)	€	1.200	1.452	0,14	
1,697 % fällig am 25.06.2024		1.800	1.842	0,18				3,100 % fällig am 01.02.2043	\$	500	491	0,05	
2,000 % fällig am 04.03.2025	€	1.200	1.497	0,15				3,300 % fällig am 01.02.2052		500	488	0,05	
2,500 % fällig am 22.03.2023		2.100	2.603	0,26				Bayer U.S. Finance LLC					
3,498 % fällig am 15.05.2023	\$	1.900	1.950	0,19	United Kingdom Gilt	£	1.100	1,291	1,129 % fällig am 15.12.2023		900	913	0,09
3,875 % fällig am 12.09.2023		500	534	0,05	0,625 % fällig am 22.10.2050			3,875 % fällig am 15.12.2023		500	536	0,05	
4,519 % fällig am 25.06.2024		1.600	1.719	0,17	1,750 % fällig am 22.01.2049	2.200	3.404	0,42	4,375 % fällig am 15.12.2028		900	1.032	0,10
6,000 % fällig am 29.12.2025 (g)(i)		1.300	1.452	0,14	3,250 % fällig am 22.01.2044	2.200	4.254						
8,000 % fällig am 10.08.2025 (g)(i)		200	237	0,02	4,250 % fällig am 07.12.2040	1.700	3.607						
8,625 % fällig am 15.08.2021 (g)(i)		1.100	1.110	0,11			12,556	1,24	Boeing Co.				
NatWest Markets PLC								1,167 % fällig am 04.02.2023		300	301	0,03	
1,000 % fällig am 28.05.2024	€	1.000	1.224	0,12				1,433 % fällig am 15.01.2024		1.300	1.304	0,13	
Santander UK Group Holdings PLC								1,950 % fällig am 01.02.2024		100	102	0,01	
1,089 % fällig am 15.03.2025	\$	300	301	0,03				2,750 % fällig am 01.02.2026		2.100	2.195	0,22	
3,373 % fällig am 05.01.2024		3.900	4.060	0,40				3,250 % fällig am 01.02.2028		400	425	0,04	
4,796 % fällig am 15.11.2024		1.700	1.860	0,18				Broadcom, Inc.					
7,375 % fällig am 24.06.2022 (g)(i)	£	473	691	0,07	USA			2,450 % fällig am 15.02.2031		600	590	0,06	
Standard Chartered PLC					FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			2,600 % fällig am 15.02.2033		300	294	0,03	
2,678 % fällig am 29.06.2032	\$	2.700	2.715	0,27	Amortizing Residential Collateral Trust			4,150 % fällig am 15.11.2030		500	561	0,06	
Tesco Property Finance PLC					0,792 % fällig am 25.10.2031	\$	2	2	0,00	CenterPoint Energy Resources Corp.			
5,744 % fällig am 13.04.2040	£	902	1.673	0,16	Asset-Backed Funding Certificates Trust			3,550 % fällig am 01.04.2023		300	315	0,03	
			65,162	6,43	0,792 % fällig am 25.06.2034	112	111	0,01	Charles Schwab Corp.				
					Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			0,750 % fällig am 18.03.2024		300	302	0,03	
					0,202 % fällig am 25.04.2031	3	16	0,00	Charter Communications Operating LLC				
					0,707 % fällig am 25.02.2036	4.290	4.754	0,47	4,464 % fällig am 23.07.2022		700	725	0,07
					1,092 % fällig am 25.10.2037	101	101	0,01	5,125 % fällig am 01.07.2049		700	835	0,08
					Citigroup Mortgage Loan Trust				Dell International LLC				
					0,252 % fällig am 25.12.2036	2.153	1.454	0,14	5,450 % fällig am 15.06.2023		300	326	0,03
					Countrywide Asset-Backed Certificates				Discover Bank				
					0,232 % fällig am 25.06.2037	1.629	1.544	0,15	3,350 % fällig am 06.02.2023		500	521	0,05
					0,232 % fällig am 25.07.2037	484	459	0,05	Equifax, Inc.				
					0,432 % fällig am 25.12.2036 ^	12	10	0,00	1,026 % fällig am 15.08.2021		400	400	0,04
					Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				Equitable Holdings, Inc.				
					0,712 % fällig am 25.01.2032	3	3	0,00	3,900 % fällig am 20.04.2023		65	69	0,01
					Fieldstone Mortgage Investment Trust				Ford Motor Credit Co. LLC				
					0,772 % fällig am 25.02.2036	938	935	0,09	0,000 % fällig am 01.12.2021	€	650	770	0,08
					Home Equity Mortgage Trust				0,000 % fällig am 07.12.2022		200	236	0,02
					6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	269	143	0,01	2,748 % fällig am 14.06.2024	£	600	842	0,08
					Long Beach Mortgage Loan Trust				2,900 % fällig am 16.02.2028	\$	100	100	0,01
					0,392 % fällig am 25.05.2036	1.332	912	0,09	3,096 % fällig am 04.05.2023		300	306	0,03
					Massachusetts Educational Financing Authority				3,375 % fällig am 13.11.2025		400	415	0,04
					1,126 % fällig am 25.04.2038	146	146	0,02	4,000 % fällig am 13.11.2030		300	315	0,03
					MASTR Asset-Backed Securities Trust				4,375 % fällig am 06.08.2023		600	634	0,06
					0,332 % fällig am 25.10.2036	2.075	1.960	0,19	General Motors Financial Co., Inc.				
					Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0,012 % fällig am 26.03.2022	€	100	119	0,01
					0,212 % fällig am 25.02.2037	3.342	1.435	0,14	Goldman Sachs Group, Inc.				
					0,252 % fällig am 25.09.2037	7	4	0,00	0,013 % fällig am 21.04.2023		1.600	1.902	0,19
					Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				0,250 % fällig am 26.01.2028		1.000	1.166	0,12
					0,192 % fällig am 25.11.2036	1.336	977	0,10	1,375 % fällig am 15.05.2024		1.400	1.704	0,17
					0,342 % fällig am 25.07.2036	130	116	0,01	International Flavors & Fragrances, Inc.				
					New Century Home Equity Loan Trust				0,697 % fällig am 15.09.2022	\$	1.400	1.401	0,14
					3,689 % fällig am 20.06.2031	316	314	0,03	JetBlue Pass-Through Trust				
					Option One Mortgage Loan Trust				4,000 % fällig am 15.05.2034		967	1.070	0,11
					0,232 % fällig am 25.01.2037	680	511	0,05	Kilroy Realty LP				
					0,232 % fällig am 25.02.2037	2.531	1.942	0,19	3,450 % fällig am 15.12.2024		200	214	0,02
					Residential Asset Mortgage Products Trust				Lehman Brothers Holdings, Inc.				
					0,652 % fällig am 25.06.2032	3	3	0,00	0,000 % fällig am 31.12.2049 ^		700	5	0,00
					Residential Asset Securities Corp. Trust				5,625 % fällig am 24.01.2049 ^		600	5	0,00
					0,752 % fällig am 25.11.2035	284	283	0,03					

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
6,200 % fällig am 26.09.2020 ^	\$ 1.400	\$ 11	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust	\$ 343	\$ 340	0,03	0,892 % fällig am 25.10.2045	\$ 84	\$ 73	0,01
7,875 % fällig am 08.05.2018 ^	£ 1.800	39	0,01	3,234 % fällig am 25.09.2037 ^				1,402 % fällig am 25.11.2037	938	897	0,09
Morgan Stanley				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				6,000 % fällig am 25.06.2036	501	481	0,05
0,735 % fällig am 03.02.2023 (j)	CAD 6.300	5.095	0,50	2,210 % fällig am 25.09.2035	33	35	0,00	Residential Asset Securitization Trust			
1,875 % fällig am 30.03.2023	€ 1.100	1.354	0,13	3,343 % fällig am 25.08.2035 ^	521	530	0,05	6,600 % fällig am 25.05.2036	569	342	0,03
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through				Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
1,950 % fällig am 01.09.2022	\$ 200	204	0,02	Certificates				3,148 % fällig am 25.09.2035 ^	46	35	0,00
ONEOK, Inc.				2,351 % fällig am 25.09.2035 ^	429	412	0,04	6,500 % fällig am 25.03.2032	0	0	0,00
4,550 % fällig am 15.07.2028	300	343	0,03	CitiMortgage Alternative Loan Trust				Sequoia Mortgage Trust			
Oracle Corp.				0,692 % fällig am 25.02.2037	2.696	2.302	0,23	0,793 % fällig am 20.07.2033	25	25	0,00
2,300 % fällig am 25.03.2028 (j)	2.400	2.464	0,24	Countrywide Alternative Loan Trust				2,947 % fällig am 20.07.2037	729	670	0,07
2,875 % fällig am 25.03.2031 (j)	600	625	0,06	0,273 % fällig am 20.02.2047 ^	987	774	0,08	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
3,950 % fällig am 25.03.2051 (j)	100	109	0,01	0,442 % fällig am 25.05.2037 ^	78	26	0,00	2,386 % fällig am 25.04.2034	31	32	0,00
4,100 % fällig am 25.03.2061 (j)	700	778	0,08	0,513 % fällig am 20.07.2046 ^	249	198	0,02	2,537 % fällig am 25.02.2034	19	19	0,00
Organon Finance LLC				1,616 % fällig am 25.11.2035	75	70	0,01	3,123 % fällig am 25.09.2034	0	0	0,00
4,125 % fällig am 30.04.2028	400	408	0,04	1,632 % fällig am 25.11.2035	166	153	0,02	Structured Asset Mortgage Investments Trust			
5,125 % fällig am 30.04.2031	500	516	0,05	2,156 % fällig am 25.11.2035	30	29	0,00	0,252 % fällig am 25.01.2037	1.545	1.495	0,15
Pacific Gas & Electric Co.				2,166 % fällig am 20.10.2035	1.418	1.143	0,11	0,472 % fällig am 25.07.2046 ^	424	370	0,04
2,100 % fällig am 01.08.2027	100	97	0,01	3,051 % fällig am 25.02.2037 ^	167	167	0,02	0,512 % fällig am 25.05.2036	223	196	0,02
2,950 % fällig am 01.03.2026 ^	100	102	0,01	5,250 % fällig am 25.06.2035 ^	25	24	0,00	0,532 % fällig am 25.05.2036	780	763	0,08
3,150 % fällig am 01.01.2026	100	103	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2037	2.223	1.519	0,15	0,612 % fällig am 25.05.2046 ^	0	0	0,00
3,450 % fällig am 01.07.2025	100	105	0,01	6,250 % fällig am 25.08.2037 ^	64	49	0,01	0,673 % fällig am 19.07.2034	9	9	0,00
3,950 % fällig am 01.12.2047	100	93	0,01	6,500 % fällig am 25.06.2036 ^	179	135	0,01	0,793 % fällig am 19.03.2034	4	4	0,00
4,250 % fällig am 15.03.2046 ^	300	287	0,03	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Structured Asset Securities Corp.			
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	100	96	0,01	0,552 % fällig am 25.05.2035	26	23	0,00	0,372 % fällig am 25.01.2036	189	177	0,02
4,550 % fällig am 01.07.2030	200	214	0,02	0,732 % fällig am 25.03.2035	130	119	0,01	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
Penske Truck Leasing Co. LP				0,752 % fällig am 25.02.2035	67	67	0,01	0,382 % fällig am 25.10.2036	571	514	0,05
3,950 % fällig am 10.03.2025	1.500	1.642	0,16	0,852 % fällig am 25.09.2034	8	8	0,00	Thornburg Mortgage Securities Trust			
Santander Holdings USA, Inc.				2,800 % fällig am 25.11.2034	6	7	0,00	1,494 % fällig am 25.06.2047 ^	125	113	0,01
3,400 % fällig am 18.01.2023	900	937	0,09	2,958 % fällig am 25.08.2034 ^	3	3	0,00	Wachovia Mortgage Loan Trust			
Southern California Edison Co.				2,992 % fällig am 25.08.2034 ^	4	4	0,00	0,452 % fällig am 25.01.2037	1.859	994	0,10
0,690 % fällig am 03.04.2023	200	201	0,02	6,000 % fällig am 25.02.2037	1.203	887	0,09	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
0,700 % fällig am 03.04.2023	500	500	0,05	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				0,712 % fällig am 25.01.2045	27	27	0,00
0,880 % fällig am 01.04.2024	500	502	0,05	0,432 % fällig am 25.06.2035	167	161	0,02	1,116 % fällig am 25.02.2046	271	274	0,03
Southwest Airlines Co.				Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				1,593 % fällig am 27.02.2034	11	11	0,00
5,250 % fällig am 04.05.2025	600	685	0,07	0,332 % fällig am 25.08.2036 ^	548	532	0,05	2,409 % fällig am 25.03.2034	2	2	0,00
Sprint Spectrum Co. LLC				Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				2,858 % fällig am 25.06.2037 ^	137	135	0,01
4,738 % fällig am 20.03.2025	469	504	0,05	0,192 % fällig am 25.10.2036 ^	5	4	0,00	2,924 % fällig am 25.05.2037 ^	503	500	0,05
Walt Disney Co.				Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				3,082 % fällig am 25.09.2036	193	186	0,02
3,500 % fällig am 13.05.2040	800	893	0,09	0,613 % fällig am 19.08.2045	62	61	0,01	3,143 % fällig am 25.02.2037 ^	1.135	1.138	0,11
3,600 % fällig am 13.01.2051	900	1.023	0,10	0,733 % fällig am 19.07.2045 ^	5	1	0,00	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
WEA Finance LLC				First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				1,056 % fällig am 25.07.2046 ^	90	63	0,01
3,750 % fällig am 17.09.2024	600	642	0,06	2,861 % fällig am 25.08.2035	18	14	0,00				
Wells Fargo & Co.				GreenPoint Mortgage Funding Trust							
1,741 % fällig am 04.05.2030	€ 300	384	0,04	0,632 % fällig am 25.11.2045	17	16	0,00				
Zimmer Biomet Holdings, Inc.				GS Mortgage Securities Corp. Trust							
3,550 % fällig am 01.04.2025	\$ 200	217	0,02	2,081 % fällig am 10.11.2045 (a)	2.397	42	0,00	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
		49.059	4,84	GSR Mortgage Loan Trust				Fannie Mae			
				1,840 % fällig am 25.03.2033	17	17	0,00	0,212 % fällig am 25.03.2034	6	6	0,00
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				HarborView Mortgage Loan Trust				0,222 % fällig am 25.03.2036	5	5	0,00
CenturyLink, Inc.				0,966 % fällig am 19.12.2036 ^	156	152	0,02	0,242 % fällig am 25.08.2034	9	9	0,00
2,354 % fällig am 15.03.2027	836	826	0,08	2,116 % fällig am 19.10.2035	469	333	0,03	0,492 % fällig am 25.06.2036	32	32	0,00
NON-AGENCY-MBS				Impac CMB Trust				0,592 % fällig am 25.10.2040	59	60	0,01
Adjustable Rate Mortgage Trust				1,092 % fällig am 25.07.2033	2	2	0,00	2,944 % fällig am 25.07.2039	723	774	0,08
2,712 % fällig am 25.09.2035 ^	20	19	0,00	IndyMac Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 25.04.2043 - 25.07.2044	116	134	0,01
American Home Mortgage Assets Trust				2,868 % fällig am 25.03.2036	688	654	0,06	Freddie Mac			
0,472 % fällig am 25.05.2046 ^	276	248	0,02	2,880 % fällig am 25.12.2034	12	13	0,00	0,460 % fällig am 15.01.2038	469	470	0,05
1,056 % fällig am 25.10.2046	1.044	854	0,08	JPMorgan Alternative Loan Trust				0,673 % fällig am 15.12.2037 - 15.07.2040	205	208	0,02
Banc of America Funding Trust				0,572 % fällig am 25.10.2036	359	357	0,04	1,092 % fällig am 25.05.2043	23	24	0,00
0,413 % fällig am 20.02.2047	1.084	1.044	0,10	5,500 % fällig am 25.11.2036 ^	2	1	0,00	1,316 % fällig am 25.10.2044	181	186	0,02
3,173 % fällig am 20.10.2046 ^	120	103	0,01	JPMorgan Mortgage Trust				1,328 % fällig am 25.02.2045	67	68	0,01
3,348 % fällig am 20.01.2047 ^	57	55	0,01	1,923 % fällig am 25.11.2033	5	6	0,00	1,992 % fällig am 15.01.2038 (a)	469	30	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				2,662 % fällig am 25.02.2036 ^	118	98	0,01	2,364 % fällig am 01.09.2035	4	4	0,00
2,485 % fällig am 25.08.2033	6	6	0,00	2,949 % fällig am 27.07.2037	257	254	0,03	Ginnie Mae			
2,518 % fällig am 25.10.2033	10	10	0,00	MASTR Alternative Loan Trust				2,125 % fällig am 20.11.2022	1	1	0,00
2,865 % fällig am 25.05.2034	21	20	0,00	0,492 % fällig am 25.03.2036 ^	88	5	0,00	3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047	82	84	0,01
3,156 % fällig am 25.05.2047 ^	197	196	0,02	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				Uniform Mortgage-Backed Security			
Bear Stearns ALT-A Trust				0,513 % fällig am 15.12.2030	19	19	0,00	1,328 % fällig am 01.09.2044	53	55	0,01
3,008 % fällig am 25.09.2035 ^	313	245	0,02	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				1,766 % fällig am 01.10.2034	4	4	0,00
3,089 % fällig am 25.11.2036 ^	459	309	0,03	0,202 % fällig am 25.03.2037	6.854	2.632	0,26	1,800 % fällig am 01.12.2034	14	15	0,00
3,133 % fällig am 25.11.2035 ^	154	134	0,01	Residential Accredited Loans, Inc. Trust				2,500 % fällig am 01.11.2050 - 01.02.2051	13.644	14.156	1,39
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				0,242 % fällig am 25.02.2047	191	98	0,01	2,581 % fällig am 01.11.2034	67	71	0,01
2,986 % fällig am 26.12.2046 ^	507	446	0,04	0,392 % fällig am 25.06.2037 ^	442	405	0,04	3,000 % fällig am 01.04.2043 - 01.03.2060	4.780	5.123	0,51
Chase Mortgage Finance Trust				0,412 % fällig am 25.03.2047	1.008	969	0,10	3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.01.2059	5.382	5.787	0,57
3,059 % fällig am 25.07.2037	58	55	0,01	0,452 % fällig am 25.07.2036 ^	1.278	684	0,07				
				0,452 % fällig am 25.06.2046	844	274	0,03				

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000 %	20.06.2026	\$ 12.000	\$ 25	0,00

ZINSSWAPS - BASISWAPS

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
3-Month USD-LIBOR ⁽⁴⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	07.03.2024	\$ 7.400	\$ 1	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,071 %	12.06.2022	7.700	(2)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,084 %	12.06.2022	16.100	(7)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,085 %	19.06.2022	24.700	(8)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,091 %	18.03.2022	363.000	(130)	(0,01)
3-Month USD-LIBOR ⁽⁴⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,102 %	04.10.2024	15.000	(2)	0,00
				\$ (148)	(0,01)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,250 %	15.09.2023	£ 15.900	\$ (19)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	10.700	(18)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	10.700	74	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	1.300	(86)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2023	¥ 2.430.000	(7)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,850	03.01.2022	BRL 26.900	13	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022	65.200	31	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,860	03.01.2022	33.700	16	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	18.800	9	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,871	03.01.2022	27.700	13	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,883	03.01.2022	29.500	14	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,300	03.01.2022	381.500	(157)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,345	03.01.2022	7.600	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,350	03.01.2022	180.600	(78)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	56.000	22	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,700	03.01.2022	107.400	(45)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 6.900	(5)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,270	03.03.2022	6.600	8	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2022	2.300	(3)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	6.000	(16)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	22.400	146	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	16.06.2051	700	9	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029	2.100	18	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	26.100	175	0,02
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,200	18.12.2049	700	35	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD 650	(2)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK 56.200	(5)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,250	30.03.2023	\$ 40.200	6	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,250	16.06.2023	14.200	15	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,400	30.03.2026	13.400	6	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,400	15.01.2028	45.500	278	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	23.570	(27)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	1.200	1	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	4.400	16	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	30.03.2031	37.755	(722)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	38.660	(575)	(0,06)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025	25.800	(59)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	31.300	(511)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,120	02.02.2031	2.400	(50)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,150	30.03.2051	9.200	(596)	(0,06)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,160	02.02.2031	2.900	(61)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,249	31.08.2024	11.650	32	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	09.06.2041	4.200	(195)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050	700	(44)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	100	6	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	9.100	569	0,06
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,298	25.08.2024	10.200	28	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,305	21.08.2023	12.550	(29)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,325	02.12.2050	1.700	(106)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,460	02.02.2051	3.000	205	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	4.200	(49)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,620	27.01.2052	700	(48)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,665	27.10.2051	700	(47)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,720	15.10.2031	4.200	(85)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,935	22.06.2051	1.300	(37)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,940	15.06.2051	1.400	(42)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,950	31.08.2051	1.050	(74)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,968	23.06.2051	1.400	(51)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Erhalt Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	1,990 %	31.08.2051	\$	1.200	(85)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.01.2030		19.100	(380)	(0,04)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.12.2051		900	(9)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	2,010	17.09.2051		1.150	(81)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	2,090	23.12.2051		1.300	(94)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	2,100	25.08.2051		2.200	(159)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028		17.500	(88)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	18.12.2029		1.800	(20)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2026		2.600	8	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	20.06.2023	ZAR	16.700	(9)	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD	5.100	(58)	(0,01)
Zahlung	6-Month CHF-LIBOR	0,500	16.09.2025	CHF	33.300	(9)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK	24.300	5	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€	77.400	(43)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2036		1.400	(29)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050		450	(16)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,060	17.11.2032		3.000	48	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052		1.000	(40)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	27.01.2032		1.900	(26)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,205	27.01.2032		900	(12)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026		82.100	(155)	(0,02)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035		1.300	(26)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2023		16.900	9	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051		11.600	(309)	(0,03)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	20.03.2024	HUF	342.600	(5)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,000	17.03.2031	¥	1.270.000	38	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,400	19.06.2039		640.000	(47)	0,00
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,500	10.03.2026	NOK	82.000	(11)	0,00
Zahlung	6-Month NOK-NIBOR	1,900	10.03.2031		42.800	84	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN	86.100	(32)	0,00
Erhalt	UKRPI	3,000	15.11.2050	£	800	(7)	0,00
Erhalt	UKRPI	3,051	15.11.2050		700	(7)	0,00
Erhalt	UKRPI	3,143	15.11.2050		500	(6)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,217	15.11.2040		1.940	11	0,00
Zahlung	UKRPI	3,272	15.11.2040		700	4	0,00
Zahlung	UKRPI	3,273	15.11.2040		990	6	0,00
Zahlung	UKRPI	3,340	15.11.2040		1.220	7	0,00
Erhalt	UKRPI	3,397	15.11.2030		1.140	1	0,00
Erhalt	UKRPI	3,445	15.11.2030		990	1	0,00
Erhalt	UKRPI	3,510	15.11.2030		720	1	0,00
Zahlung	UKRPI	3,700	15.04.2031		3.100	(4)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,740	15.03.2031		1.800	(3)	0,00
						\$ (3.654)	(0,36)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (4.124)	(0,41)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,016 %	15.07.2021	4.000	\$ 60	\$ 6	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,016	06.08.2021	3.900	56	12	0,00
CBK	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,004	25.01.2022	11.100	147	74	0,01
GLM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,004	25.01.2022	12.300	156	83	0,01
							\$ 419	\$ 175	0,02

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	1.600	\$ 121	\$ 238	0,02
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	700	4	0	0,00
					\$ 125	\$ 238	0,02

VERKAUFSoPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.08.2021	1.400	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.400	(1)	0	0,00
BPS	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	400	(3)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	1.700	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	3.700	(5)	(4)	0,00
BRC	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	1.500	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.500	(2)	(1)	0,00
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	2.300	(1)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.300	(3)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	2.100	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.300	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	7.800	(11)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	4.300	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	2.000	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	2.000	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	2.600	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	2.300	(2)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	8.500	(9)	(5)	0,00
CBK	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	800	(4)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	900	(1)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	1.000	(1)	0	0,00
DUB	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	1.900	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.900	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	4.800	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	2.200	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.500	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.900	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	4.200	(5)	(4)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	15.09.2021	300	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	20.10.2021	800	(5)	(4)	0,00
	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	300	0	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.700	(2)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	1.400	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	3.000	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.200	(1)	0	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	2.400	(3)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.400	(1)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.500	(2)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	2.900	(3)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	2.700	(3)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	3.300	(4)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.300	(2)	0	0,00
JPM	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	5.100	(6)	(3)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	2.300	(3)	(1)	0,00
MYC	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	300	(1)	0	0,00
					\$ (129)	\$ (46)	0,00	

DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call – OTC USD versus CAD	CAD 1,265	11.02.2022	4.830	\$ (48)	\$ (60)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,880 %	15.09.2021	29.100	\$ (145)	\$ 0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	15.07.2021	4.000	(27)	(11)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	15.07.2021	4.000	(33)	(1)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	06.08.2021	3.900	(26)	(28)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	06.08.2021	3.900	(30)	(3)	0,00
BPS	Put – OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	1.600	(121)	(230)	(0,02)
BRC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,000	07.02.2022	9.500	(12)	(2)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	07.02.2022	9.500	(12)	(26)	0,00
	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,448	23.08.2021	24.100	(213)	0	0,00
DUB	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,020	21.12.2021	12.800	(58)	(1)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FBF	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,399 %	26.08.2021	27.500	\$ (244)	\$ 0	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,000	07.02.2022	9.500	(13)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	07.02.2022	9.500	(13)	(26)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	13.07.2021	1.100	(5)	(8)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	13.07.2021	1.100	(5)	0	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	25.01.2022	4.800	(128)	(61)	(0,01)
MYC	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	21.12.2021	19.500	(90)	(2)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	500	(4)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	15.07.2021	1.400	(3)	(3)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	15.07.2021	1.400	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	25.01.2022	4.900	(73)	(63)	(0,01)
RYL	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,000	07.02.2022	49.700	(64)	(8)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,000	07.02.2022	49.700	(64)	(136)	(0,02)
							\$ (1.386)	\$ (611)	(0,06)

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,000 %	07.10.2022	16.750	\$ (17)	\$ (2)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,000	08.10.2022	9.000	(9)	(2)	0,00
						\$ (26)	\$ (4)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

⁽²⁾ Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Japan Government International Bond	(1,000) %	20.06.2022	\$ 500	(17)	\$ 12	\$ (5)	0,00
BPS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	1.900	(68)	49	(19)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	3.100	(76)	19	(57)	(0,01)
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.600	(31)	2	(29)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	2.600	(91)	66	(25)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	4.400	(111)	30	(81)	(0,01)
CBK	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	3.400	(120)	87	(33)	0,00
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.900	(56)	4	(52)	(0,01)
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	3.300	(115)	83	(32)	0,00
HUS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.500	(38)	10	(28)	0,00
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.100	(50)	11	(39)	(0,01)
					\$ (773)	\$ 373	\$ (400)	(0,04)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 1.500	(37)	\$ 61	\$ 24	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.000	(24)	40	16	0,00
MYC	Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2021	€ 800	6	(2)	4	0,00
					\$ (55)	\$ 99	\$ 44	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 5.900	\$ 4.445	\$ 29	\$ (61)	\$ (32)	0,00

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	AUD 7.100	\$ 4.899	\$ (2)	\$ 454	\$ 452	0,04
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029		7.000	(14)	461	447	0,04
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030		2.000	1.437	51	60	0,01
						\$ 22	\$ 905	\$ 927	0,09

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
GST	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 22.700	20.12.2021	\$ 12	\$ (902)	\$ (890)	(0,09)

TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
CIB	Zahlung	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	k. A.	0,050 %	CAD 5.600	05.08.2021	\$ 0	\$ 326	\$ 326	0,03

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	DKK 80.753	\$ 12.851	\$ 0	\$ (28)	\$ (28)	0,00	
	07.2021	¥ 387.100	3.499	11	0	11	0,00	
	07.2021	MXN 1.354	69	1	0	1	0,00	
	07.2021	NOK 34.398	4.012	15	0	15	0,00	
	07.2021	\$ 4.906	AUD 6.513	0	(16)	(16)	0,00	
	07.2021	1.386	CAD 1.707	0	(7)	(7)	0,00	
	07.2021	1.027	£ 739	0	(6)	(6)	0,00	
	08.2021	AUD 5.090	\$ 3.833	11	0	11	0,00	
	08.2021	\$ 4.013	NOK 34.398	0	(15)	(15)	0,00	
	08.2021	161	RUB 12.137	4	0	4	0,00	
	09.2021	CNY 142.056	\$ 22.086	213	0	213	0,02	
	09.2021	\$ 13	PLN 51	0	0	0	0,00	
	09.2021	320	RUB 23.322	0	(4)	(4)	0,00	
	11.2021	RON 69	\$ 17	0	0	0	0,00	
	07.2021	AUD 21.199	16.474	559	0	559	0,05	
	BPS	07.2021	DKK 17.345	2.788	22	0	22	0,00
		07.2021	€ 1.691	2.020	15	0	15	0,00
07.2021		NZD 2.528	1.835	68	0	68	0,01	
07.2021		\$ 926	€ 779	0	(3)	(3)	0,00	
07.2021		103	MXN 2.036	0	(1)	(1)	0,00	
07.2021		41	RUB 3.067	1	0	1	0,00	
08.2021		2.231	MXN 47.585	149	0	149	0,01	
09.2021		MYR 11.579	\$ 2.784	4	0	4	0,00	
09.2021		\$ 574	KRW 642.228	0	(6)	(6)	0,00	
11.2021		ILS 3.699	\$ 1.129	0	(8)	(8)	0,00	
11.2021		MXN 2.330	115	0	0	0	0,00	
BRC	07.2021	CHF 412	459	13	0	13	0,00	
	09.2021	\$ 9	PLN 33	0	0	0	0,00	
CBK	07.2021	DKK 62.614	\$ 9.930	0	(55)	(55)	(0,01)	
	07.2021	MXN 1.018	49	0	(2)	(2)	0,00	
	07.2021	PEN 17.996	4.891	188	0	188	0,02	
	07.2021	\$ 1.081	DKK 6.800	3	0	3	0,00	
	07.2021	4.118	NOK 34.398	0	(121)	(121)	(0,01)	
	07.2021	2.144	PEN 8.535	85	0	85	0,01	
	07.2021	115	RUB 8.897	6	0	6	0,00	
	08.2021	PEN 8.535	\$ 2.146	0	(88)	(88)	(0,01)	
	08.2021	\$ 147	RUB 11.065	3	0	3	0,00	
	10.2021	PEN 5.948	\$ 1.546	0	(10)	(10)	0,00	
	11.2021	ILS 53.112	16.286	14	(62)	(48)	0,00	
	02.2022	23.105	7.125	22	(12)	10	0,00	
	06.2022	4.696	1.450	0	0	0	0,00	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
GLM	08.2022	ILS 6.492	\$ 1.964	\$ 0	\$ (42)	\$ (42)	0,00
	07.2021	£ 55.143	\$ 77.957	1.781	0	1.781	0,18
	07.2021	\$ 231	RUB 17.834	12	0	12	0,00
	08.2021	HUF 12.205	\$ 41	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 206	RUB 15.457	4	0	4	0,00
	09.2021	14	PLN 53	0	0	0	0,00
	09.2021	406	RUB 29.772	0	(3)	(3)	0,00
	11.2021	661	PEN 2.479	0	(13)	(13)	0,00
	02.2022	CAD 1.127	\$ 934	24	0	24	0,00
	07.2021	€ 2.621	\$ 3.163	54	0	54	0,01
HUS	07.2021	\$ 75.354	£ 54.404	0	(199)	(199)	(0,02)
	08.2021	£ 50.379	\$ 69.734	132	0	132	0,01
	08.2021	\$ 332	RUB 24.969	8	0	8	0,00
	09.2021	CNH 790.590	\$ 122.930	1.172	0	1.172	0,12
	09.2021	KRW 16.405.435	14.725	210	0	210	0,02
	09.2021	PEN 9.149	2.476	81	0	81	0,01
	09.2021	\$ 16	PLN 61	0	0	0	0,00
	09.2021	168	RUB 12.279	0	(1)	(1)	0,00
	10.2021	PEN 961	\$ 255	4	0	4	0,00
	11.2021	ILS 3.793	1.169	3	0	3	0,00
JPM	12.2021	PEN 7.254	1.961	64	0	64	0,01
	01.2022	ILS 6.438	1.994	12	0	12	0,00
	07.2021	DKK 69.806	11.072	0	(60)	(60)	(0,01)
	07.2021	PEN 3.824	1.038	39	0	39	0,00
	07.2021	\$ 10.791	DKK 67.117	0	(88)	(88)	(0,01)
	09.2021	2.689	IDR 38.752.223	0	(47)	(47)	0,00
	10.2021	DKK 60.087	\$ 9.662	63	0	63	0,01
	07.2021	€ 43	52	0	0	0	0,00
	07.2021	¥ 2.932.347	26.937	517	0	517	0,05
	07.2021	\$ 2.850	AUD 3.768	0	(21)	(21)	0,00
MYI	07.2021	\$ 11.440	DKK 71.232	0	(80)	(80)	(0,01)
	07.2021	114	RUB 8.755	5	0	5	0,00
	08.2021	AUD 3.768	\$ 2.850	21	0	21	0,00
	10.2021	DKK 71.232	11.460	80	0	80	0,01
	07.2021	€ 148.187	181.284	5.551	0	5.551	0,55
	07.2021	¥ 5.679.606	51.930	758	0	758	0,07
	07.2021	\$ 494	€ 406	0	(12)	(12)	0,00
	07.2021	\$ 13.615	DKK 84.778	0	(95)	(95)	(0,01)
	07.2021	131	RUB 10.162	8	0	8	0,00
	08.2021	184	13.876	5	0	5	0,00
SCX	10.2021	DKK 84.778	\$ 13.638	95	0	95	0,01
	07.2021	CAD 11.085	9.175	223	0	223	0,02
	07.2021	AUD 7.345	5.694	179	0	179	0,02
	07.2021	MXN 1.464	71	0	(3)	(3)	0,00
	07.2021	\$ 13.854	AUD 18.263	0	(142)	(142)	(0,01)
	07.2021	81.292	¥ 8.999.053	0	(213)	(213)	(0,02)
	07.2021	375	RUB 28.789	18	0	18	0,00
	08.2021	AUD 18.263	\$ 13.855	142	0	142	0,01
	08.2021	¥ 8.999.053	81.314	212	0	212	0,02
	09.2021	\$ 165	RUB 12.131	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 12.884	\$ (1.464)	\$ 11.420	1,13

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 44	€ 37	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2021	€ 1.115	\$ 1.358	35	0	35	0,00
	07.2021	\$ 33.006	€ 27.168	0	(787)	(787)	(0,08)
CBK	07.2021	24.444	20.168	0	(527)	(527)	(0,05)
HUS	07.2021	236	198	0	(1)	(1)	0,00
MYI	07.2021	31	26	0	0	0	0,00
RYL	07.2021	24.444	20.168	0	(527)	(527)	(0,05)
SCX	07.2021	9.966	8.146	0	(305)	(305)	(0,03)
TOR	07.2021	9.966	8.146	0	(305)	(305)	(0,03)
				\$ 35	\$ (2.452)	\$ (2.417)	(0,24)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
GLM	07.2021	\$ 98	£ 69	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
HUS	07.2021	£ 73	\$ 101	0	0	0	0,00
SCX	08.2021	\$ 101	£ 73	0	0	0	0,00
	07.2021	98	69	0	(3)	(3)	0,00
SSB	07.2021	£ 73	\$ 100	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
UAG	08.2021	\$ 100	£ 73	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2021	98	69	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Class E USD (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2021	HKD 122	\$ 16	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00		
	07.2021	SGD 355	264	0	0	0	0,00		
	07.2021	\$ 161	CZK 3.350	0	(5)	(5)	0,00		
	07.2021	405	MXN 8.080	1	0	1	0,00		
	08.2021	16	HKD 122	0	0	0	0,00		
	08.2021	264	SGD 355	0	0	0	0,00		
BPS	07.2021	CNY 66.230	\$ 10.236	0	(16)	(16)	0,00		
	07.2021	MXN 8.080	399	0	(7)	(7)	0,00		
	07.2021	\$ 1.654	AUD 2.129	0	(56)	(56)	(0,01)		
	07.2021	526	IDR 7.547.309	0	(7)	(7)	0,00		
	07.2021	20.027	¥ 2.190.287	0	(293)	(293)	(0,03)		
	07.2021	226	NZD 312	0	(8)	(8)	0,00		
	07.2021	268	SGD 355	0	(4)	(4)	0,00		
	08.2021	10.211	CNY 66.230	19	0	19	0,00		
	08.2021	397	MXN 8.080	7	0	7	0,00		
	07.2021	757	CHF 680	0	(21)	(21)	0,00		
BRC	07.2021	73	PEN 278	0	0	0	0,00		
	07.2021	671	SEK 5.562	0	(21)	(21)	0,00		
CBK	07.2021	CLP 38.151	\$ 52	0	(1)	(1)	0,00		
	07.2021	CZK 3.350	157	1	0	1	0,00		
	07.2021	\$ 571	AUD 738	0	(17)	(17)	0,00		
	07.2021	203	ILS 660	0	(1)	(1)	0,00		
	07.2021	62	¥ 6.857	0	(1)	(1)	0,00		
	08.2021	52	CLP 38.151	1	0	1	0,00		
GLM	08.2021	157	CZK 3.350	0	(1)	(1)	0,00		
	07.2021	HUF 36.630	\$ 124	0	0	0	0,00		
	07.2021	KRW 1.942.858	1.718	0	(4)	(4)	0,00		
	07.2021	MYR 2.063	495	0	(2)	(2)	0,00		
	07.2021	THB 14.396	450	1	0	1	0,00		
	07.2021	\$ 52	CLP 38.151	0	0	0	0,00		
	07.2021	7.504	£ 5.308	0	(171)	(171)	(0,02)		
	07.2021	88	¥ 9.666	0	(1)	(1)	0,00		
	07.2021	460	THB 14.396	0	(10)	(10)	0,00		
	07.2021	18	TWD 503	0	0	0	0,00		
	08.2021	TWD 503	\$ 18	0	0	0	0,00		
	08.2021	\$ 124	HUF 36.630	0	0	0	0,00		
	08.2021	1.717	KRW 1.942.858	2	0	2	0,00		
	08.2021	495	MYR 2.063	1	0	1	0,00		
HUS	08.2021	450	THB 14.396	0	(1)	(1)	0,00		
	07.2021	£ 5.308	\$ 7.347	14	0	14	0,00		
	07.2021	IDR 7.547.309	520	1	0	1	0,00		
	07.2021	ILS 651	200	0	0	0	0,00		
	07.2021	RUB 17.555	242	2	0	2	0,00		
	07.2021	\$ 108	€ 91	0	0	0	0,00		
	07.2021	16	HKD 122	0	0	0	0,00		
	07.2021	236	RUB 17.394	2	0	2	0,00		
	08.2021	7.348	£ 5.308	0	(14)	(14)	0,00		
	08.2021	518	IDR 7.547.309	0	(1)	(1)	0,00		
	08.2021	200	ILS 651	0	0	0	0,00		
	08.2021	241	RUB 17.555	0	(2)	(2)	0,00		
MYI	07.2021	PLN 1.141	\$ 301	1	0	1	0,00		
	07.2021	\$ 128	HUF 36.630	0	(4)	(4)	0,00		
	07.2021	499	MYR 2.063	0	(2)	(2)	0,00		
	07.2021	140	NOK 1.158	0	(6)	(6)	0,00		
	07.2021	311	PLN 1.141	0	(11)	(11)	0,00		
	08.2021	301	1.141	0	(1)	(1)	0,00		
SCX	07.2021	PEN 278	\$ 70	0	(2)	(2)	0,00		
	07.2021	TWD 503	18	0	0	0	0,00		
	07.2021	\$ 10.381	CNY 66.230	0	(130)	(130)	(0,01)		
	07.2021	252	DKK 1.554	0	(4)	(4)	0,00		
	07.2021	30.695	€ 25.091	0	(940)	(940)	(0,09)		
	08.2021	70	PEN 278	3	0	3	0,00		
TOR	07.2021	4.394	CAD 5.309	0	(107)	(107)	(0,01)		
	07.2021	5.274	€ 4.311	0	(162)	(162)	(0,02)		
UAG	07.2021	AUD 1.930	\$ 1.464	15	0	15	0,00		
	07.2021	\$ 1.737	KRW 1.942.858	0	(16)	(16)	0,00		
	07.2021	2	RUB 173	0	0	0	0,00		
	08.2021	1.464	AUD 1.930	0	(15)	(15)	0,00		
						\$ 71	\$ (2.065)	\$ (1.994)	(0,19)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 6.701	0,66		

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
2,000 % fällig am 01.08.2051	\$	37.350	\$ (37.642)	(3,71)
2,500 % fällig am 01.07.2051		3.700	(3.827)	(0,38)
2,500 % fällig am 01.08.2051		16.700	(17.242)	(1,70)
3,000 % fällig am 01.08.2051		10.600	(11.043)	(1,09)
3,500 % fällig am 01.08.2051		8.000	(8.426)	(0,83)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere			\$ (78.180)	(7,71)
Summe Anlagen			\$ 1.095.236	108,00
Sonstige Aktiva und Passiva			\$ (81.174)	(8,00)
Nettovermögen			\$ 1.014.062	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(h) Mit dem Fonds verbunden.

(i) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(j) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	3,729 %	14.01.2032	22.01.2021	\$ 301	\$ 306	0,03
Morgan Stanley	0,735	03.02.2023	30.01.2020	4.764	5.095	0,50
Oracle Corp.	2,300	25.03.2028	22.03.2021	2.394	2.464	0,24
Oracle Corp.	2,875	25.03.2031	22.03.2021	599	625	0,06
Oracle Corp.	3,950	25.03.2051	22.03.2021	100	109	0,01
Oracle Corp.	4,100	25.03.2061	22.03.2021	699	778	0,08
				\$ 8.857	\$ 9.377	0,92

(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 85.722 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 940 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 13.605 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 2.920 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.110.631	\$ 0	\$ 1.110.631
Investmentfonds	59.123	0	0	59.123
Finanzderivate ⁽³⁾	303	3.359	0	3.662
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(78.180)	0	(78.180)
Summen	\$ 59.426	\$ 1.035.810	\$ 0	\$ 1.095.236

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.444.783	\$ 4.878	\$ 1.449.661
Investmentfonds	5.862	0	0	5.862
Pensionsgeschäfte	0	1.069	0	1.069
Finanzderivate ⁽³⁾	527	(7.501)	(2)	(6.976)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(101.358)	0	(101.358)
Summen	\$ 6.389	\$ 1.336.993	\$ 4.876	\$ 1.348.258

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	0,050 %	17.06.2021	19.07.2021	\$ (2.208)	\$ (2.208)	(0,22)
BPS	(0,580)	20.05.2021	19.08.2021	€ (25.238)	(29.909)	(2,95)
	(0,550)	20.05.2021	19.08.2021	(11.670)	(13.830)	(1,36)
	(0,520)	20.05.2021	19.08.2021	(5.770)	(6.838)	(0,67)
	(0,500)	20.05.2021	19.08.2021	(1.667)	(1.976)	(0,20)
BRC	(4,000)	30.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(741)	(879)	(0,09)
GRE	0,040	19.05.2021	19.07.2021	\$ (17.974)	(17.975)	(1,77)
	0,040	02.06.2021	14.07.2021	(4.159)	(4.159)	(0,41)
	0,050	14.06.2021	26.07.2021	(2.681)	(2.681)	(0,26)
	0,050	16.06.2021	28.07.2021	(4.015)	(4.016)	(0,40)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (84.471)	(8,33)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (32)	\$ 0	\$ (32)
BOA	145	0	145
BPS	(389)	300	(89)
BRC	(184)	170	(14)
CBK	(110)	300	190
CIB	326	(550)	(224)
DUB	(10)	(20)	(30)
FBF	(7)	0	(7)
GLM	1.992	(1.260)	732
GST	(978)	850	(128)
HUS	1.513	(1.680)	(167)
JPM	(136)	260	124
MYC	(9)	(470)	(479)
MYI	499	(330)	169
RYL	(671)	500	(171)
SCX	4.916	(4.160)	756
SOG	13	0	13
TOR	(351)	260	(91)
UAG	174	0	174

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	75,98	87,41
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	32,62	66,94
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,92	1,53
Investmentfonds	5,83	0,63
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,11	0,06
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,41)	(0,21)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,66	(0,59)
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,71)	(10,90)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(8,33)	(15,63)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,81)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Argentinien	k. A.	0,00
Australien	2,55	3,30
Brasilien	0,15	0,41
Kanada	1,84	1,99
Cayman Inseln	4,10	4,76
China	13,53	11,46
Dänemark	3,43	4,52
Finnland	0,07	0,08
Frankreich	3,89	5,01
Deutschland	3,14	3,04
Guernsey, Kanalinseln	0,04	0,05
Hongkong	0,12	0,24
Indien	0,15	0,16
Irland	2,90	1,81
Israel	2,32	0,66
Italien	4,25	5,50
Japan	10,73	13,37
Jersey, Kanalinseln	0,03	0,03
Luxemburg	0,99	1,12
Malaysia	0,43	0,75
Mexiko	0,05	0,06
Multinational	0,12	0,12
Niederlande	2,38	2,77
Neuseeland	0,09	0,19
Norwegen	0,07	0,50
Panama	k. A.	0,03
Peru	1,10	1,44
Portugal	0,02	0,02
Katar	0,73	1,09
Rumänien	0,23	0,18
Russland	0,27	0,32
Saudi-Arabien	0,87	0,96
Singapur	0,16	0,31
Slowenien	0,31	0,34
Südafrika	0,07	0,08
Südkorea	2,17	2,52
Spanien	3,95	5,82
Supranational	1,07	0,67
Schweiz	1,51	1,56
Vereinigte Arabische Emirate	0,23	0,43
Großbritannien	12,68	15,63
USA	25,65	62,58
Kurzfristige Instrumente	1,13	k. A.
Investmentfonds	5,83	0,63
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,11	0,06
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,04)	(0,08)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes- Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps — Basisswaps	(0,01)	(0,02)
Zinsswaps	(0,36)	(0,12)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	0,02	0,06
Optionen auf Wertpapiere	0,02	0,01
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Devisenoptionen	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,06)	(0,02)
Zinsscaps	0,00	0,00
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,04)	(0,06)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,09	0,16
Total Return Swaps auf Indizes	(0,09)	(0,02)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	0,03	0,04
Devisenterminkontrakte	1,13	(0,94)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,43)	0,21
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,71)	(10,90)
Sonstige Aktiva und Passiva	(8,00)	(44,98)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								BESCHREIBUNG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
BANKEN UND FINANZEN								2.500 % fällig am 01.09.2051				
Aircastle Ltd.				BRF GmbH	2.300	2.426	0,30		100	103	0,01	
2,850 % fällig am 26.01.2028	\$	2.400	\$ 2.413	0,30							1.679	0,21
Aviation Capital Group LLC		600	679	0,09	US-SCHATZobligationen							
5,500 % fällig am 15.12.2024				Caesars Entertainment, Inc.	400	424	0,05	U.S. Treasury Bonds				
Avolon Holdings Funding Ltd.		200	216	0,03	1,375 % fällig am 15.11.2040							
5,125 % fällig am 01.10.2023				Caesars Resort Collection LLC	400	422	0,05	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (g)				
Bank of America Corp.		650	745	0,09	0,125 % fällig am 15.07.2030							
5,875 % fällig am 15.03.2028 (h)				DAE Funding LLC	600	610	0,08	0,125 % fällig am 15.01.2031				
Barclays PLC		1.200	1.366	0,17	20.024							
8,000 % fällig am 15.06.2024 (h)(j)				Delta Air Lines, Inc.	1.250	1.273	0,16	2.51				
Credit Suisse Group AG		1.300	1.378	0,17	NON-AGENCY-MBS							
5,250 % fällig am 11.02.2027 (h)(j)				Energy Transfer LP	2.100	2.283	0,29	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
DAE Sukuk Dific Ltd.		700	743	0,09	2,910 % fällig am 25.07.2036 ^							
3,750 % fällig am 15.02.2026				Expedia Group, Inc.	138	161	0,02	3,129 % fällig am 25.02.2036 ^				
Deutsche Bank AG		4.800	4.852	0,61	Countrywide Alternative Loan Trust							
4,250 % fällig am 14.10.2021				Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	2.900	3.246	0,41	6,000 % fällig am 25.04.2037				
Ford Motor Credit Co. LLC		200	208	0,03	6,000 % fällig am 25.02.2037 ^							
3,375 % fällig am 13.11.2025		200	213	0,03	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust							
4,063 % fällig am 01.11.2024		1.100	1.213	0,15	6,000 % fällig am 25.02.2037 ^							
5,125 % fällig am 16.06.2025		400	439	0,06	Hawksmoor Mortgages PLC							
5,584 % fällig am 18.03.2024				Hilton Domestic Operating Co., Inc.	700	708	0,09	1,099 % fällig am 25.05.2053				
Globalworth Real Estate Investments Ltd.		3.200	4.084	0,51	IndyMac Mortgage Loan Trust							
3,000 % fällig am 29.03.2025	€			NCL Corp. Ltd.	2.300	2.349	0,29	0,652 % fällig am 25.07.2035				
ING Groep NV		1.300	1.361	0,17	Towd Point Mortgage Funding PLC							
4,875 % fällig am 16.05.2029 (h)(j)	\$			Nissan Motor Co. Ltd.	1.100	1.281	0,16	1,111 % fällig am 20.10.2051				
Jyske Realkredit A/S		32.679	5.021	0,63	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK			RCS & RDS S.A.	2.100	2.373	0,30	0,752 % fällig am 25.01.2045				
Kaisa Group Holdings Ltd.		650	615	0,08	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
9,375 % fällig am 30.06.2024		1.100	1.088	0,14	6,000 % fällig am 25.07.2036							
9,750 % fällig am 28.09.2023		250	236	0,03	11.627							
11,700 % fällig am 11.11.2025				Reynolds Group Issuer, Inc.	1.200	1.193	0,15	1,46				
KWG Group Holdings Ltd.		1.300	1.311	0,17	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE							
5,875 % fällig am 10.11.2024				Rolls-Royce PLC	1.000	1.516	0,19	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
MGM Growth Properties Operating Partnership LP		800	814	0,10	1,892 % fällig am 25.06.2034							
3,875 % fällig am 15.02.2029				Royal Caribbean Cruises Ltd.	40	44	0,01	Argent Securities Trust				
Natwest Group PLC		1.000	1.023	0,13	0,392 % fällig am 25.07.2036							
1,697 % fällig am 25.06.2024		700	752	0,09	0,412 % fällig am 25.05.2036							
4,519 % fällig am 25.06.2024				United Airlines Pass-Through Trust	287	286	0,04	Babson Euro CLO BV				
New Metro Global Ltd.		1.300	1.311	0,16	0,281 % fällig am 25.10.2029							
4,800 % fällig am 15.12.2024		800	816	0,10	Cairn CLO BV							
6,500 % fällig am 20.05.2022				United Airlines, Inc.	200	207	0,03	0,650 % fällig am 20.10.2028				
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab		26.113	4.017	0,50	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC							
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK			Univision Communications, Inc.	400	434	0,05	0,730 % fällig am 21.09.2029				
Nykredit Realkredit A/S		44.052	6.769	0,84	Catamaran CLO Ltd.							
1,000 % fällig am 01.10.2050		1.300	1.380	0,17	1,444 % fällig am 22.04.2030							
Societe Generale S.A.		1.300	1.380	0,17	CIT Mortgage Loan Trust							
5,375 % fällig am 18.11.2030 (h)(j)	\$			VMware, Inc.	200	222	0,03	1,442 % fällig am 25.10.2037				
Starwood Property Trust, Inc.		400	419	0,05	Countrywide Asset-Backed Certificates							
5,500 % fällig am 01.11.2023				Wynn Las Vegas LLC	400	431	0,05	0,322 % fällig am 25.05.2037				
Sunac China Holdings Ltd.		800	830	0,10	11.500							
8,350 % fällig am 19.04.2023				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		42.527	5,33	10.944				
UniCredit Spa		350	355	0,05	Dryden Senior Loan Fund							
2,569 % fällig am 22.09.2026		1.000	1.409	0,18	1,084 % fällig am 15.10.2027							
7,500 % fällig am 03.06.2026 (h)(j)	€			Metropolitan Edison Co.	100	112	0,01	First Franklin Mortgage Loan Trust				
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$	5.650	6.550	0,82	0,797 % fällig am 25.11.2036							
Ursa Re Ltd.		1.150	1.195	0,15	2.200							
3,791 % fällig am 07.12.2027				Midwest Connector Capital Co. LLC	3.400	3.558	0,45	7.327				
Yango Justice International Ltd.		1.300	1.256	0,16	0,242 % fällig am 25.10.2036							
7,500 % fällig am 15.04.2024				Pacific Gas & Electric Co.	1.100	1.033	0,13	Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.				
				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		4.703	0,59	1,108 % fällig am 20.04.2027				
						104.307	13,07	Harvest CLO DAC				
								0,630 % fällig am 18.11.2029				
								Home Equity Asset Trust				
								0,542 % fällig am 25.02.2036				
								JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
								0,302 % fällig am 25.10.2036				
								Jubilee CLO BV				
								0,252 % fällig am 15.12.2029				
								Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust				
								7,170 % fällig am 15.04.2040 ^				
								Long Beach Mortgage Loan Trust				
								0,692 % fällig am 25.01.2036				
								Man GLG Euro CLO DAC				
								0,870 % fällig am 15.01.2030				
								Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
								0,222 % fällig am 25.10.2036				
								0,232 % fällig am 25.10.2036				
								Residential Asset Securities Corp. Trust				
								0,342 % fällig am 25.11.2036 ^				
								3.658				
								3.554				
								0,45				
								57.077				
								7,15				
								INDUSTRIEWERTE				
								Alaska Airlines Pass-Through Trust				
								4,800 % fällig am 15.02.2029				
								American Airlines Pass-Through Trust				
								3,350 % fällig am 15.04.2031				
								3,575 % fällig am 15.07.2029				
								3,700 % fällig am 01.04.2028				
								American Airlines, Inc.				
								5,750 % fällig am 20.04.2029				
								Berry Global, Inc.				
								4,875 % fällig am 15.07.2026				

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Long	09.2021	68	\$ (21)	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	11	(2)	0,00
CAC 40 Index July Futures	Short	07.2021	1	1	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	67	91	0,01
DAX Index September Futures	Long	09.2021	20	(74)	(0,01)
E-mini NASDAQ 100 Index September Futures	Long	09.2021	100	875	0,11
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2021	1.481	4.514	0,57
Euro STOXX 50 September Futures	Long	09.2021	231	(168)	(0,02)
Euro STOXX 600 September Futures	Long	09.2021	2.444	(779)	(0,10)
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2021	87	(8)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	60	107	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	324	224	0,03
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	46	33	0,00
FTSE 100 Index September Futures	Long	09.2021	31	(44)	(0,01)
FTSE/MIB Index September Futures	Long	09.2021	1	(4)	0,00
Hang Seng China Enterprises Index July Futures	Long	07.2021	6	(4)	0,00
IBEX 35 Index July Futures	Long	07.2021	1	(5)	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	27	62	0,01
Mini MSCI Emerging Markets Index September Futures	Long	09.2021	994	(160)	(0,02)
Nikkei 225 Yen-Denominated September Futures	Long	09.2021	184	(277)	(0,04)
OMX Stockholm 30 Index July Futures	Short	07.2021	1	0	0,00
S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures	Long	09.2021	76	127	0,02
SPI 200 Index September Futures	Long	09.2021	184	(229)	(0,03)
Swiss Market September Futures	Short	09.2021	1	(1)	0,00
Topix Index September Futures	Long	09.2021	169	(253)	(0,03)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2021	166	58	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2021	472	99	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	515	206	0,03
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	122	552	0,07
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2021	39	13	0,00
				\$ 4.933	0,62

OPTIONSKAUF

OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put – CBOE S&P 500	\$ 4.100,000	16.07.2021	56	\$ 558	\$ 40	0,01

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put – CBOE S&P 500	\$ 3.875,000	16.07.2021	56	\$ (298)	\$ (14)	(0,01)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ 4.959 0,62

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 35 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2026	€ 100	\$ (2)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000 %	20.06.2026	\$ 100	\$ 2	0,00
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	11.700	21	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	70.400	190	0,02
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	€ 1.500	2	0,00
				\$ 215	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,030 %	20.01.2026	£ 28.200	\$ 755	0,09
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,080	20.01.2023	14.900	16	0,00
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,120	20.01.2031	15.100	118	0,02
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,250	20.01.2051	700	(88)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,260	15.09.2026	INR 320.000	(26)	0,00
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,270	17.03.2026	667.600	(98)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,850	02.01.2025	BRL 11.600	95	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,350	02.01.2025	31.000	139	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,390	02.01.2025	11.600	25	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,095	02.01.2025	42.200	(50)	(0,01)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	0,550	20.01.2023	CAD 48.300	39	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	0,800	20.01.2026	64.000	(441)	(0,06)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,130	20.01.2031	28.300	870	0,11
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,530	20.01.2051	1.900	(52)	(0,01)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,655	16.12.2025	CNY 56.200	25	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,660	17.03.2026	16.600	3	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,800	16.06.2026	37.500	(3)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,980	17.03.2026	8.100	2	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,000	16.06.2026	22.500	4	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,955	12.11.2025	COP 15.428.000	(326)	(0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,475	19.02.2026	12.792.600	(218)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,765	20.05.2026	32.139.000	(94)	(0,01)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,728	04.06.2026	ILS 6.500	(6)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	0,939	16.12.2025	KRW 14.825.300	(28)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,268	17.03.2031	2.741.200	9	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,299	17.03.2026	2.585.400	(5)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,336	17.03.2031	1.600.000	5	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,240	20.01.2023	\$ 141.000	1	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,440	20.01.2026	78.900	177	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,830	20.01.2031	37.200	(555)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,220	20.01.2051	22.300	(361)	(0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025	9.000	252	0,03
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,900	12.11.2025	ZAR 30.900	(8)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,970	30.09.2025	52.000	(99)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,625	11.12.2025	CLP 4.297.200	(417)	(0,05)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,625	26.01.2026	9.414.100	899	0,11
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,660	26.01.2031	4.970.075	(810)	(0,10)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	0,555	06.11.2025	CZK 122.500	7	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	0,665	22.09.2025	516.800	339	0,04
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,070	20.01.2051	€ 11.600	1.025	0,14
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,280	20.01.2031	19.600	(603)	(0,08)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,480	20.01.2026	26.800	(20)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,540	20.01.2023	6.100	3	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,105	06.11.2025	HUF 665.500	(12)	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,410	02.10.2025	9.095.100	966	0,12
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	1,500	20.12.2044	¥ 690.000	(472)	(0,06)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,585	22.09.2025	PLN 2.500	21	0,00
Zahlung	6-Month SGD-SOR	1,100	16.06.2026	SGD 33.500	(106)	(0,01)
Zahlung	6-Month SGD-SOR	1,200	16.06.2026	3.800	(4)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	4,925	03.11.2025	MXN 64.900	(168)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,510	17.06.2026	108.700	(17)	0,00
					\$ 708	0,10
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 921	0,12

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

(2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

DEIVENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put – OTC USD versus MXN	MXN 19,700	14.06.2022	8.300	\$ 144	\$ 125	0,01
	Put – OTC USD versus RUB	RUB 71,000	03.12.2021	8.300	106	78	0,01
MYI	Put – OTC USD versus BRL	BRL 5,000	03.12.2021	8.300	397	237	0,03
					\$ 647	\$ 440	0,05

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500 %	24.08.2021	111.000	\$ 4.395	\$ 0	0,00
MYC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	24.08.2021	89.200	3.796	0	0,00
							\$ 8.191	\$ 0	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC USD versus INR	INR 81.000	27.04.2022	1.020	\$ (17)	\$ (10)	0,00
	Put – OTC USD versus MXN	MXN 18.200	14.06.2022	8.300	(31)	(24)	(0,01)
	Put – OTC USD versus RUB	RUB 68.250	03.12.2021	8.300	(104)	(24)	0,00
	Call – OTC USD versus RUB	85.000	03.12.2021	8.300	(260)	(60)	(0,01)
JPM	Call – OTC USD versus INR	INR 80.000	27.01.2022	887	(12)	(6)	0,00
MYI	Put – OTC USD versus BRL	BRL 4.300	03.12.2021	8.300	(71)	(8)	0,00
	Call – OTC USD versus BRL	5.750	03.12.2021	8.300	(346)	(97)	(0,01)
UAG	Call – OTC USD versus INR	INR 81.000	02.05.2022	1.770	(27)	(18)	0,00
					\$ (868)	\$ (247)	(0,03)

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap – OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) – 3,000 %] oder 0	22.06.2035	8.200	\$ (374)	\$ (8)	0,00
JPM	Cap – OTC CPURNSA	234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) – 4,000 %] oder 0	16.05.2024	1.500	(10)	0	0,00
						\$ (384)	\$ (8)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 2.900	\$ (86)	\$ 116	\$ 30	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	12.200	(403)	530	127	0,02
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.200	(5)	25	20	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	5.100	(148)	201	53	0,01
					\$ (642)	\$ 872	\$ 230	0,03

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,245 %	02.10.2025	ILS 36.600	\$ 0	\$ 97	\$ 97	0,01
CBK	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,430	01.07.2029	KRW 100	0	0	0	0,00
GLM	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,053	16.12.2025	MYR 5.300	0	(27)	(27)	0,00
	Zahlung ⁽¹⁾	3-Month MYR-KLIBOR	2,750	15.09.2026	77.900	76	(10)	66	0,01
	Zahlung ⁽¹⁾	6-Month THB-THBFX	1,000	15.09.2026	THB 51.000	(2)	(1)	(3)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,130	16.06.2026	47.000	11	1	12	0,00
MYC	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,715	16.12.2025	11.000	0	(3)	(3)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,768	16.12.2025	274.500	0	(52)	(52)	(0,01)
SCX	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,440	17.03.2026	MYR 33.900	0	(52)	(52)	(0,01)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,795	17.03.2026	THB 44.600	0	(8)	(8)	0,00
						\$ 85	\$ (55)	\$ 30	0,00

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	NDUEACWF Index	95.151	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 33.235	02.03.2022	\$ 0	\$ (1.773)	\$ (1.773)	(0,22)
BRC	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	100	20.09.2021	0	2	2	0,00
	Zahlung	BCPMREHO Index	195.278	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	20.602	15.03.2022	0	(1.314)	(1.314)	(0,17)
FBF	Erhalt	DWRTFT Index	1.549	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	18.992	25.08.2021	0	(433)	(433)	(0,06)
JPM	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	100	20.09.2021	0	(1)	(1)	0,00
	Erhalt	NDUEACWF Index	127.058	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	45.372	08.12.2021	0	(1.377)	(1.377)	(0,17)
SOG	Erhalt	DWRTFT Index	1.084	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	13.341	06.04.2022	0	(250)	(250)	(0,03)
							\$ 0	\$ (5.146)	\$ (5.146)	(0,65)

VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Referenzeinheit	Volatilität Ausübungskurs	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
DUB	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	6,425 %	05.11.2021	\$ 62	\$ 0	\$ 143	\$ 143	0,02
JPM	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	6,350	24.11.2021	62	0	144	144	0,02
						\$ 0	\$ 287	\$ 287	0,04

⁽¹⁾ Varianz-Swap

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2021	DKK	39.555	\$ 6.295	\$ 0	\$ (14)	0,00		
	07.2021	MXN	4.492	227	2	2	0,00		
	07.2021	PEN	1.387	369	7	7	0,00		
	07.2021	\$	548	MXN 10.983	3	3	0,00		
	08.2021	RUB	223	\$ 3	0	0	0,00		
	08.2021	\$	105	CZK 2.239	0	(1)	(1)	0,00	
	09.2021	CNY	237.000	\$ 36.848	356	0	356	0,04	
	09.2021	¥	3.488.000	31.543	95	0	95	0,01	
	09.2021	PLN	73	19	0	0	0	0,00	
	09.2021	RUB	287	4	0	0	0	0,00	
	09.2021	\$	174	CLP 125.435	0	(2)	(2)	0,00	
	12.2021		2.862	RUB 212.167	0	(21)	(21)	0,00	
	02.2022	ZAR	3.372	\$ 233	4	0	4	0,00	
	BPS	07.2021	€	2.494	3.025	67	0	67	0,01
		07.2021	RUB	1.423	19	0	0	0	0,00
07.2021		\$	5.925	AUD 7.624	0	(201)	(201)	(0,03)	
07.2021		€	25.760	¥ 2.817.310	0	(376)	(376)	(0,05)	
08.2021		MXN	130.055	\$ 6.098	0	(407)	(407)	(0,05)	
08.2021		\$	132	HUF 39.316	1	0	1	0,00	
11.2021			6.428	MXN 129.756	0	(19)	(19)	0,00	
07.2021			3.073	CHF 2.761	0	(86)	(86)	(0,01)	
07.2021			638	SEK 5.285	0	(20)	(20)	0,00	
08.2021		€	1.526	HUF 537.224	3	0	3	0,00	
CBK	09.2021	PLN	48	\$ 13	0	0	0	0,00	
	07.2021	DKK	30.670	4.864	0	(27)	(27)	0,00	
	07.2021	PEN	15.842	4.336	195	0	195	0,02	
	07.2021	\$	2.010	AUD 2.599	0	(59)	(59)	(0,01)	
	07.2021		659	DKK 4.145	2	0	2	0,00	
	07.2021		2.632	¥ 288.600	0	(32)	(32)	0,00	
	07.2021		171	RUB 13.239	9	0	9	0,00	
	08.2021		18	HUF 5.416	0	0	0	0,00	
	09.2021	PEN	42.478	\$ 11.544	422	0	422	0,05	
	09.2021	ZAR	149.779	10.892	501	0	501	0,06	
GLM	10.2021	PEN	4.296	1.183	59	0	59	0,01	
	10.2021	\$	241	PEN 889	0	(8)	(8)	0,00	
	06.2022	ILS	6.221	\$ 1.920	0	0	0	0,00	
	08.2022		3.935	1.213	0	(2)	(2)	0,00	
	07.2021	£	7.949	11.238	257	0	257	0,03	
	07.2021	\$	2.186	BRL 11.009	8	0	8	0,00	
	07.2021		1.007	€ 831	0	(22)	(22)	0,00	
	07.2021		2.648	MXN 53.073	13	0	13	0,00	
	08.2021	BRL	11.009	\$ 2.179	0	(8)	(8)	0,00	
	08.2021	RUB	819	11	0	0	0	0,00	
08.2021	\$	1.395	HUF 405.526	0	(26)	(26)	0,00		
09.2021	DOP	6.754	\$ 116	0	(1)	(1)	0,00		
09.2021	PLN	77	20	0	0	0	0,00		
09.2021	RUB	730	10	0	0	0	0,00		

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2021	TWD 8.978	\$ 328	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	09.2021	\$ 173	CLP 124.460	0	(2)	(2)	0,00
	09.2021	4.823	HKD 37.414	0	(4)	(4)	0,00
HUS	09.2021	ZAR 73.300	\$ 5.325	240	0	240	0,03
	07.2021	\$ 829	CAD 1.001	0	(21)	(21)	0,00
	07.2021	647	€ 531	0	(18)	(18)	0,00
	07.2021	11.049	£ 7.950	0	(66)	(66)	(0,01)
	07.2021	615	ILS 1.997	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	£ 6.645	\$ 9.198	17	0	17	0,00
	08.2021	RUB 230	3	0	0	0	0,00
	09.2021	CNH 228.021	35.481	363	0	363	0,05
	09.2021	CNY 995	153	0	0	0	0,00
	09.2021	KRW 708.833	636	9	0	9	0,00
	09.2021	PLN 88	23	0	0	0	0,00
	09.2021	RUB 302	4	0	0	0	0,00
JPM	09.2021	\$ 19.644	CNH 126.195	0	(209)	(209)	(0,03)
	07.2021	DKK 34.193	\$ 5.424	0	(29)	(29)	0,00
	07.2021	TRY 1.039	118	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 4.133	DKK 25.750	0	(27)	(27)	0,00
	09.2021	5.921	ZAR 83.306	0	(141)	(141)	(0,02)
MYI	10.2021	DKK 25.750	\$ 4.140	27	0	27	0,00
	07.2021	BRL 11.009	2.056	0	(138)	(138)	(0,02)
	07.2021	€ 2.434	2.902	16	0	16	0,00
	07.2021	£1 2	2	0	0	0	0,00
	07.2021	NOK 600	73	3	0	3	0,00
	07.2021	\$ 6.118	DKK 37.936	0	(68)	(68)	(0,01)
	07.2021	4.029	€ 3.303	0	(112)	(112)	(0,01)
	07.2021	57	£ 41	0	0	0	0,00
	07.2021	7.997	PEN 29.178	0	(378)	(378)	(0,05)
	08.2021	1.399	CZK 29.377	0	(34)	(34)	0,00
	09.2021	631	ZAR 9.048	0	(3)	(3)	0,00
	10.2021	DKK 30.526	\$ 4.911	34	0	34	0,00
RYL	07.2021	\$ 681	RUB 49.463	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07.2021	PEN 27.791	\$ 6.982	0	(276)	(276)	(0,04)
	07.2021	\$ 43.569	€ 35.616	0	(1.331)	(1.331)	(0,17)
	09.2021	17.523	CNH 112.848	0	(144)	(144)	(0,02)
	09.2021	6.988	PEN 27.791	288	0	288	0,04
	12.2021	INR 35.400	\$ 471	5	0	5	0,00
	12.2021	\$ 486	SGD 644	0	(8)	(8)	0,00
SOG	07.2021	5.834	DKK 36.331	0	(41)	(41)	(0,01)
	07.2021	195	RUB 15.122	12	0	12	0,00
	08.2021	RUB 255	\$ 3	0	0	0	0,00
SSB	10.2021	DKK 36.331	5.845	41	0	41	0,01
	07.2021	\$ 1.147	AUD 1.483	0	(34)	(34)	0,00
	07.2021	891	CHF 801	0	(24)	(24)	0,00
	09.2021	CNH 11.004	\$ 1.694	0	(1)	(1)	0,00
TOR	07.2021	\$ 14.589	CAD 17.625	0	(355)	(355)	(0,04)
UAG	07.2021	AUD 7.883	\$ 5.980	62	0	62	0,01
	07.2021	RUB 28.361	379	0	(8)	(8)	0,00
	08.2021	\$ 5.980	AUD 7.883	0	(61)	(61)	(0,01)
				\$ 3.125	\$ (4.873)	\$ (1.748)	(0,22)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	CZK 3.026	\$ 145	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	07.2021	MXN 24.778	1.242	0	(2)	(2)	0,00
	07.2021	\$ 801	€ 664	0	(14)	(14)	0,00
	07.2021	13.905	HKD 107.936	0	(6)	(6)	0,00
	07.2021	869	SGD 1.167	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	1.543	ZAR 22.139	7	0	7	0,00
	08.2021	HKD 107.936	\$ 13.905	6	0	6	0,00
	08.2021	SGD 1.167	869	1	0	1	0,00
	08.2021	ZAR 22.139	1.537	0	(8)	(8)	0,00
BPS	07.2021	AUD 5.378	4.179	142	0	142	0,02
	07.2021	€ 120	145	3	0	3	0,00
	07.2021	IDR 13.798.138	962	12	0	12	0,00
	07.2021	NZD 402	292	11	0	11	0,00
	07.2021	SGD 1.167	882	14	0	14	0,00
	07.2021	\$ 1.930	CNY 12.488	3	0	3	0,00
	07.2021	133.536	€ 109.172	0	(4.069)	(4.069)	(0,51)
	07.2021	1.223	MXN 24.778	21	0	21	0,00
	07.2021	ZAR 22.106	\$ 1.606	58	0	58	0,01
	08.2021	CNY 12.488	1.925	0	(4)	(4)	0,00
	08.2021	MXN 24.778	1.219	0	(21)	(21)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2021	CHF 722	\$ 803	\$ 23	\$ 0	\$ 23	0,00
	07.2021	¥ 2.120.725	19.390	284	0	284	0,04
	07.2021	SEK 22.070	2.662	82	0	82	0,01
CBK	07.2021	\$ 128	€ 105	0	(3)	(3)	0,00
	07.2021	AUD 1.863	\$ 1.441	42	0	42	0,01
	07.2021	CHF 6.483	7.231	217	0	217	0,03
	07.2021	ILS 812	250	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 7.826	CHF 7.205	0	(32)	(32)	0,00
	07.2021	196	CLP 144.422	2	0	2	0,00
	07.2021	141	CZK 3.026	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	ZAR 33	\$ 2	0	0	0	0,00
	08.2021	CHF 7.205	7.833	32	0	32	0,00
	08.2021	CLP 144.422	196	0	(2)	(2)	0,00
GLM	08.2021	CZK 3.026	141	1	0	1	0,00
	07.2021	CLP 144.422	198	0	0	0	0,00
	07.2021	£ 8.544	12.078	277	0	277	0,04
	07.2021	THB 30.445	972	22	0	22	0,00
	07.2021	\$ 2.423	BRL 12.205	9	0	9	0,00
	07.2021	182	HUF 53.817	0	0	0	0,00
	07.2021	3.952	INR 293.432	0	(7)	(7)	0,00
	07.2021	5.307	KRW 6.002.965	13	0	13	0,00
	07.2021	766	MYR 3.191	3	0	3	0,00
	07.2021	953	THB 30.445	0	(3)	(3)	0,00
HUS	07.2021	5.478	TWD 152.907	5	0	5	0,00
	08.2021	BRL 12.205	\$ 2.416	0	(9)	(9)	0,00
	08.2021	HUF 53.817	182	0	0	0	0,00
	08.2021	INR 293.432	3.939	7	0	7	0,00
	08.2021	KRW 6.002.965	5.306	0	(5)	(5)	0,00
	08.2021	MYR 3.191	765	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	THB 30.445	951	2	0	2	0,00
	08.2021	TWD 152.907	5.492	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	HKD 18.766	2.419	3	0	3	0,00
	07.2021	RUB 72.840	987	0	(10)	(10)	0,00
JPM	07.2021	\$ 1.872	€ 1.544	0	(41)	(41)	(0,01)
	07.2021	11.825	£ 8.544	0	(22)	(22)	0,00
	07.2021	951	IDR 13.798.138	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	246	ILS 801	0	0	0	0,00
	07.2021	610	PHP 29.669	0	(2)	(2)	0,00
	07.2021	1.014	RUB 73.512	0	(8)	(8)	0,00
	08.2021	£ 8.544	\$ 11.826	22	0	22	0,00
	08.2021	IDR 13.798.138	948	2	0	2	0,00
	08.2021	ILS 801	246	0	0	0	0,00
	08.2021	PHP 29.669	609	3	0	3	0,00
MYI	08.2021	RUB 73.512	1.009	7	0	7	0,00
	07.2021	HKD 89.170	11.489	7	0	7	0,00
SCX	07.2021	HUF 53.817	188	6	0	6	0,00
	07.2021	MYR 3.191	772	4	0	4	0,00
	07.2021	NOK 4.565	552	22	0	22	0,00
SOG	07.2021	PLN 1.242	338	12	0	12	0,00
	07.2021	\$ 2.735	€ 2.298	0	(11)	(11)	0,00
	07.2021	327	PLN 1.242	0	(1)	(1)	0,00
SSB	08.2021	PLN 1.242	\$ 328	1	0	1	0,00
	07.2021	DKK 11.278	1.829	31	0	31	0,00
	07.2021	TWD 152.907	5.520	37	0	37	0,00
TOR	07.2021	\$ 189.740	€ 155.099	0	(5.810)	(5.810)	(0,73)
	07.2021	CNY 12.488	\$ 1.953	20	0	20	0,00
	07.2021	PHP 29.669	616	9	0	9	0,00
UAG	07.2021	BRL 12.205	2.300	0	(132)	(132)	(0,02)
	07.2021	CAD 11.782	9.752	237	0	237	0,03
	07.2021	\$ 189.293	€ 154.731	0	(5.797)	(5.797)	(0,73)
UAG	07.2021	INR 293.432	\$ 4.021	75	0	75	0,01
	07.2021	KRW 6.002.965	5.368	48	0	48	0,01
	07.2021	RUB 723	10	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 3.699	AUD 4.876	0	(38)	(38)	0,00
	07.2021	205	€ 169	0	(5)	(5)	0,00
	08.2021	AUD 4.876	\$ 3.699	38	0	38	0,01
				\$ 1.888	\$ (16.068)	\$ (14.180)	(1,78)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	CZK 37	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2021	MXN 171	9	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 153	HKD 1.188	0	0	0	0,00
	07.2021	8	SGD 11	0	0	0	0,00
	07.2021	18	ZAR 260	0	0	0	0,00
	08.2021	HKD 1.188	\$ 153	0	0	0	0,00
	08.2021	SGD 11	8	0	0	0	0,00
	08.2021	ZAR 260	18	0	0	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 17.600	\$ (17.738)	(2,22)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (17.738)	(2,22)
Summe Anlagen		\$ 704.951	88,37
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 92.732	11,63
Nettovermögen		\$ 797.683	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(e) Nullkuponwertpapier.

(f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(i) Mit dem Fonds verbunden.

(j) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(k) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 8.039 und Barmittel in Höhe von USD 14.101 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 42.057 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 86.615	\$ 330.934	\$ 485	\$ 418.034
Investmentfonds	247.271	71.969	0	319.240
Finanzderivate ⁽³⁾	4.019	(18.604)	0	(14.585)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(17.738)	0	(17.738)
Summen	\$ 337.905	\$ 366.561	\$ 485	\$ 704.951

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 40.021	\$ 380.529	\$ 1.362	\$ 421.912
Investmentfonds	190.733	40.188	0	230.921
Pensionsgeschäfte	0	981	0	981
Finanzderivate ⁽³⁾	9.653	9.596	0	19.249
Summen	\$ 240.407	\$ 431.294	\$ 1.362	\$ 673.063

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 598	\$ (730)	\$ (132)
BPS	(6.533)	5.880	(653)
BRC	(1.029)	1.157	128
CBK	1.323	(1.760)	(437)
DUB	143	(40)	103
FBF	(433)	780	347
GLM	765	(1.150)	(385)
GST	30	(30)	0
HUS	27	0	27
JPM	(1.403)	1.640	237
MYC	72	(185)	(113)
MYI	(515)	570	55
RYL	(6)	0	(6)
SAL	20	0	20
SCX	(7.310)	6.443	(867)
SOG	(209)	450	241
SSB	(192)	0	(192)
TOR	(5.912)	5.220	(692)
UAG	99	0	99

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	29,74	21,79
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	21,74	37,21
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,92	1,07
Investmentfonds	40,02	32,87
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,14
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,62	1,37
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,12	0,13
Freiverkehrsfinanzderivate	(2,57)	1,24
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,22)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	13,07	9,89
Wandelanleihen & Wechsel	0,18	0,19
US-Regierungsbehörden	0,21	0,26
US-Schatzobligationen	2,51	2,56
Non-Agency-MBS	1,46	1,80
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,98	5,78
Staatsanleihen	9,29	14,66
Stammaktien	7,09	1,52
Vorzugswertpapiere	0,53	0,56
Real Estate Investment Trusts	4,78	4,19
Kurzfristige Instrumente	8,30	18,66
Investmentfonds	40,02	32,87
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,14
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,62	1,37
Optionskauf		
Optionen auf Indizes	0,01	k. A.
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Indizes	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes- Schutzverkauf	0,02	0,03
Zinsswaps	0,10	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,05	0,24
Zinsswapoptionen	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,03)	(0,22)
Inflation-Capped Options	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes- Schutzverkauf	0,03	0,04
Zinsswaps	0,00	0,01
Total Return Swaps auf Indizes	(0,65)	0,03
Volatilitätsswaps	0,04	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,22)	0,18
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,79)	0,96
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,22)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	11,63	4,18
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global High Yield Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
BELGIEN											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
Ontex Group NV				Transocean Poseidon Ltd.	\$ 2.000	\$ 2.013	0,04	Deutsche Bank AG	\$ 7.000	\$ 7.132	0,13
3,500 % fällig am 15.07.2026 (a) €	7.425	\$ 8.805	0,16	6,875 % fällig am 01.02.2027				3,729 % fällig am 14.01.2032 (i)			
BERMUDAS											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
NCL Corp. Ltd.				Transocean Proteus Ltd.	2.200	2.228	0,04	Gruenthal GmbH	€ 2.475	3.023	0,06
5,875 % fällig am 15.03.2026	\$ 2.850	2.992	0,06	6,250 % fällig am 01.12.2024				3,625 % fällig am 15.11.2026			
10,250 % fällig am 01.02.2026	2.500	2.912	0,05	UPCB Finance Ltd.	€ 12.500	15.174	0,28	4,125 % fällig am 15.05.2028	€ 2.325	2.848	0,05
Viking Cruises Ltd.				Wynn Macau Ltd.	\$ 2.500	2.582	0,05	IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)	€ 2.750	3.317	0,06
5,875 % fällig am 15.09.2027	5.000	4.947	0,09	5,125 % fällig am 15.12.2029	\$ 5.000	5.217	0,10	3,625 % fällig am 15.05.2025 (b)	€ 3.000	3.635	0,07
13,000 % fällig am 15.05.2025	3.750	4.419	0,08	5,500 % fällig am 01.10.2027				IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)	€ 2.000	2.447	0,04
VOC Escrow Ltd.				Summe Cayman Inseln		40.294	0,74	3,875 % fällig am 15.05.2027 (b)	€ 2.000	2.447	0,04
5,000 % fällig am 15.02.2028	3.500	3.546	0,07					IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % bar oder 5,500 % PIK)	€ 6.000	6.149	0,11
Summe Bermudas		18.816	0,35					4,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	€ 6.000	6.149	0,11
KANADA											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
B.C. Unlimited Liability Co.				DÄNEMARK							
3,500 % fällig am 15.02.2029	4.000	3.955	0,07	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
4,000 % fällig am 15.10.2030	15.000	14.531	0,27	DKT Finance ApS	€ 2.000	2.417	0,05	Nidda BondCo GmbH	€ 24.000	28.643	0,53
4,250 % fällig am 15.05.2024	2.582	2.612	0,05	7,000 % fällig am 17.06.2023	€ 6.000	6.142	0,11	Nidda Healthcare Holding GmbH	€ 25.000	29.622	0,55
4,375 % fällig am 15.01.2028	3.250	3.299	0,06	9,375 % fällig am 17.06.2023	\$ 6.000	6.142	0,11	3,500 % fällig am 30.09.2024			
Bausch Health Cos., Inc.				Norican A/S	€ 5.000	5.870	0,11	Platin GmbH	€ 5.000	5.983	0,11
4,875 % fällig am 01.06.2028	3.500	3.587	0,07	4,500 % fällig am 15.05.2023	€ 5.000	5.870	0,11	5,375 % fällig am 15.06.2023	€ 5.000	5.983	0,11
5,000 % fällig am 30.01.2028	5.000	4.751	0,09	Summe Dänemark		14.429	0,27	Techem Verwaltungsgesellschaft mbH	€ 15.000	17.652	0,33
5,250 % fällig am 30.01.2030	7.000	6.519	0,12					2,000 % fällig am 15.07.2025	€ 15.000	17.652	0,33
5,250 % fällig am 15.02.2031	4.000	3.745	0,07					Vertical Midco GmbH	€ 7.000	8.689	0,16
5,500 % fällig am 01.11.2025	11.310	11.618	0,21					4,375 % fällig am 15.07.2027	€ 7.000	8.689	0,16
5,750 % fällig am 15.08.2027	2.500	2.661	0,05					WEPA Hygieneprodukte GmbH	€ 15.000	17.604	0,32
6,125 % fällig am 15.04.2025	5.815	5.968	0,11					2,875 % fällig am 15.12.2027 (j)	€ 15.000	17.604	0,32
6,250 % fällig am 15.02.2029	8.000	7.922	0,15					Summe Deutschland		185.112	3,41
7,000 % fällig am 15.01.2028	3.625	3.744	0,07					IRLAND			
7,250 % fällig am 30.05.2029	5.000	5.124	0,09					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
9,000 % fällig am 15.12.2025	2.000	2.147	0,04					Jazz Securities DAC	\$ 4.000	4.152	0,08
Bombardier, Inc.								4,375 % fällig am 15.01.2029	€ 4.000	4.152	0,08
7,125 % fällig am 15.06.2026	4.250	4.455	0,08					Motion Bondco DAC	€ 3.000	3.484	0,06
7,500 % fällig am 01.12.2024	2.750	2.877	0,05					4,500 % fällig am 15.11.2027	€ 3.000	3.484	0,06
7,500 % fällig am 15.03.2025	7.000	7.214	0,13					6,625 % fällig am 15.11.2027	\$ 6.000	6.099	0,11
7,875 % fällig am 15.04.2027	3.000	3.116	0,06					Summe Irland		13.735	0,25
Garda World Security Corp.								ITALIEN			
6,000 % fällig am 01.06.2029	2.500	2.485	0,05					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
GFL Environmental, Inc.								Atlantia SpA	€ 2.000	2.437	0,05
3,500 % fällig am 01.09.2028	5.000	4.995	0,09					1,625 % fällig am 03.02.2025	€ 2.000	2.437	0,05
4,000 % fällig am 01.08.2028	4.000	3.957	0,07					1,875 % fällig am 13.07.2027	€ 12.500	15.384	0,28
4,250 % fällig am 01.06.2025	2.500	2.610	0,05					1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 12.500	15.276	0,28
Masonite International Corp.								Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	€ 9.950	9.742	0,18
5,375 % fällig am 01.02.2028	7.000	7.441	0,14					5,375 % fällig am 18.01.2028	€ 9.950	9.742	0,18
MEG Energy Corp.								8,000 % fällig am 22.01.2030	€ 5.000	5.449	0,10
5,875 % fällig am 01.02.2029	2.500	2.610	0,05					10,500 % fällig am 23.07.2029	€ 6.800	9.120	0,17
7,125 % fällig am 01.02.2027	7.000	7.476	0,14					F-Brasile SpA	\$ 5.000	5.169	0,10
Open Text Corp.								7,375 % fällig am 15.08.2026	€ 5.000	5.169	0,10
5,875 % fällig am 01.06.2026	7.000	7.261	0,13					Intesa Sanpaolo SpA	€ 1.000	1.027	0,02
Precision Drilling Corp.								4,950 % fällig am 01.06.2042	€ 2.000	2.078	0,04
6,875 % fällig am 15.01.2029	2.500	2.578	0,05					5,017 % fällig am 26.06.2024	€ 5.000	5.443	0,10
Summe Kanada		141.258	2,61					5,710 % fällig am 15.01.2026	€ 5.000	5.659	0,10
CAYMAN INSELN								5,875 % fällig am 01.09.2031 (f)(h) €	5.000	6.750	0,13
AKTIEN								6,250 % fällig am 16.05.2024 (f)(h)	€ 5.500	7.167	0,13
Noble Corp. (c)	30.502	754	0,01					7,700 % fällig am 17.09.2025 (f)(h) \$	7.000	8.037	0,15
Noble Corp. (c)(i)	201.443	4.982	0,09					7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h) €	4.000	5.820	0,11
		5.736	0,10					Nexti SpA	€ 8.000	9.457	0,17
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								1,625 % fällig am 30.04.2026	€ 10.000	12.112	0,22
Diamond Assets LLC								1,750 % fällig am 31.10.2024	€ 12.000	14.112	0,26
13,000 % fällig am 22.04.2027 (i) \$	66	66	0,00					2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 12.000	14.112	0,26
13,000 % fällig am 22.04.2027	18	18	0,00					Sofima Holding SpA	€ 5.000	5.970	0,11
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd.								3,750 % fällig am 15.01.2028	€ 2.550	3.043	0,06
5,750 % fällig am 20.01.2026	5.750	6.180	0,11					4,000 % fällig am 15.01.2028	€ 2.550	3.043	0,06
Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK)								Telecom Italia SpA	€ 5.000	5.842	0,11
11,000 % fällig am 15.02.2028 (b)	976	1.080	0,02					1,625 % fällig am 18.01.2029	€ 5.000	5.842	0,11
								5,303 % fällig am 30.05.2024	\$ 15.000	16.456	0,30
								UniCredit SpA	€ 6.750	7.680	0,14
								3,875 % fällig am 03.06.2027 (f)(h) €	€ 6.750	7.680	0,14
								5,459 % fällig am 30.06.2035	\$ 14.000	15.280	0,28
								Summe Italien		194.510	3,59
								JAPAN			
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								Rakuten Group, Inc.	€ 2.750	2.862	0,05
								5,125 % fällig am 22.04.2026 (f)	€ 2.750	2.862	0,05

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
6,250 % fällig am 22.04.2031 (f)	\$ 4.250	\$		MAURITIUS				United Group BV			
Summe Japan			7,465 0,14	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,125 % fällig am 15.02.2026	€ 7.000	\$	8,094 0,15
JERSEY, KANALINSELN				Greenko Solar Mauritius Ltd.	\$ 3.000	\$	3,091 0,06	3,250 % fällig am 15.02.2026			1,700 0,04
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,550 % fällig am 29.01.2025				3,625 % fällig am 15.02.2028	5.000		5,778 0,11
Adient Global Holdings Ltd.	€ 5.000	6.108	0,11	5,950 % fällig am 29.07.2026	3.500		3,778 0,07	4,000 % fällig am 15.11.2027	1.500		1,771 0,03
3,500 % fällig am 15.08.2024				Summe Mauritius			6,869 0,13	UPC Holding BV			
4,875 % fällig am 15.08.2026	\$ 4.000	4.122	0,08	MULTINATIONAL				3,875 % fällig am 15.06.2029	10.000	12.049	0,22
CPUK Finance Ltd.	£ 2.450	3.434	0,06	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Ziggo Bond Co. BV			
4,500 % fällig am 28.08.2027				Allied Universal Holdco LLC	€ 7.500	8.840	0,16	3,375 % fällig am 28.02.2030	10.000	11.729	0,22
Summe Jersey, Kanalinseln		13,664	0,25	4,875 % fällig am 01.06.2028	€ 4.250	5.840	0,11	5,125 % fällig am 28.02.2030	\$ 5.000	5.127	0,09
LIBERIA				American Airlines, Inc.	\$ 7.500	7.950	0,15	6,000 % fällig am 15.01.2027	10.000	10.487	0,19
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,500 % fällig am 20.04.2026				Ziggo BV			
Royal Caribbean Cruises Ltd.				5,750 % fällig am 20.04.2029	7.000	7.578	0,14	2,875 % fällig am 15.01.2030	€ 7.000	8.328	0,15
5,500 % fällig am 01.04.2028	\$ 4.000	4.194	0,08	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC	€ 1.600	1.905	0,03	5,500 % fällig am 15.01.2027	\$ 10.150	10.572	0,20
9,125 % fällig am 15.06.2023	3.000	3.296	0,06	2,000 % fällig am 01.09.2028							
11,500 % fällig am 01.06.2025	2.500	2.885	0,05	3,000 % fällig am 01.09.2029	\$ 3.075	3.646	0,07				
Summe Liberia		10,375	0,19	3,250 % fällig am 01.09.2028	\$ 3.000	3.002	0,05				
				4,000 % fällig am 01.09.2029	3.500	3.478	0,06				
LUXEMBURG				Ardagh Packaging Finance PLC							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,125 % fällig am 15.08.2026	12.000	12.406	0,23	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Altice Financing S.A.	€ 3.000	3.462	0,06	5,250 % fällig am 15.08.2027	11.600	11.847	0,22	Diamond (BC) BV			
2,250 % fällig am 15.01.2025				6,000 % fällig am 15.02.2025	964	997	0,02	3,147 % - 3,186 % fällig am 06.09.2024	4.974	4.954	0,09
3,000 % fällig am 15.01.2028	10.000	11.309	0,21	CANPACK S.A.	€ 2.000	2.428	0,04	Summe Niederlande		263,235	4,86
7,500 % fällig am 15.05.2026	\$ 7.000	7.298	0,13	2,375 % fällig am 01.11.2027	€ 3.000	3.057	0,06	NORWEGEN			
Altice France Holding S.A.	€ 5.000	5.711	0,11	3,125 % fällig am 01.11.2025	\$ 3.000	3.057	0,06	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,000 % fällig am 15.02.2028 (j)	€ 5.000	5.711	0,11	Clarios Global LP	€ 14.000	17.220	0,32	Adevinta ASA	€ 10.000	12.179	0,22
6,000 % fällig am 15.02.2028	\$ 3.500	3.490	0,06	8,500 % fällig am 15.05.2027	€ 5.000	5.457	0,10	5,750 % fällig am 01.03.2027	\$ 12.750	13.372	0,25
Aramark International Finance SARL	€ 5.000	6.014	0,11	Connect Finco SARL	6.500	6.882	0,13	7,625 % fällig am 01.03.2026	8.000	8.700	0,16
3,125 % fällig am 01.04.2025				6,750 % fällig am 01.10.2026				Summe Panama		22,072	0,41
BK LC Lux Finco SARL	1.625	1.976	0,04	Endo DAC				SPANIEN			
5,250 % fällig am 30.04.2029				6,000 % fällig am 30.06.2028	5.759	3.891	0,07	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Camelot Finance S.A.	\$ 5.000	5.248	0,10	9,500 % fällig am 31.07.2027	4.273	4.364	0,08	CellnEx Finance Co. S.A.			
4,500 % fällig am 01.11.2026				Summe multinational		110,788	2,04	3,875 % fällig am 07.07.2041 (a)	2.400	2.396	0,04
Cirsa Finance International SARL	€ 3.000	3.582	0,07	NIEDERLANDE				CellnEx Telecom S.A.			
4,750 % fällig am 22.05.2025	€ 7.000	8.437	0,16	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,000 % fällig am 20.04.2027	€ 4.100	4.821	0,09
6,250 % fällig am 20.12.2023				Ashland Services BV	€ 15.000	18.075	0,33	1,875 % fällig am 26.06.2029	3.000	3.634	0,07
Endo Luxembourg Finance Co. SARL	\$ 3.000	2.944	0,05	2,000 % fällig am 30.01.2028				Foodco Bondco S.A.			
6,125 % fällig am 01.04.2029				Axalta Coating Systems Dutch Holding BV	10.000	12.083	0,22	6,250 % fällig am 15.05.2026	3.000	3.367	0,06
FAGE International S.A.	3.000	3.093	0,06	3,750 % fällig am 15.01.2025				Grifols S.A.			
5,625 % fällig am 15.08.2026				Clear Channel International BV	\$ 3.000	3.163	0,06	1,625 % fällig am 15.02.2025	5.000	5.990	0,11
Herens Holdco SARL	7.000	6.974	0,13	6,625 % fällig am 01.08.2025				2,250 % fällig am 15.11.2027	5.000	6.046	0,11
4,750 % fällig am 15.05.2028				Diamond BC BV	€ 15.000	18.132	0,33	Lorca Telecom Bondco S.A.			
Herens Midco SARL	€ 15.000	17.443	0,32	5,625 % fällig am 15.08.2025				4,000 % fällig am 18.09.2027	7.150	8.650	0,16
5,250 % fällig am 15.05.2029				Dufry One BV	8.500	9.526	0,18	Summe Spanien		34,904	0,64
InPost S.A.	2.925	3.497	0,06	2,000 % fällig am 15.02.2027	3.500	4.130	0,08	SCHWEDEN			
2,250 % fällig am 15.07.2027				3,375 % fällig am 15.04.2028				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
LHMC Finco 2 SARL (7,250 % bar oder 8,000 % PIK)	3.245	3.855	0,07	Energizer Gamma Acquisition BV	3.500	10.620	0,20	Intrum AB			
7,250 % fällig am 02.10.2025 (b)				3,500 % fällig am 30.06.2029	8.975	10.340	0,19	2,750 % fällig am 15.07.2022	200	238	0,00
Lincoln Financing SARL	7.250	8.716	0,16	4,625 % fällig am 15.07.2026				3,000 % fällig am 15.09.2027	12.000	14.113	0,26
3,625 % fällig am 01.04.2024				LeasePlan Corp. NV	7.000	9.312	0,17	3,125 % fällig am 15.07.2024	4.000	4.774	0,09
Nielsen Co. Luxembourg SARL	\$ 6.000	6.190	0,11	7,375 % fällig am 29.05.2024 (f)(h)				3,500 % fällig am 15.07.2026	4.000	4.848	0,09
5,000 % fällig am 01.02.2025				Nouryon Holding BV	16.000	19.888	0,37	4,875 % fällig am 15.08.2025	3.000	3.745	0,07
Rossini SARL	€ 5.000	6.220	0,11	6,500 % fällig am 01.10.2026	\$ 5.000	5.306	0,10	Verisure Holding AB			
6,750 % fällig am 30.10.2025				8,000 % fällig am 01.10.2026				3,250 % fällig am 15.02.2027	8.450	10.041	0,19
SIG Combibloc Purchase Co. SARL	3.750	4.603	0,08	Q-Park Holding BV	€ 1.375	1.578	0,03	Verisure Midholding AB			
1,875 % fällig am 18.06.2023	5.000	6.279	0,12	1,500 % fällig am 01.03.2025				5,250 % fällig am 15.02.2029	2.650	3.237	0,06
2,125 % fällig am 18.06.2025				2,000 % fällig am 01.03.2027	7.000	7.927	0,15	Summe Schweden		40,996	0,76
Summer BC Holdco SARL	6.000	7.462	0,14	Schoeller Packaging BV	7.500	9.269	0,17	SCHWEIZ			
5,750 % fällig am 31.10.2026				6,375 % fällig am 01.11.2024				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
9,250 % fällig am 31.10.2027	3.154	4.065	0,08	Sensata Technologies BV	\$ 4.000	4.297	0,08	Credit Suisse Group AG			
Telecom Italia Capital S.A.	\$ 7.500	8.972	0,17	4,875 % fällig am 15.10.2023	1.000	1.117	0,02	6,375 % fällig am 21.08.2026 (f)(h)	\$ 4.900	5.466	0,10
6,375 % fällig am 15.11.2033				Sigma Holdco BV	€ 15.000	17.330	0,32	GROSSBRITANNIEN			
7,200 % fällig am 18.07.2036	3.000	3.874	0,07	5,750 % fällig am 15.05.2026	\$ 6.600	6.775	0,12	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
		150,714	2,78	7,875 % fällig am 15.05.2026				Arqiva Broadcast Finance PLC	£ 5.000	7.103	0,13
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				Sunshine Mid BV	€ 5.000	6.145	0,11	6,750 % fällig am 30.09.2023			
Ortho-Clinical Diagnostics S.A.	2.351	2.351	0,04	6,500 % fällig am 15.05.2026				Summe Grossbritannien			
3,089 % fällig am 30.06.2025				Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV	\$ 2.073	2.073	0,04				
Summe Luxemburg		153,065	2,82	4,100 % fällig am 01.10.2046	6.000	5.265	0,10				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Colgate Energy Partners LLC 5,875 % fällig am 01.07.2029	\$ 4.000	\$ 4.155	0,08	6,625 % fällig am 15.08.2027	5.000	2.463	0,05	Freeport-McMoRan, Inc. 4,125 % fällig am 01.03.2028	\$ 5.000	\$ 5.225	0,10
CommScope Technologies LLC 5,000 % fällig am 15.03.2027	5.000	5.125	0,09	DISH DBS Corp. 5,000 % fällig am 15.03.2023	\$ 3.000	\$ 3.147	0,06	4,550 % fällig am 14.11.2024	1.500	1.633	0,03
6,000 % fällig am 15.06.2025	4.334	4.432	0,08	5,875 % fällig am 15.07.2022	10.000	10.444	0,19	4,625 % fällig am 01.08.2030	2.250	2.467	0,05
CommScope, Inc. 5,500 % fällig am 01.03.2024	2.000	2.064	0,04	5,875 % fällig am 15.11.2024	5.000	5.375	0,10	5,000 % fällig am 01.09.2027	4.000	4.236	0,08
6,000 % fällig am 01.03.2026	3.000	3.171	0,06	7,750 % fällig am 01.07.2026	5.000	5.669	0,10	5,250 % fällig am 01.09.2029	5.000	5.536	0,10
7,125 % fällig am 01.07.2028	5.000	5.426	0,10	Diversified Healthcare Trust 4,375 % fällig am 01.03.2031	3.500	3.358	0,06	5,400 % fällig am 14.11.2034	12.500	15.114	0,28
8,250 % fällig am 01.03.2027	4.000	4.280	0,08	DT Midstream, Inc. 4,125 % fällig am 15.06.2029	5.000	5.083	0,09	5,450 % fällig am 15.03.2043	3.000	3.671	0,07
Community Health Systems, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2031	10.000	10.050	0,19	4,375 % fällig am 15.06.2031	5.375	5.499	0,10	Frontier Communications Holdings LLC 5,000 % fällig am 01.05.2028	3.500	3.623	0,07
5,625 % fällig am 15.03.2027	8.250	8.818	0,16	Dun & Bradstreet Corp. 6,875 % fällig am 15.08.2026	4.196	4.462	0,08	5,875 % fällig am 15.10.2027	4.625	4.960	0,09
6,000 % fällig am 15.01.2029	1.625	1.741	0,03	10,250 % fällig am 15.02.2027	900	997	0,02	6,750 % fällig am 01.05.2029	5.000	5.326	0,10
6,625 % fällig am 15.02.2025	5.000	5.294	0,10	Edgewell Personal Care Co. 4,125 % fällig am 01.04.2029	6.000	6.068	0,11	Gap, Inc. 8,375 % fällig am 15.05.2023	1.000	1.128	0,02
6,875 % fällig am 15.04.2029	5.250	5.509	0,10	5,500 % fällig am 01.06.2028	5.000	5.310	0,10	8,625 % fällig am 15.05.2025	5.000	5.492	0,10
8,000 % fällig am 15.03.2026	4.000	4.315	0,08	Elanco Animal Health, Inc. 5,900 % fällig am 28.08.2028	5.000	5.869	0,11	8,875 % fällig am 15.05.2027	6.000	6.958	0,13
Comstock Resources, Inc. 5,875 % fällig am 15.01.2030	4.000	4.085	0,08	Element Solutions, Inc. 3,875 % fällig am 01.09.2028	6.000	6.131	0,11	Gartner, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2029	4.000	4.065	0,07
6,750 % fällig am 01.03.2029	6.500	6.932	0,13	EMC Corp. 3,375 % fällig am 01.06.2023	3.500	3.644	0,07	3,750 % fällig am 01.10.2030	3.000	3.073	0,06
7,500 % fällig am 15.05.2025	1.370	1.425	0,03	Enact Holdings, Inc. 6,500 % fällig am 15.08.2025	4.500	4.973	0,09	4,500 % fällig am 01.07.2028	3.000	3.172	0,06
Continental Resources, Inc. 4,375 % fällig am 15.01.2028	7.500	8.318	0,15	Endeavor Energy Resources LP 5,500 % fällig am 30.01.2026	1.000	1.042	0,02	Genesis Energy LP 6,250 % fällig am 15.05.2026	2.000	2.009	0,04
4,500 % fällig am 15.04.2023	751	784	0,01	5,750 % fällig am 30.01.2028	10.000	10.677	0,20	6,500 % fällig am 01.10.2025	3.000	3.036	0,06
Cooper-Standard Automotive, Inc. 5,625 % fällig am 15.11.2026	5.000	4.724	0,09	6,625 % fällig am 15.07.2025	3.000	3.219	0,06	Global Medical Response, Inc. 6,500 % fällig am 01.10.2025	10.000	10.307	0,19
Core & Main Holdings LP (8,625 % bar oder 9,375 % PIK) 8,625 % fällig am 15.09.2024 (b)	3.500	3.584	0,07	Energizer Holdings, Inc. 4,375 % fällig am 31.03.2029	7.000	7.017	0,13	Go Daddy Operating Co. LLC 3,500 % fällig am 01.03.2029	5.000	4.978	0,09
Core & Main LP 6,125 % fällig am 15.08.2025	22.500	23.029	0,42	4,750 % fällig am 15.06.2028	3.500	3.594	0,07	Graphic Packaging International LLC 3,500 % fällig am 01.03.2029	3.125	3.100	0,06
CoreLogic, Inc. 4,500 % fällig am 01.05.2028	9.000	8.932	0,16	EnLink Midstream LLC 5,375 % fällig am 01.06.2029	7.500	7.837	0,14	4,125 % fällig am 15.08.2024	2.500	2.690	0,05
Cornerstone Building Brands, Inc. 6,125 % fällig am 15.01.2029	5.000	5.373	0,10	5,625 % fällig am 15.01.2028	1.000	1.059	0,02	4,875 % fällig am 15.11.2022	2.000	2.097	0,04
Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 7.750	9.246	0,17	Entercom Media Corp. 6,500 % fällig am 01.05.2027	4.000	4.175	0,08	Greystar Real Estate Partners LLC 5,750 % fällig am 01.12.2025	6.250	6.446	0,12
4,000 % fällig am 15.04.2023	7.750	9.139	0,17	EQM Midstream Partners LP 4,000 % fällig am 01.08.2024	5.000	5.144	0,09	Griffon Corp. 5,750 % fällig am 01.03.2028	6.000	6.394	0,12
4,750 % fällig am 15.04.2026 (j)	5.000	5.799	0,11	4,125 % fällig am 01.12.2026	2.000	2.053	0,04	H-Food Holdings LLC 8,500 % fällig am 01.06.2026	8.000	8.366	0,15
5,000 % fällig am 15.04.2026	\$ 5.500	5.592	0,10	4,500 % fällig am 15.01.2029	2.500	2.547	0,05	Hanesbrands, Inc. 4,625 % fällig am 15.05.2024	4.000	4.245	0,08
6,500 % fällig am 15.04.2026	4.000	4.060	0,07	4,750 % fällig am 15.07.2023	1.684	1.760	0,03	4,875 % fällig am 15.05.2026	5.000	5.406	0,10
Covanta Holding Corp. 5,000 % fällig am 01.09.2030	3.000	3.158	0,06	4,750 % fällig am 15.01.2031	3.250	3.353	0,06	5,375 % fällig am 15.05.2025	3.000	3.185	0,06
5,875 % fällig am 01.07.2025	3.000	3.111	0,06	6,000 % fällig am 01.07.2025	2.000	2.180	0,04	HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	4.000	4.035	0,07
Crestwood Midstream Partners LP 5,625 % fällig am 01.05.2027	5.000	5.146	0,09	6,500 % fällig am 01.07.2027	2.000	2.236	0,04	3,750 % fällig am 15.09.2030	5.750	5.633	0,10
Crown Americas LLC 4,250 % fällig am 30.09.2026	5.000	5.376	0,10	6,500 % fällig am 15.07.2048	3.000	3.216	0,06	HCA, Inc. 3,500 % fällig am 01.09.2030	10.000	10.660	0,20
4,750 % fällig am 01.02.2026	2.300	2.390	0,04	EQT Corp. 3,000 % fällig am 01.10.2022	810	828	0,02	5,375 % fällig am 01.02.2025	3.000	3.388	0,06
CrownRock LP 5,000 % fällig am 01.05.2029	2.000	2.103	0,04	3,625 % fällig am 15.05.2031	1.000	1.045	0,02	5,875 % fällig am 01.05.2023	7.500	8.160	0,15
5,625 % fällig am 15.10.2025	8.500	8.822	0,16	7,625 % fällig am 01.02.2025	4.250	4.963	0,09	5,875 % fällig am 15.02.2026	3.500	4.053	0,07
CSC Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.02.2031	5.000	4.731	0,09	8,500 % fällig am 01.02.2030	2.000	2.609	0,05	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2032	6.000	5.933	0,11
4,125 % fällig am 01.12.2030	5.000	4.984	0,09	ESH Hospitality, Inc. 5,250 % fällig am 01.05.2025	5.000	5.099	0,09	3,750 % fällig am 01.05.2029	4.500	4.551	0,08
4,625 % fällig am 01.12.2030	8.000	7.859	0,14	Flex Acquisition Co., Inc. 6,875 % fällig am 15.01.2025	5.000	5.094	0,09	4,000 % fällig am 01.05.2031	4.375	4.420	0,08
5,250 % fällig am 01.06.2024	6.000	6.510	0,12	7,875 % fällig am 15.07.2026	5.000	5.217	0,10	4,875 % fällig am 15.01.2030	4.000	4.278	0,08
5,375 % fällig am 01.02.2028	2.250	2.383	0,04	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 07.12.2022	€ 7.000	8.263	0,15	5,750 % fällig am 01.05.2028	2.250	2.440	0,04
5,500 % fällig am 15.04.2027	5.500	5.790	0,11	0,157 % fällig am 01.12.2024	14.250	16.472	0,30	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC 4,875 % fällig am 01.07.2031	7.525	7.515	0,14
5,750 % fällig am 15.01.2030	11.000	11.440	0,21	0,189 % fällig am 15.11.2023	5.000	5.856	0,11	5,000 % fällig am 01.06.2029	5.500	5.631	0,10
5,875 % fällig am 15.09.2022	5.000	5.263	0,10	1,744 % fällig am 19.07.2024	3.000	3.616	0,07	Hilton Worldwide Finance LLC 4,875 % fällig am 01.04.2027	3.500	3.658	0,07
Darling Ingredients, Inc. 5,250 % fällig am 15.04.2027	4.000	4.212	0,08	2,900 % fällig am 16.02.2028	\$ 2.900	4.983	0,09	Hologic, Inc. 3,250 % fällig am 15.02.2029	4.000	3.977	0,07
DaVita, Inc. 3,750 % fällig am 15.02.2031	10.000	9.612	0,18	3,087 % fällig am 09.01.2023	2.500	2.553	0,05	4,625 % fällig am 01.02.2028	5.000	5.269	0,10
4,625 % fällig am 01.06.2030	15.000	15.442	0,28	3,096 % fällig am 04.05.2023	7.500	7.659	0,14	Howard Hughes Corp. 4,125 % fällig am 01.02.2029	4.000	4.013	0,07
DCP Midstream Operating LP 5,375 % fällig am 15.07.2025	5.000	5.575	0,10	3,375 % fällig am 13.11.2025	5.000	5.191	0,10	4,375 % fällig am 01.02.2031	3.000	2.995	0,05
5,625 % fällig am 15.07.2027	2.000	2.281	0,04	3,664 % fällig am 08.09.2024	3.000	3.153	0,06	5,375 % fällig am 01.08.2028	4.500	4.786	0,09
Delek Logistics Partners LP 7,125 % fällig am 01.06.2028	4.000	4.225	0,08	4,000 % fällig am 13.11.2030	5.000	5.244	0,10	Howmet Aerospace, Inc. 5,125 % fällig am 01.10.2024	2.000	2.212	0,04
Dell International LLC 7,125 % fällig am 15.06.2024	4.000	4.112	0,08	4,125 % fällig am 17.08.2027	5.000	5.311	0,10	5,900 % fällig am 01.02.2027	3.000	3.512	0,06
Dell, Inc. 7,100 % fällig am 15.04.2028	1.500	1.934	0,04	4,134 % fällig am 04.08.2025	6.000	6.420	0,12	5,950 % fällig am 01.02.2037	5.000	6.057	0,11
Diamond Offshore Drilling, Inc. 13,000 % fällig am 21.12.2026	44	44	0,00	4,140 % fällig am 15.02.2023	1.750	1.816	0,03	iHeartCommunications, Inc. 4,750 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.161	0,09
Diamond Sports Group LLC 5,375 % fällig am 15.08.2026	9.000	5.839	0,11	4,250 % fällig am 20.09.2022	3.000	3.106	0,06	5,250 % fällig am 15.08.2027	3.000	3.142	0,06
				4,542 % fällig am 01.08.2026	3.000	3.271	0,06	Imola Merger Corp. 4,750 % fällig am 15.05.2029	7.500	7.725	0,14
				5,125 % fällig am 16.06.2025	2.000	2.205	0,04	Indigo Natural Resources LLC 5,375 % fällig am 01.02.2029	6.000	6.278	0,12
				5,584 % fällig am 18.03.2024	4.000	4.386	0,08				
				Forterra Finance LLC 6,500 % fällig am 15.07.2025	7.000	7.566	0,14				
				Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 5,500 % fällig am 01.05.2028	1.750	1.824	0,03				
				6,500 % fällig am 01.10.2025	7.000	7.280	0,13				

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Installed Building Products, Inc. 5,750 % fällig am 01.02.2028	\$ 2.500	\$ 2.641	0,05	MDC Holdings, Inc. 6,000 % fällig am 15.01.2043	\$ 5.000	\$ 6.450	0,12	4,400 % fällig am 15.08.2049	5.000	4.807	0,09
IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2028	€ 11.000	13.151	0,24	Mercer International, Inc. 5,125 % fällig am 01.02.2029	2.750	2.833	0,05	4,500 % fällig am 15.07.2044	5.000	4.831	0,09
2,250 % fällig am 15.03.2029	5.900	6.992	0,13	MGM Growth Properties Operating Partnership LP 4,500 % fällig am 01.09.2026	4.000	4.278	0,08	4,625 % fällig am 15.06.2045	5.000	4.893	0,09
2,875 % fällig am 15.06.2028	7.000	8.570	0,16	4,500 % fällig am 15.01.2028	2.000	2.119	0,04	5,550 % fällig am 15.03.2026	5.000	5.539	0,10
5,000 % fällig am 15.10.2026	\$ 5.000	5.188	0,10	4,625 % fällig am 15.06.2025	2.000	2.141	0,04	5,875 % fällig am 01.09.2025	3.625	4.037	0,07
5,000 % fällig am 15.05.2027	4.000	4.202	0,08	5,625 % fällig am 01.05.2024	2.000	2.168	0,04	6,125 % fällig am 01.01.2031 (i)	1.250	1.472	0,03
IRB Holding Corp. 7,000 % fällig am 15.06.2025	6.000	6.492	0,12	MGM Resorts International 4,625 % fällig am 01.09.2026	6.000	6.346	0,12	6,200 % fällig am 15.03.2040	7.000	7.930	0,15
Jaguar Holding Co. 4,625 % fällig am 15.06.2025	5.000	5.260	0,10	5,500 % fällig am 15.04.2027	1.306	1.437	0,03	6,375 % fällig am 01.09.2028	3.000	3.507	0,06
5,000 % fällig am 15.06.2028	5.000	5.430	0,10	5,750 % fällig am 15.06.2025	2.625	2.898	0,05	6,450 % fällig am 15.09.2036	7.000	8.378	0,15
Jeld-Wen, Inc. 4,625 % fällig am 15.12.2025	6.000	6.128	0,11	6,000 % fällig am 15.03.2023	3.000	3.215	0,06	6,600 % fällig am 15.03.2046	7.000	8.335	0,15
4,875 % fällig am 15.12.2027	10.000	10.412	0,19	7,750 % fällig am 15.03.2022	5.000	5.232	0,10	6,625 % fällig am 01.09.2030	5.000	6.006	0,11
6,250 % fällig am 15.05.2025	2.000	2.140	0,04	Midcap Financial Issuer Trust 6,500 % fällig am 01.05.2028	5.000	5.239	0,10	7,500 % fällig am 01.05.2031	1.000	1.261	0,02
Kaiser Aluminum Corp. 4,500 % fällig am 01.06.2031	2.000	2.056	0,04	Midwest Gaming Borrower LLC 4,875 % fällig am 01.05.2029	7.000	7.017	0,13	8,000 % fällig am 15.07.2025	3.000	3.596	0,07
4,625 % fällig am 01.03.2028	4.000	4.138	0,08	Moog, Inc. 4,250 % fällig am 15.12.2027	6.000	6.219	0,11	8,875 % fällig am 15.07.2030	5.625	7.530	0,14
KFC Holding Co. 4,750 % fällig am 01.06.2027	3.500	3.666	0,07	MPH Acquisition Holdings LLC 5,750 % fällig am 01.11.2028	10.000	10.062	0,19	ON Semiconductor Corp. 3,875 % fällig am 01.09.2028	5.500	5.674	0,10
Kraft Heinz Foods Co. 4,250 % fällig am 01.03.2031	4.375	4.975	0,09	MPT Operating Partnership LP 3,500 % fällig am 15.03.2031	7.500	7.584	0,14	OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027	5.000	5.044	0,09
4,375 % fällig am 01.06.2046	5.000	5.675	0,10	MSCI, Inc. 3,625 % fällig am 01.09.2030	1.000	1.025	0,02	5,375 % fällig am 15.11.2029	5.000	5.449	0,10
4,875 % fällig am 01.10.2049	2.000	2.433	0,04	3,875 % fällig am 15.02.2031	2.500	2.598	0,05	6,125 % fällig am 15.05.2022	5.250	5.468	0,10
5,200 % fällig am 15.07.2045	18.250	22.699	0,42	4,000 % fällig am 15.11.2029	5.000	5.290	0,10	6,125 % fällig am 15.03.2024	4.000	4.310	0,08
5,500 % fällig am 01.06.2050	4.000	5.203	0,10	Nabors Industries, Inc. 9,000 % fällig am 01.02.2025	1.125	1.186	0,02	6,625 % fällig am 15.01.2028	3.000	3.449	0,06
Kronos Acquisition Holdings, Inc. 5,000 % fällig am 31.12.2026	5.000	5.082	0,09	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.08.2028	7.000	7.071	0,13	6,875 % fällig am 15.03.2025	5.000	5.649	0,10
L Brands, Inc. 6,625 % fällig am 01.10.2030	5.000	5.794	0,11	Naviest Corp. 7,250 % fällig am 25.01.2022	2.500	2.596	0,05	7,125 % fällig am 15.03.2026	2.750	3.206	0,06
6,875 % fällig am 01.11.2035	10.000	12.675	0,23	NCR Corp. 5,000 % fällig am 01.10.2028	3.375	3.495	0,06	8,875 % fällig am 15.06.2025	2.000	2.223	0,04
LABL Escrow Issuer LLC 6,750 % fällig am 15.07.2026	5.000	5.344	0,10	5,250 % fällig am 01.10.2030	2.500	2.597	0,05	Organon Finance LLC 2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 5.750	6.926	0,13
Lamar Media Corp. 3,625 % fällig am 15.01.2031	2.600	2.547	0,05	5,750 % fällig am 01.09.2027	3.750	3.975	0,07	4,125 % fällig am 30.04.2028	\$ 5.000	5.105	0,09
Lamb Weston Holdings, Inc. 4,625 % fällig am 01.11.2024	1.500	1.556	0,03	6,125 % fällig am 01.09.2029	2.500	2.729	0,05	5,125 % fällig am 30.04.2031	12.500	12.893	0,24
4,875 % fällig am 01.11.2026	5.000	5.175	0,10	8,125 % fällig am 15.04.2025	1.250	1.369	0,02	Ortho-Clinical Diagnostics, Inc. 7,250 % fällig am 01.02.2028	10.200	11.161	0,21
4,875 % fällig am 15.05.2028	4.750	5.261	0,10	NESCO Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.04.2029	2.825	2.952	0,05	7,375 % fällig am 01.06.2025	2.850	3.072	0,06
Legacy LifePoint Health LLC 4,375 % fällig am 15.02.2027	4.000	4.054	0,07	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.05.2027	€ 5.000	6.833	0,13	Outfront Media Capital LLC 4,250 % fällig am 15.01.2029	2.500	2.521	0,05
Legends Hospitality Holding Co. LLC 5,000 % fällig am 01.02.2026	1.750	1.827	0,03	3,625 % fällig am 15.06.2030	7.000	9.889	0,18	4,625 % fällig am 15.03.2030	2.000	2.034	0,04
Lehman Brothers Holdings, Inc. 0,000 % fällig am 31.12.2016 ^	14.200	108	0,00	3,875 % fällig am 15.11.2029	3.000	4.291	0,08	5,000 % fällig am 15.08.2027	4.000	4.148	0,08
Level 3 Financing, Inc. 3,625 % fällig am 15.01.2029	4.000	3.866	0,07	4,375 % fällig am 15.11.2026	\$ 5.000	5.692	0,10	6,250 % fällig am 15.06.2025	3.750	3.976	0,07
3,750 % fällig am 15.07.2029	4.000	3.895	0,07	4,875 % fällig am 15.04.2028	5.000	5.819	0,11	Ovintiv Exploration, Inc. 5,375 % fällig am 01.01.2026	2.500	2.820	0,05
4,250 % fällig am 01.07.2028	5.000	5.080	0,09	5,375 % fällig am 15.11.2029	2.000	2.432	0,04	Ovintiv, Inc. 6,500 % fällig am 15.08.2034	3.000	3.967	0,07
5,250 % fällig am 15.03.2026	3.000	3.100	0,06	Nexstar Broadcasting, Inc. 4,750 % fällig am 01.11.2028	4.000	4.115	0,08	Par Pharmaceutical, Inc. 7,500 % fällig am 01.04.2027	8.964	9.176	0,17
5,375 % fällig am 01.05.2025	5.000	5.113	0,09	5,625 % fällig am 15.07.2027	7.500	7.959	0,15	Park Intermediate Holdings LLC 4,875 % fällig am 15.05.2029	5.750	5.955	0,11
Levi Strauss & Co. 3,500 % fällig am 01.03.2031	5.000	4.986	0,09	NextEra Energy Operating Partners LP 4,250 % fällig am 15.07.2024	4.000	4.225	0,08	7,500 % fällig am 01.06.2025	7.500	8.154	0,15
Live Nation Entertainment, Inc. 4,750 % fällig am 15.10.2027	1.000	1.038	0,02	4,250 % fällig am 15.09.2024	262	277	0,01	Paysafe Finance PLC 3,000 % fällig am 15.06.2029	€ 1.875	2.238	0,04
4,875 % fällig am 01.11.2024	4.000	4.072	0,07	4,500 % fällig am 15.09.2027	5.000	5.421	0,10	4,000 % fällig am 15.06.2029	\$ 4.500	4.438	0,08
6,500 % fällig am 15.05.2027	5.000	5.564	0,10	Nielsen Finance LLC 4,500 % fällig am 15.07.2029	2.500	2.510	0,05	PDC Energy, Inc. 5,750 % fällig am 15.05.2026	5.250	5.491	0,10
LogMeIn, Inc. 5,500 % fällig am 01.09.2027	4.875	5.056	0,09	4,750 % fällig am 15.07.2031	5.000	5.019	0,09	6,125 % fällig am 15.09.2024	5.000	5.129	0,09
Lumen Technologies, Inc. 4,500 % fällig am 15.01.2029	1.750	1.710	0,03	5,625 % fällig am 01.10.2028	3.500	3.701	0,07	Performance Food Group, Inc. 5,500 % fällig am 15.10.2027	5.000	5.262	0,10
4,500 % fällig am 15.12.2026	2.500	2.603	0,05	5,875 % fällig am 01.10.2030	5.000	5.455	0,10	6,875 % fällig am 01.05.2025	1.500	1.604	0,03
7,500 % fällig am 01.04.2024	4.000	4.495	0,08	Novelis Corp. 4,750 % fällig am 30.01.2030	10.000	10.512	0,19	PetSmart, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2028	12.000	12.480	0,23
Madison IAQ LLC 4,125 % fällig am 30.06.2028	7.500	7.584	0,14	5,875 % fällig am 30.09.2026	10.000	10.415	0,19	7,750 % fällig am 15.02.2029	8.500	9.382	0,17
5,875 % fällig am 30.06.2029	7.000	7.131	0,13	NRG Energy, Inc. 3,375 % fällig am 15.02.2029	4.250	4.174	0,08	PG&E Corp. 5,000 % fällig am 01.07.2028	2.000	2.025	0,04
Marriott Ownership Resorts, Inc. 4,500 % fällig am 15.06.2029	2.600	2.639	0,05	3,625 % fällig am 15.02.2031	3.750	3.690	0,07	5,250 % fällig am 01.07.2030	4.000	4.049	0,07
6,125 % fällig am 15.09.2025	1.000	1.066	0,02	6,625 % fällig am 15.01.2027	3.500	3.628	0,07	Post Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 15.09.2031	11.000	10.996	0,20
6,500 % fällig am 15.09.2026	2.500	2.600	0,05	7,250 % fällig am 15.05.2026	5.000	5.196	0,10	4,625 % fällig am 15.04.2030	8.500	8.654	0,16
Mattel, Inc. 3,750 % fällig am 01.04.2029	5.000	5.207	0,10	NSG Holdings LLC 7,750 % fällig am 15.12.2025	1.714	1.832	0,03	5,500 % fällig am 15.12.2029	5.000	5.373	0,10
5,875 % fällig am 15.12.2027	5.000	5.457	0,10	NuStar Logistics LP 5,750 % fällig am 01.10.2025	4.250	4.635	0,09	5,625 % fällig am 15.01.2028	7.250	7.707	0,14
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 4,750 % fällig am 15.04.2024	€ 6.500	7.716	0,14	6,375 % fällig am 01.10.2030	3.625	4.015	0,07	5,750 % fällig am 01.03.2027	5.000	5.237	0,10
5,500 % fällig am 15.04.2024	\$ 9.000	9.101	0,17	Occidental Petroleum Corp. 1,606 % fällig am 15.08.2022	22.000	21.897	0,40	Prime Healthcare Services, Inc. 7,250 % fällig am 01.11.2025	10.000	10.839	0,20
				2,900 % fällig am 15.08.2024	4.000	4.095	0,08	Prime Security Services Borrower LLC 3,375 % fällig am 31.08.2027	7.000	6.799	0,13
				3,500 % fällig am 15.06.2025	\$ 3.000	3.071	0,06	5,250 % fällig am 15.04.2024	5.000	5.364	0,10
								5,750 % fällig am 15.04.2026	5.000	5.536	0,10
								6,250 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.325	0,10
								Qorvo, Inc. 4,375 % fällig am 15.10.2029	15.000	16.372	0,30

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES MARKT- WERT (000S) MÖGENS		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES MARKT- WERT (000S) MÖGENS		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES MARKT- WERT (000S) MÖGENS	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS
QualityTech LP				SRS Distribution, Inc.				TriNet Group, Inc.			
3,875 % fällig am 01.10.2028	\$ 4.125	\$ 4.416	0,08	4,625 % fällig am 01.07.2028	\$ 5.000	\$ 5.119	0,09	3,500 % fällig am 01.03.2029	\$ 5.000	\$ 4.940	0,09
Quicken Loans LLC				6,125 % fällig am 01.07.2029	1.500	1.547	0,03	TripAdvisor, Inc.			
3,625 % fällig am 01.03.2029	1.750	1.732	0,03	Standard Industries, Inc.				7,000 % fällig am 15.07.2025	3.000	3.234	0,06
3,875 % fällig am 01.03.2031	3.000	3.026	0,06	2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 14.000	16.557	0,31	Triumph Group, Inc.			
Radiate Holdco LLC				3,375 % fällig am 15.01.2031	\$ 7.500	7.189	0,13	8,875 % fällig am 01.06.2024	4.196	4.673	0,09
4,500 % fällig am 15.09.2026	6.000	6.225	0,11	4,375 % fällig am 15.07.2030	7.250	7.498	0,14	Twillio, Inc.			
6,500 % fällig am 15.09.2028	5.000	5.260	0,10	4,750 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.240	0,10	3,625 % fällig am 15.03.2029	4.000	4.085	0,08
Range Resources Corp.				5,000 % fällig am 15.02.2027	4.000	4.148	0,08	3,875 % fällig am 15.03.2031	3.875	3.982	0,07
5,000 % fällig am 15.03.2023	1.121	1.163	0,02	Staples, Inc.				Twitter, Inc.			
8,250 % fällig am 15.01.2029	2.750	3.104	0,06	7,500 % fällig am 15.04.2026	10.000	10.370	0,19	3,875 % fällig am 15.12.2027	3.500	3.723	0,07
9,250 % fällig am 01.02.2026	2.000	2.209	0,04	Station Casinos LLC				U.S. Concrete, Inc.			
Rattler Midstream LP				4,500 % fällig am 15.02.2028	4.000	4.076	0,07	5,125 % fällig am 01.03.2029	2.500	2.739	0,05
5,625 % fällig am 15.07.2025	2.250	2.368	0,04	5,000 % fällig am 01.10.2025	2.643	2.691	0,05	U.S. Foods, Inc.			
RBS Global, Inc.				Suburban Propane Partners LP				4,750 % fällig am 15.02.2029	7.500	7.660	0,14
4,875 % fällig am 15.12.2025	10.000	10.232	0,19	5,000 % fällig am 01.06.2031	5.750	5.894	0,11	6,250 % fällig am 15.04.2025	5.750	6.102	0,11
Reynolds Group Issuer, Inc.				Summer BC Bidco LLC				United Airlines, Inc.			
4,000 % fällig am 15.10.2027	13.000	12.926	0,24	5,500 % fällig am 31.10.2026 (a)	5.000	5.090	0,09	4,375 % fällig am 15.04.2026	4.000	4.146	0,08
RHP Hotel Properties LP				Sunoco LP				4,625 % fällig am 15.04.2029	5.000	5.181	0,10
4,500 % fällig am 15.02.2029	7.500	7.526	0,14	4,500 % fällig am 15.05.2029	4.000	4.082	0,07	United Rentals North America, Inc.			
4,750 % fällig am 15.10.2027	4.000	4.115	0,08	5,500 % fällig am 15.02.2026	2.500	2.585	0,05	3,875 % fällig am 15.02.2031	4.000	4.075	0,07
Rockies Express Pipeline LLC				Switch Ltd.				4,000 % fällig am 15.07.2030	5.000	5.160	0,09
3,800 % fällig am 15.05.2025	1.500	1.530	0,03	3,750 % fällig am 15.09.2028	5.000	5.073	0,09	4,875 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.309	0,10
4,800 % fällig am 15.05.2030	2.000	2.004	0,04	Syneos Health, Inc.				5,500 % fällig am 15.05.2027	6.000	6.367	0,12
4,950 % fällig am 15.07.2029	4.000	4.131	0,08	3,625 % fällig am 15.01.2029	4.000	3.965	0,07	5,875 % fällig am 15.09.2026	1.500	1.556	0,03
Sabre GBL, Inc.				T-Mobile USA, Inc.				United Wholesale Mortgage LLC			
7,375 % fällig am 01.09.2025	3.500	3.811	0,07	2,250 % fällig am 15.02.2026	2.875	2.900	0,05	5,500 % fällig am 15.11.2025	5.250	5.452	0,10
9,250 % fällig am 15.04.2025	2.000	2.383	0,04	2,625 % fällig am 15.02.2029	7.000	6.921	0,13	Univision Communications, Inc.			
SBA Communications Corp.				2,875 % fällig am 15.02.2031	7.750	7.702	0,14	4,500 % fällig am 01.05.2029	12.000	12.118	0,22
3,125 % fällig am 01.02.2029	7.000	6.765	0,12	3,375 % fällig am 15.04.2029	4.000	4.138	0,08	5,125 % fällig am 15.02.2025	10.000	10.233	0,19
3,875 % fällig am 15.02.2027	10.000	10.294	0,19	3,500 % fällig am 15.04.2031	5.000	5.179	0,10	6,625 % fällig am 01.06.2027	7.500	8.136	0,15
Scientific Games International, Inc.				4,500 % fällig am 01.02.2026	4.000	4.088	0,08	9,500 % fällig am 01.05.2025	1.000	1.106	0,02
3,375 % fällig am 15.02.2026	€ 10.000	11.928	0,22	4,750 % fällig am 01.02.2028	2.625	2.815	0,05	Veritas U.S., Inc.			
5,500 % fällig am 15.02.2026	3.850	4.668	0,09	5,375 % fällig am 15.04.2027	5.000	5.330	0,10	7,500 % fällig am 01.09.2025	7.000	7.308	0,13
SCIH Salt Holdings, Inc.				Talen Energy Supply LLC				Vertical U.S. Newco, Inc.			
4,875 % fällig am 01.05.2028	\$ 7.000	7.017	0,13	6,625 % fällig am 15.01.2028	1.500	1.376	0,03	5,250 % fällig am 15.07.2027	4.950	5.222	0,10
6,625 % fällig am 01.05.2029	5.000	5.019	0,09	7,250 % fällig am 15.05.2027	4.000	3.738	0,07	ViaSat, Inc.			
Scripps Escrow, Inc.				Tallgrass Energy Partners LP				5,625 % fällig am 15.09.2025	3.750	3.834	0,07
5,875 % fällig am 15.07.2027	5.000	5.184	0,10	5,500 % fällig am 15.09.2024	1.324	1.345	0,02	5,625 % fällig am 15.04.2027	750	785	0,01
Sealed Air Corp.				5,500 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.094	0,09	6,500 % fällig am 15.07.2028	3.500	3.737	0,07
5,125 % fällig am 01.12.2024	2.500	2.730	0,05	6,000 % fällig am 31.12.2030	3.000	3.127	0,06	VICI Properties LP			
5,250 % fällig am 01.04.2023	5.000	5.296	0,10	7,500 % fällig am 01.10.2025	2.000	2.197	0,04	3,750 % fällig am 15.02.2027	3.000	3.061	0,06
Select Medical Corp.				Targa Resources Partners LP				4,250 % fällig am 01.12.2026	5.000	5.207	0,10
6,250 % fällig am 15.08.2026	7.625	8.138	0,15	4,000 % fällig am 15.01.2032	5.000	5.150	0,09	4,625 % fällig am 01.12.2029	5.000	5.322	0,10
Sensata Technologies, Inc.				4,875 % fällig am 01.02.2031	5.750	6.232	0,11	Vine Energy Holdings LLC			
3,750 % fällig am 15.02.2031	6.000	5.940	0,11	5,000 % fällig am 15.01.2028	6.500	6.866	0,13	6,750 % fällig am 15.04.2029	14.000	14.752	0,27
ServiceMaster Co. LLC				5,500 % fällig am 01.03.2030	7.000	7.707	0,14	Vistra Operations Co. LLC			
7,450 % fällig am 15.08.2027	3.500	4.112	0,08	5,875 % fällig am 15.04.2026	3.000	3.159	0,06	5,000 % fällig am 31.07.2027	3.500	3.598	0,07
Silgan Holdings, Inc.				6,500 % fällig am 15.07.2027	5.000	5.434	0,10	5,625 % fällig am 15.02.2027	3.000	3.116	0,06
2,250 % fällig am 01.06.2028	€ 5.000	5.974	0,11	Team Health Holdings, Inc.				WESCO Distribution, Inc.			
Sinclair Television Group, Inc.				6,375 % fällig am 01.02.2025	7.500	7.148	0,13	5,375 % fällig am 15.06.2024	3.000	3.041	0,06
4,125 % fällig am 01.12.2030	\$ 5.000	4.919	0,09	TEGNA, Inc.				7,125 % fällig am 15.06.2025	8.000	8.656	0,16
5,125 % fällig am 15.02.2027	4.000	4.023	0,07	4,625 % fällig am 15.03.2028	7.000	7.271	0,13	7,250 % fällig am 15.06.2028	8.000	8.921	0,16
5,500 % fällig am 01.03.2030	4.000	4.084	0,07	4,750 % fällig am 15.03.2026	2.000	2.133	0,04	Western Midstream Operating LP			
Sirius XM Radio, Inc.				5,000 % fällig am 15.09.2029	7.500	7.869	0,14	4,350 % fällig am 01.02.2025	5.000	5.290	0,10
4,000 % fällig am 15.07.2028	10.000	10.312	0,19	Tempo Acquisition LLC				5,300 % fällig am 01.02.2030	8.250	9.264	0,17
4,125 % fällig am 01.07.2030	5.000	5.057	0,09	5,750 % fällig am 01.06.2025	4.000	4.223	0,08	5,450 % fällig am 01.04.2044	4.000	4.329	0,08
5,000 % fällig am 01.08.2027	5.000	5.251	0,10	6,750 % fällig am 01.06.2025	10.000	10.169	0,19	6,500 % fällig am 01.02.2050	15.000	17.409	0,32
5,500 % fällig am 01.07.2029	2.250	2.455	0,04	Tenet Healthcare Corp.				White Cap Buyer LLC			
Southwestern Energy Co.				4,625 % fällig am 15.07.2024	3.000	3.051	0,06	6,875 % fällig am 15.10.2028	5.750	6.162	0,11
7,500 % fällig am 01.04.2026	4.000	4.240	0,08	4,625 % fällig am 15.06.2028	5.000	5.154	0,09	White Cap Parent LLC (8,250 % bar oder 8,250 % PIK)			
Spectrum Brands, Inc.				4,875 % fällig am 01.01.2026	4.000	4.154	0,08	8,250 % fällig am 15.03.2026 (b)	3.000	3.115	0,06
3,875 % fällig am 15.03.2031	4.750	4.684	0,09	5,125 % fällig am 01.11.2027	5.000	5.250	0,10	WMG Acquisition Corp.			
4,000 % fällig am 01.10.2026	€ 4.000	4.862	0,09	6,125 % fällig am 01.10.2028	12.750	13.623	0,25	2,750 % fällig am 15.07.2028	€ 5.000	6.086	0,11
5,000 % fällig am 01.10.2029	\$ 2.000	2.126	0,04	6,250 % fällig am 01.02.2027	4.000	4.180	0,08	3,875 % fällig am 15.07.2030	\$ 7.000	7.087	0,13
5,750 % fällig am 15.07.2025	480	492	0,01	7,500 % fällig am 15.06.2023	8.250	9.013	0,17	WR Grace & Co-Conn			
Spirit AeroSystems, Inc.				7,500 % fällig am 01.04.2025	2.000	2.163	0,04	4,875 % fällig am 15.06.2027	5.000	5.308	0,10
5,500 % fällig am 15.01.2025	2.750	2.930	0,05	TerraForm Power Operating LLC				WW International, Inc.			
7,500 % fällig am 15.04.2025	4.625	4.951	0,09	4,250 % fällig am 31.01.2023	3.000	3.083	0,06	4,500 % fällig am 15.04.2029	5.000	5.044	0,09
Sprint Capital Corp.				4,750 % fällig am 15.01.2030	2.500	2.565	0,05	Wyndham Hotels & Resorts, Inc.			
6,875 % fällig am 15.11.2028	2.000	2.568	0,05	5,000 % fällig am 31.01.2028	7.500	7.963	0,15	4,375 % fällig am 15.08.2028	5.000	5.206	0,10
8,750 % fällig am 15.03.2032	10.000	15.212	0,28	TransDigm, Inc.				Wynn Las Vegas LLC			
Sprint Corp.				4,625 % fällig am 15.01.2029	8.750	8.779	0,16	4,250 % fällig am 30.05.2023	3.000	3.116	0,06
7,125 % fällig am 15.06.2024	10.000	11.550	0,21	5,500 % fällig am 15.11.2027	15.000	15.656	0,29	5,250 % fällig am 15.05.2027	6.500	7.000	0,13
7,625 % fällig am 15.02.2025	14.000	16.651	0,31	6,250 % fällig am 15.03.2026	6.000	6.337	0,12	5,500 % fällig am 01.03.2025	2.000	2.159	0,04
7,875 % fällig am 15.09.2023	17.000	19.335	0,36	6,375 % fällig am 15.06.2026	5.000	5.186	0,10	Yum! Brands, Inc.			
SPX FLOW, Inc.				Travel + Leisure Co.				3,625 % fällig am 15.03.2031	5.000	4.981	0,09
5,875 % fällig am 15.08.2026	7.750	8.028	0,15	4,625 % fällig am 01.03.2030	5.000	5.173	0,10				
				6,625 % fällig am 31.07.2026	4.000	4.544	0,08				

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
HUS	07.2021	€ 5.008	\$ 6.069	\$ 130	\$ 0	\$ 130	0,00
	07.2021	\$ 13.957	€ 11.730	0	(47)	(47)	0,00
	07.2021	93.288	£ 67.401	0	(177)	(177)	0,00
	08.2021	£ 67.401	\$ 93.296	176	0	176	0,00
MYI	07.2021	€ 16.280	€ 19.608	302	0	302	0,01
	07.2021	£ 1.202	1.668	7	0	7	0,00
	07.2021	SGD 12	9	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 9.634	€ 8.092	0	(37)	(37)	0,00
	07.2021	21.937	£ 15.782	0	(134)	(134)	0,00
SSB	07.2021	SGD 1	\$ 1	0	0	0	0,00
TOR	07.2021	13	10	0	0	0	0,00
				\$ 41.254	\$ (574)	\$ 40.680	0,75

ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 19.967	CHF 17.912	\$ 0	\$ (589)	\$ (589)	(0,01)
BRC	07.2021	41	37	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2021	CHF 18.227	\$ 19.799	80	0	80	0,00
	07.2021	\$ 19.997	CHF 17.930	0	(600)	(600)	(0,01)
	08.2021	19.815	18.227	0	(80)	(80)	0,00
GLM	07.2021	131	118	0	(3)	(3)	0,00
MYI	07.2021	19.721	17.768	0	(499)	(499)	(0,01)
SCX	07.2021	149	136	0	(2)	(2)	0,00
SSB	07.2021	36	32	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07.2021	54	50	0	0	0	0,00
				\$ 80	\$ (1.775)	\$ (1.695)	(0,03)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 28.434	€ 23.509	\$ 0	\$ (555)	\$ (555)	(0,01)
BPS	07.2021	€ 17.991	\$ 21.481	146	0	146	0,00
	07.2021	\$ 604.954	€ 494.850	0	(18.111)	(18.111)	(0,33)
BRC	07.2021	1.094	898	0	(29)	(29)	0,00
GLM	07.2021	6.175	5.094	0	(133)	(133)	0,00
HUS	07.2021	€ 3.989	\$ 4.860	129	0	129	0,00
	07.2021	\$ 88.257	€ 73.198	0	(1.452)	(1.452)	(0,03)
MYI	07.2021	10.964	9.209	0	(43)	(43)	0,00
SCX	07.2021	688.568	562.848	0	(21.086)	(21.086)	(0,39)
TOR	07.2021	688.160	562.513	0	(21.075)	(21.075)	(0,39)
UAG	07.2021	151	124	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 275	\$ (62.488)	\$ (62.213)	(1,15)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 58	\$ 81	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2021	\$ 3.191	£ 2.276	0	(46)	(46)	0,00
BRC	07.2021	2.911	2.065	0	(59)	(59)	0,00
GLM	07.2021	361.699	255.848	0	(8.258)	(8.258)	(0,15)
HUS	07.2021	£ 278.424	\$ 385.521	892	0	892	0,01
	07.2021	\$ 1.510	£ 1.065	0	(39)	(39)	0,00
	08.2021	378.330	273.323	0	(714)	(714)	(0,01)
MYI	07.2021	4.163	2.980	0	(46)	(46)	0,00
RYL	07.2021	150	106	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2021	462	327	0	(11)	(11)	0,00
SSB	07.2021	£ 273.323	\$ 377.712	130	0	130	0,00
	07.2021	\$ 360.679	£ 254.540	0	(9.044)	(9.044)	(0,17)
	08.2021	377.742	273.323	0	(127)	(127)	0,00
UAG	07.2021	362.503	255.848	0	(9.061)	(9.061)	(0,17)
				\$ 1.023	\$ (27.408)	\$ (26.385)	(0,49)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global High Yield Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 3.661	\$ 2.727	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	08.2021	\$ 2.727	SGD 3.661	0	(3)	(3)	0,00
BPS	07.2021	2.694	3.564	0	(43)	(43)	0,00
GLM	07.2021	6	8	0	0	0	0,00
	08.2021	4	6	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	2.695	3.566	0	(42)	(42)	0,00
MYI	07.2021	SGD 3.663	\$ 2.725	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 2.725	SGD 3.663	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	2.674	3.544	0	(37)	(37)	0,00
SSB	07.2021	135	179	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07.2021	3	4	0	0	0	0,00
				\$ 3	\$ (127)	\$ (124)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (48.678)	(0,90)
Summe Anlagen						\$ 5.370.757	99,06
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 50.890	0,94
Nettovermögen						\$ 5.421.647	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Associated Materials Group, Inc.	24.08.2020	\$ 10.293	\$ 11.477	0,21
Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032	11.01.2021 - 16.03.2021	6.942	7.132	0,13
Diamond Assets LLC 13,000 % fällig am 22.04.2027	12.05.2021	66	66	0,00
Diamond Offshore Drilling, Inc.	12.05.2021	0	176	0,00
Noble Corp.	05.02.2021 - 08.02.2021	2.223	4.982	0,09
Occidental Petroleum Corp. 6,125 % fällig am 01.01.2031	08.12.2020	1.250	1.472	0,03
		\$ 20.774	\$ 25.305	0,46

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 19.359 als Sicherheiten verpfändet.

(k) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 37.424 und Barmittel in Höhe von USD 23.160 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 22.173 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 4.982	\$ 4.917.440	\$ 11.696	\$ 4.934.118
Investmentfonds	481.359	0	0	481.359
Finanzderivate ⁽³⁾	0	(44.720)	0	(44.720)
Summen	\$ 486.341	\$ 4.872.720	\$ 11.696	\$ 5.370.757

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 4.853.341	\$ 13.655	\$ 4.866.996
Investmentfonds	471.018	0	0	471.018
Finanzderivate ⁽³⁾	0	70.096	0	70.096
Summen	\$ 471.018	\$ 4.923.437	\$ 13.655	\$ 5.408.110

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	(2,500) %	04.03.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (970)	\$ (1.141)	(0,02)
	(1,350)	12.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(2.864)	(3.396)	(0,06)
	(1,250)	15.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(4.954)	(5.872)	(0,11)
	(1,000)	26.03.2021	TBD ⁽¹⁾	£ (5.020)	(6.917)	(0,13)
FBF	(1,500)	23.06.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (1.951)	(2.313)	(0,04)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (19.639)	(0,36)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (959)	\$ 654	\$ (305)
BPS	20.295	(17.750)	2.545
BRC	(147)	0	(147)
CBK	(600)	411	(189)
GLM	(5.695)	5.050	(645)
HUS	(1.144)	801	(343)
JPM	296	(270)	26
MYC	49	(170)	(121)
MYI	(450)	282	(168)
RYL	(3)	0	(3)
SCX	(21.136)	18.535	(2.601)
SSB	(9.044)	8.178	(866)
TOR	(21.075)	18.540	(2.535)
UAG	(9.065)	8.132	(933)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	53,20	53,83
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	37,05	35,12
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,76	1,12
Investmentfonds	8,88	8,72
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,07	0,12
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,90)	1,18
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,36)	(0,14)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Belgien	0,16	0,08
Bermudas	0,35	0,35
Kanada	2,61	3,18
Cayman Inseln	0,74	0,57
Dänemark	0,27	0,26
Finnland	0,15	0,15
Frankreich	2,17	2,16
Deutschland	3,41	3,37
Irland	0,25	0,18
Italien	3,59	2,85
Japan	0,14	k. A.
Jersey, Kanalinseln	0,25	0,27

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Liberia	0,19	0,06
Luxemburg	2,82	2,84
Mauritius	0,13	0,13
Multinational	2,04	1,54
Niederlande	4,86	5,14
Norwegen	0,22	0,23
Panama	0,41	0,15
Spanien	0,64	0,67
Schweden	0,76	0,52
Schweiz	0,10	0,10
Großbritannien	4,09	4,35
USA	59,91	60,20
Kurzfristige Instrumente	0,75	0,72
Investmentfonds	8,88	8,72
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes- Schutzverkauf	0,07	0,12
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	0,02	0,41
Devisenterminkontrakte	0,75	(0,50)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,67)	1,27
Sonstige Aktiva und Passiva	0,94	(0,09)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				BELGIEN				BRASILIEN			
ARGENTINIEN				BERMUDAS				KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
YPF S.A.				MAPS Ltd.				Air Canada Pass-Through Trust			
40,115 % fällig am 24.07.2021	ARS	250.453 \$	1.499 0,01	4,212 % fällig am 15.05.2043	\$	8.625	8.654 0,04	3,300 % fällig am 15.07.2031	2.907	2.951	0,01
AUSTRALIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Driver Australia Five Trust				S-Jets Ltd.				3,600 % fällig am 15.09.2028	7.134	7.271	0,03
0,942 % fällig am 21.07.2026	AUD	3.557	2.674 0,01	3,967 % fällig am 15.08.2042	16.176	16.033	0,08	3,750 % fällig am 15.06.2029	3.187	3.319	0,02
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Boral Finance Pty. Ltd.				START Ireland PLC				4,125 % fällig am 15.11.2026	4.041	4.169	0,02
3,750 % fällig am 01.05.2028	\$	6.800	7.341 0,03	4,089 % fällig am 15.03.2044	3.930	3.977	0,02	5,250 % fällig am 01.10.2030	4.967	5.399	0,03
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
CIMIC Finance Ltd.				Aircastle Ltd.				Bank of Nova Scotia			
1,500 % fällig am 28.05.2029	€	12.500	15.074 0,07	2,850 % fällig am 26.01.2028	6.800	6.838	0,03	4,900 % fällig am 04.06.2025 (f)(h)	26.400	29.040	0,14
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.				4,125 % fällig am 01.05.2024	200	213	0,00	Brookfield Finance, Inc.			
1,900 % fällig am 14.12.2028	AUD	25.100	18.500 0,09	4,250 % fällig am 15.06.2026	3.250	3.532	0,02	3,500 % fällig am 30.03.2051	27.600	28.907	0,13
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
GTA Finance Co. Pty. Ltd.				4,400 % fällig am 25.09.2023	200	214	0,00	4,000 % fällig am 01.04.2024	4.930	5.331	0,02
2,200 % fällig am 26.08.2027		7.200	5.401 0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,700 % fällig am 20.09.2047	2.400	2.939	0,01
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Lendlease Finance Ltd.				Arch Capital Group Ltd.				4,850 % fällig am 29.03.2029	9.434	11.118	0,05
3,400 % fällig am 27.10.2027		10.600	8.436 0,04	3,635 % fällig am 30.06.2050	2.960	3.198	0,01	CI Financial Corp.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Macquarie University				Bacardi Ltd.				3,200 % fällig am 17.12.2030	11.500	11.815	0,06
3,500 % fällig am 07.09.2028		250	208 0,00	2,750 % fällig am 03.07.2023	€	1.500	1.869 0,01	4,100 % fällig am 15.06.2051	7.000	7.330	0,03
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Newcrest Finance Pty. Ltd.				2,750 % fällig am 15.07.2026	\$	1.450	1.512 0,01	Enbridge, Inc.			
5,750 % fällig am 15.11.2041	\$	2.916	3.870 0,02	4,450 % fällig am 15.05.2025	13.000	14.467	0,07	0,655 % fällig am 18.02.2022	5.900	5.915	0,03
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Optus Finance Pty. Ltd.				4,700 % fällig am 15.05.2028	30.400	35.438	0,16	2,500 % fällig am 01.08.2033	11.800	11.832	0,06
1,000 % fällig am 20.06.2029	€	15.800	19.429 0,09	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,125 % fällig am 15.11.2029	1.400	1.501	0,01
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Pacific National Finance Pty. Ltd.				China Resources Gas Group Ltd.				4,250 % fällig am 01.12.2026	11.204	12.635	0,06
4,750 % fällig am 22.03.2028	\$	16.600	18.146 0,09	4,500 % fällig am 05.04.2022	14.300	14.666	0,07	Fairfax Financial Holdings Ltd.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Santos Finance Ltd.				IHS Markit Ltd.				2,750 % fällig am 29.03.2028	€	31.400	40.971 0,19
4,125 % fällig am 14.09.2027		8.700	9.398 0,04	4,000 % fällig am 01.03.2026	7.968	8.859	0,04	4,850 % fällig am 17.04.2028	\$	100	115 0,00
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
SGSP Australia Assets Pty. Ltd.				4,250 % fällig am 01.05.2029	15.000	17.388	0,08	geaesly Ltd.			
3,300 % fällig am 09.04.2023		14.000	14.637 0,07	4,750 % fällig am 01.08.2028	7.000	8.279	0,04	5,375 % fällig am 01.12.2024	1.500	1.552	0,01
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Transurban Finance Co. Pty. Ltd.				5,000 % fällig am 01.11.2022	1.800	1.888	0,01	Masonite International Corp.			
2,450 % fällig am 16.03.2031		5.391	5.433 0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,750 % fällig am 15.09.2026	6.150	6.385	0,03
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Woodside Finance Ltd.				Sompo International Holdings Ltd.				Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust			
3,650 % fällig am 05.03.2025		8.000	8.550 0,04	4,700 % fällig am 15.10.2022	4.500	4.727	0,02	3,875 % fällig am 20.03.2027	6.900	7.618	0,04
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
3,700 % fällig am 15.09.2026		2.300	2.489 0,01	Viking Cruises Ltd.				Transcanada Trust			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
3,700 % fällig am 15.03.2028		8.200	8.813 0,04	13,000 % fällig am 15.05.2025	2.900	3.417	0,02	5,500 % fällig am 15.09.2079	18.500	20.234	0,09
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,500 % fällig am 04.03.2029		36.800	41.259 0,19	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				West Fraser Timber Co. Ltd.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
			209.178 0,98	Summe Brasilien		45.452	0,21	4,350 % fällig am 15.10.2024	6.000	6.421	0,03
NON-AGENCY-MBS				BRASILIEN				STAATSEMISSIONEN			
Progress Trust				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
1,560 % fällig am 18.06.2044	AUD	5.394	4.080 0,02	Banco Bradesco S.A.				Canada Government International Bond			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				2,850 % fällig am 27.01.2023	10.600	10.847	0,05	2,750 % fällig am 01.12.2048	CAD	500	485 0,00
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Australia Government International Bond				3,200 % fällig am 27.01.2025	6.200	6.387	0,03	Province of Ontario			
1,000 % fällig am 21.11.2031		55.200	39.343 0,19	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,050 % fällig am 02.06.2030	12.500	10.210	0,05
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
1,750 % fällig am 21.06.2051		61.000	40.500 0,19	Banco BTG Pactual S.A.				2,600 % fällig am 02.06.2025	161.500	137.924	0,64
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
			79.843 0,38	4,500 % fällig am 10.01.2025	19.000	19.925	0,09	3,150 % fällig am 02.06.2022	14.750	12.224	0,06
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Summe Australien			295.775 1,39	5,500 % fällig am 31.01.2023	21.977	23.187	0,11	3,500 % fällig am 02.06.2024	11.400	9.914	0,05
ÖSTERREICH				BRASILIEN				STAATSEMISSIONEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Erste Group Bank AG				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,250 % fällig am 15.10.2027 (f)(h)	€	26.200	33.326 0,16	Banco Daycoval S.A.				Province of Quebec			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,125 % fällig am 15.10.2025 (f)(h)		8.000	10.506 0,05	4,250 % fällig am 13.12.2024	32.850	34.098	0,16	1,900 % fällig am 01.09.2030	4.800	3.882	0,02
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
8,875 % fällig am 15.10.2021 (f)(h)		1.800	2.188 0,01	Banco do Brasil S.A.				3,500 % fällig am 01.12.2022	26.900	22.669	0,10
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
IMMOFINANZ AG				4,625 % fällig am 15.01.2025	13.963	14.920	0,07	Summe Kanada		432.076	2,02
2,500 % fällig am 15.10.2027		21.900	26.887 0,12	4,750 % fällig am 20.03.2024	1.700	1.817	0,01	CAYMAN INSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Sappi Papier Holding GmbH				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
3,125 % fällig am 15.04.2026 (j)		3.900	4.654 0,02	Banco Votorantim S.A.				Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
			77.561 0,36	4,000 % fällig am 24.09.2022	10.100	10.438	0,05	4,213 % fällig am 16.12.2041	\$	6.516	6.535 0,03
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Summe Österreich				4,500 % fällig am 24.09.2024	1.300	1.374	0,01	ECAF Ltd.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				Cielo USA, Inc.				4,947 % fällig am 15.06.2040	10.986	10.349	0,05
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				CSN Inova Ventures				KDAC Aviation Finance Ltd.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				6,750 % fällig am 28.01.2028	900	996	0,00	4,212 % fällig am 15.12.2042	6.600	6.376	0,03
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				CSN Resources S.A.				METAL Cayman LLC			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				7,625 % fällig am 17.04.2026	4.600	4.966	0,02	4,581 % fällig am 15.10.2042	14.006	12.547	0,06

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Sapphire Aviation Finance Ltd. 4,250 % fällig am 15.03.2040	\$ 11.557	\$ 11.338	0,05	New Metro Global Ltd. 4,500 % fällig am 02.05.2026	\$ 4.400	\$ 4.324	0,02	CHINA			
Sprite Ltd. 4,250 % fällig am 15.12.2037	9.757	9.712	0,04	6,800 % fällig am 05.08.2023	13.700	14.267	0,07	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Thunderbolt Aircraft Lease Ltd. 4,212 % fällig am 17.05.2032	3.709	3.714	0,02	Odebrecht Drilling Norge Ltd. 6,350 % fällig am 01.12.2021 ^	108	108	0,00	Amber Circle Funding Ltd. 3,250 % fällig am 04.12.2022	\$ 35.825	\$ 37.050	0,17
		60.571	0,28	Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.03.2023	22.790	23.961	0,11	Amipeace Ltd. 2,250 % fällig am 22.10.2030	300	294	0,00
				5,250 % fällig am 15.08.2022	13.558	14.190	0,07	Bank of China Luxembourg S.A. 0,125 % fällig am 16.01.2023	€ 16.800	20.009	0,09
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Powerlong Real Estate Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 30.04.2025	30.900	32.025	0,15	China Construction Bank New Zealand Ltd. 0,885 % fällig am 20.12.2021	\$ 12.500	12.522	0,06
21Vianet Group, Inc. 7,875 % fällig am 15.10.2021	13.900	13.935	0,07	6,250 % fällig am 10.08.2024	14.700	15.251	0,07	China Southern Power Grid International Finance BVI Co. Ltd. 3,875 % fällig am 18.09.2023	600	638	0,00
Alibaba Group Holding Ltd. 2,125 % fällig am 09.02.2031	11.800	11.611	0,05	QNB Finance Ltd. 1,176 % fällig am 02.05.2022	28.500	28.644	0,13	CNPC Global Capital Ltd. 1,125 % fällig am 23.06.2023	2.500	2.506	0,01
2,700 % fällig am 09.02.2041	3.900	3.732	0,02	1,256 % fällig am 12.02.2022	34.900	35.054	0,16	1,350 % fällig am 23.06.2025	2.500	2.494	0,01
3,150 % fällig am 09.02.2051	12.500	12.325	0,06	1,375 % fällig am 26.01.2026	2.300	2.288	0,01	Greenland Global Investment Ltd. 6,125 % fällig am 22.04.2023	7.200	6.111	0,03
4,400 % fällig am 06.12.2057	600	721	0,00	3,500 % fällig am 28.03.2024	15.500	16.555	0,08	6,250 % fällig am 16.12.2022	2.100	2.015	0,01
Ambac LSNi LLC 6,000 % fällig am 12.02.2023	13.431	13.439	0,06	Sands China Ltd. 3,800 % fällig am 08.01.2026	4.200	4.501	0,02	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 2,250 % fällig am 16.09.2022	2.600	2.647	0,01
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025	11.100	11.436	0,05	4,600 % fällig am 08.08.2023	5.600	5.966	0,03	New Metro Global Ltd. 4,800 % fällig am 15.12.2024	12.400	12.510	0,06
3,950 % fällig am 01.07.2024	1.300	1.387	0,01	5,125 % fällig am 08.08.2025	14.600	16.349	0,08	7,500 % fällig am 16.12.2021	36.148	36.870	0,17
4,250 % fällig am 15.04.2026	3.800	4.121	0,02	5,400 % fällig am 08.08.2028	23.298	27.077	0,13	SF Holding Investment Ltd. 4,125 % fällig am 26.07.2023	3.100	3.279	0,02
4,375 % fällig am 01.05.2026	2.510	2.731	0,01	Seagate HDD Cayman 4,091 % fällig am 01.06.2029	798	818	0,00	Shanghai Port Group BVI Development Co. Ltd. 2,375 % fällig am 13.07.2030	13.300	13.386	0,06
5,125 % fällig am 01.10.2023	485	524	0,00	4,125 % fällig am 15.01.2031	10.800	11.030	0,05	3,375 % fällig am 18.06.2029	8.300	8.999	0,04
5,500 % fällig am 15.01.2023	3.100	3.293	0,02	Seazen Group Ltd. 4,450 % fällig am 13.07.2025 (j)	16.400	16.280	0,08	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 2,300 % fällig am 08.01.2031	4.700	4.692	0,02
5,500 % fällig am 15.01.2026	20.900	23.729	0,11	6,000 % fällig am 12.08.2024	6.700	6.985	0,03	2,500 % fällig am 13.09.2022	6.600	6.742	0,03
Baidu, Inc. 4,875 % fällig am 14.11.2028	2.700	3.198	0,02	6,450 % fällig am 11.06.2022	4.330	4.425	0,02	2,700 % fällig am 13.05.2030	14.000	14.467	0,07
China Mengniu Dairy Co. Ltd. 1,875 % fällig am 17.06.2025	14.300	14.455	0,07	Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 26.04.2024	13.700	13.511	0,06	3,900 % fällig am 17.05.2022	300	308	0,00
2,500 % fällig am 17.06.2030	4.600	4.601	0,02	6,500 % fällig am 09.07.2023	5.700	5.807	0,03	SPIC MTN Co. Ltd. 1,625 % fällig am 27.07.2025	20.100	20.067	0,10
4,250 % fällig am 07.08.2023	500	533	0,00	6,500 % fällig am 10.01.2025	4.800	4.725	0,02	State Grid Overseas Investment Ltd. 0,797 % fällig am 05.08.2025	€ 13.923	16.878	0,08
CIFI Holdings Group Co. Ltd. 4,375 % fällig am 12.04.2027	4.400	4.324	0,02	6,500 % fällig am 26.01.2026	13.200	12.756	0,06	1,000 % fällig am 05.08.2025	\$ 1.700	1.683	0,01
6,450 % fällig am 07.11.2024	5.900	6.251	0,03	6,650 % fällig am 03.08.2024	16.500	16.583	0,08	1,625 % fällig am 05.08.2030	15.800	15.048	0,07
6,550 % fällig am 28.03.2024	5.000	5.260	0,02	7,000 % fällig am 09.07.2025	7.200	7.083	0,03	2,125 % fällig am 02.05.2030	€ 5.800	7.551	0,04
Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,125 % fällig am 22.10.2025	62.850	63.241	0,30	7,500 % fällig am 01.02.2024	3.100	3.170	0,02	Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 17.02.2025	\$ 4.500	4.061	0,02
3,300 % fällig am 12.01.2031	8.825	8.331	0,04	8,350 % fällig am 19.04.2023	2.700	2.800	0,01	10,250 % fällig am 18.03.2022	2.700	2.720	0,01
3,875 % fällig am 22.10.2030	17.800	17.581	0,08	Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 3,750 % fällig am 23.01.2023	22.614	23.422	0,11	Yili Holding Investment Ltd. 1,625 % fällig am 19.11.2025	31.000	30.948	0,15
5,125 % fällig am 14.01.2027	8.700	9.305	0,04	Tencent Holdings Ltd. 2,390 % fällig am 03.06.2030	12.700	12.668	0,06			286.495	1,34
Foxconn Far East Ltd. 1,625 % fällig am 28.10.2025	36.500	36.746	0,17	2,880 % fällig am 22.04.2031	2.100	2.174	0,01	STAATSEMISSIONEN			
Geely Automobile Holdings Ltd. 3,625 % fällig am 25.01.2023	12.400	12.760	0,06	3,240 % fällig am 03.06.2050	5.500	5.399	0,03	China Development Bank 0,000 % fällig am 27.10.2023 (e)	€ 6.200	7.356	0,03
4,000 % fällig am 09.12.2024 (f)	28.200	29.235	0,14	3,290 % fällig am 03.06.2060	5.000	4.894	0,02	0,375 % fällig am 16.11.2021	14.100	16.749	0,08
Goodman HK Finance 4,375 % fällig am 19.06.2024	3.700	4.015	0,02	3,595 % fällig am 19.01.2028	4.700	5.153	0,02			24.105	0,11
Kaisa Group Holdings Ltd. 8,500 % fällig am 30.06.2022	1.000	998	0,00	3,975 % fällig am 11.04.2029	57.450	64.152	0,30	Summe China		310.600	1,45
9,375 % fällig am 30.06.2024	7.950	7.523	0,04	Times China Holdings Ltd. 6,600 % fällig am 02.03.2023	400	407	0,00	KOLUMBIEN			
9,750 % fällig am 28.09.2023	20.700	20.468	0,10	6,750 % fällig am 16.07.2023	2.000	2.055	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
10,875 % fällig am 23.07.2023	5.100	5.107	0,02	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1,625 % fällig am 24.09.2025	12.300	12.233	0,06	BanColombia S.A. 3,000 % fällig am 29.01.2025	\$ 7.400	7.609	0,04
11,250 % fällig am 09.04.2022	15.300	15.652	0,07	Trafford Centre Finance Ltd. 7,030 % fällig am 28.01.2029	£ 228	348	0,00	DÄNEMARK			
11,500 % fällig am 30.01.2023	900	914	0,00	Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024	\$ 4.935	5.000	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
11,700 % fällig am 11.11.2025	3.250	3.072	0,01	4,875 % fällig am 15.01.2026	33.400	35.052	0,16	AP Moller - Maersk A/S 3,750 % fällig am 22.09.2024	4.200	4.531	0,02
11,950 % fällig am 22.10.2022	3.300	3.394	0,02	5,500 % fällig am 01.10.2027	41.965	43.789	0,21	4,500 % fällig am 20.06.2029	3.100	3.593	0,02
11,950 % fällig am 12.11.2023	3.100	3.182	0,02	5,625 % fällig am 26.08.2028	7.100	7.424	0,04	Danske Bank A/S 3,001 % fällig am 20.09.2022	1.800	1.809	0,01
KWG Group Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 10.08.2025	2.300	2.294	0,01	XLIT Ltd. 4,450 % fällig am 31.03.2025	3.696	4.151	0,02	5,875 % fällig am 06.04.2022 (f)(h)	€ 7.900	9.708	0,05
6,000 % fällig am 15.09.2022	3.900	3.958	0,02	Yingde Gases Investment Ltd. 6,250 % fällig am 19.01.2023	12.100	12.411	0,06	H Lundbeck A/S 0,875 % fällig am 14.10.2027	12.900	15.576	0,07
7,400 % fällig am 05.03.2024	2.000	2.095	0,01	Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % fällig am 13.01.2026	7.600	7.731	0,04	Nykredit Realkredit A/S 4,125 % fällig am 15.04.2026 (f)(h)	13.400	17.069	0,08
7,875 % fällig am 01.09.2023	3.900	3.993	0,02	Summe Cayman Inseln		1.156.414	5,42	Summe Dänemark		52.286	0,25
Lunar Funding Ltd. 6,125 % fällig am 09.06.2027	£ 50	84	0,00			1.216.985	5,70				
MAF Global Securities Ltd. 4,750 % fällig am 07.05.2024	\$ 8.100	8.847	0,04	CHILE							
Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	52.910	54.220	0,25	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
5,250 % fällig am 26.04.2026	22.250	23.109	0,11	Banco Santander Chile 2,700 % fällig am 10.01.2025	5.400	5.644	0,02				
5,375 % fällig am 04.12.2029	18.327	19.392	0,09	Celexo Redes Operacion Chile S.A. 5,200 % fällig am 22.06.2047	3.479	4.052	0,02				
5,625 % fällig am 17.07.2027	12.355	12.928	0,06	Empresa Electrica Cochran SpA 5,500 % fällig am 14.05.2027	1.533	1.591	0,01				
5,750 % fällig am 21.07.2028	27.600	29.187	0,14	Summe Chile			11,287	0,05			
MGM China Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 18.06.2025	8.800	9.171	0,04								
5,375 % fällig am 15.05.2024	1.455	1.498	0,01								
5,875 % fällig am 15.05.2026	7.146	7.512	0,04								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
FINNLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Balder Finland Oyj 1,000 % fällig am 20.01.2029	€ 15.000	\$ 17.534	0,08
Nokia Oyj 4,375 % fällig am 12.06.2027	\$ 3.000	3.323	0,02
SATO Oyj 1,375 % fällig am 24.02.2028	€ 7.071	8.712	0,04
Summe Finnland		29.569	0,14
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Altarea S.C.A. 1,750 % fällig am 16.01.2030	11.900	14.130	0,07
1,875 % fällig am 17.01.2028	11.900	14.632	0,07
Altareit S.C.A. 2,875 % fällig am 02.07.2025	21.200	26.756	0,13
BEL S.A. 1,500 % fällig am 18.04.2024	200	244	0,00
BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig am 30.06.2027	\$ 3.900	3.901	0,02
1,875 % fällig am 14.12.2027	£ 21.000	29.632	0,14
1,904 % fällig am 30.09.2028	\$ 5.000	4.971	0,02
2,219 % fällig am 09.06.2026	24.600	25.370	0,12
3,500 % fällig am 16.11.2027	23.200	25.332	0,12
4,625 % fällig am 25.02.2031 (f)(h)(j)	13.600	14.192	0,07
6,750 % fällig am 14.03.2022 (f)(h)	1.300	1.345	0,01
7,000 % fällig am 16.08.2028 (f)(h)	6.205	7.456	0,03
7,375 % fällig am 19.08.2025 (f)(h)	10.300	12.013	0,06
BPCE S.A. 1,652 % fällig am 06.10.2026	750	754	0,00
Bureau Veritas S.A. 1,250 % fällig am 07.09.2023	€ 300	365	0,00
1,875 % fällig am 06.01.2025	16.400	20.505	0,10
Ceetrus S.A. 2,750 % fällig am 26.11.2026	3.000	3.892	0,02
Credit Agricole S.A. 4,000 % fällig am 23.12.2027 (f)(h)	3.100	4.024	0,02
7,500 % fällig am 23.06.2026 (f)(h)	£ 5.438	8.951	0,04
ELO SACA 3,250 % fällig am 23.07.2027	€ 2.500	3.442	0,02
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1,625 % fällig am 18.09.2029	3.900	4.881	0,02
Indigo Group S.A.S. 1,625 % fällig am 19.04.2028	10.400	12.889	0,06
Ingenico Group S.A. 1,625 % fällig am 13.09.2024	10.200	12.622	0,06
Loxam S.A.S. 3,750 % fällig am 15.07.2026	800	973	0,00
Peugeot Invest 1,875 % fällig am 30.10.2026	20.600	25.734	0,12
Safran S.A. 0,125 % fällig am 16.03.2026	3.900	4.636	0,02
0,750 % fällig am 17.03.2031	3.100	3.739	0,02
SEB S.A. 1,375 % fällig am 16.06.2025	7.400	9.061	0,04
1,500 % fällig am 31.05.2024	13.000	15.961	0,07
2,375 % fällig am 25.11.2022	2.000	2.437	0,01
Societe Generale S.A. 0,750 % fällig am 25.01.2027	4.700	5.642	0,03
1,488 % fällig am 14.12.2026	\$ 14.300	14.180	0,07
4,000 % fällig am 12.01.2027	2.200	2.437	0,01
7,375 % fällig am 13.09.2021 (f)(h)	11.291	11.420	0,05
TDF Infrastructure SASU 2,500 % fällig am 07.04.2026	€ 16.700	21.520	0,10
2,875 % fällig am 19.10.2022	2.300	2.811	0,01
Teleperformance 1,875 % fällig am 02.07.2025	9.900	12.515	0,06
Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	18.500	21.845	0,10
1,289 % fällig am 30.01.2023	6.900	8.323	0,04
Worldline S.A. 0,250 % fällig am 18.09.2024	9.500	11.360	0,05
0,500 % fällig am 30.06.2023	5.000	6.007	0,03
		432.900	2,03

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Altice France S.A. 3,000 % fällig am 02.02.2026	€ 3.909	\$ 4.571	0,02
Numericable Group S.A. 3,000 % fällig am 31.07.2025	4.295	5.021	0,02
		9.592	0,04
Summe Frankreich		442.492	2,07

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Bayer AG 0,050 % fällig am 12.01.2025	8.200	9.708	0,05
0,625 % fällig am 12.07.2031	1.100	1.263	0,01
Deutsche Bank AG 1,346 % fällig am 16.11.2022	\$ 28.500	28.747	0,13
1,375 % fällig am 03.09.2026	€ 6.600	8.116	0,04
1,375 % fällig am 17.02.2032	3.000	3.614	0,02
1,625 % fällig am 20.01.2027	19.800	24.706	0,12
1,750 % fällig am 19.11.2030	44.800	56.202	0,26
1,875 % fällig am 14.02.2022	10.500	12.616	0,06
1,875 % fällig am 22.12.2028	£ 1.700	2.346	0,01
2,625 % fällig am 16.12.2024	16.400	23.677	0,11
3,035 % fällig am 28.05.2032 (i)	\$ 1.100	1.121	0,01
3,300 % fällig am 16.11.2022	5.700	5.907	0,03
3,547 % fällig am 18.09.2031	33.443	35.637	0,17
3,729 % fällig am 14.01.2032 (i)	33.335	33.962	0,16
3,961 % fällig am 26.11.2025	600	649	0,00
4,250 % fällig am 14.10.2021	69.150	69.902	0,33
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	€ 12.900	15.837	0,07
1,875 % fällig am 31.03.2028	7.100	8.830	0,04
2,125 % fällig am 09.07.2027	13.000	16.494	0,08
Hamburg Commercial Bank AG 0,750 % fällig am 23.11.2023	9.700	11.629	0,05
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK) 3,625 % fällig am 15.05.2025 (c)	300	362	0,00
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)	21.100	25.566	0,12
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,375 % fällig am 15.03.2023	4.900	5.909	0,03
Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	25.000	30.626	0,14
Volkswagen Bank GmbH 1,875 % fällig am 31.01.2024	10.900	13.562	0,06
2,500 % fällig am 31.07.2026	7.100	9.371	0,04
Volkswagen Financial Services AG 0,625 % fällig am 01.04.2022	6.000	7.167	0,03
1,500 % fällig am 01.10.2024	9.800	12.179	0,06
Volkswagen Leasing GmbH 0,000 % fällig am 12.07.2023 (e)	14.300	16.986	0,08
0,500 % fällig am 20.06.2022	12.500	14.935	0,07
1,125 % fällig am 04.04.2024	9.100	11.134	0,05
1,375 % fällig am 20.01.2025	2.800	3.475	0,02
1,500 % fällig am 19.06.2026	12.300	15.487	0,07
Summe Deutschland		537.722	2,52

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
GUERNSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Amdocs Ltd. 2,538 % fällig am 15.06.2030	\$ 15.975	15.993	0,07
Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust 5,125 % fällig am 30.11.2024	8.481	8.525	0,04
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,875 % fällig am 20.06.2022	€ 15.000	18.267	0,09
2,950 % fällig am 29.07.2026	22.700	29.202	0,14
3,000 % fällig am 29.03.2025	6.400	8.167	0,04
Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	7.600	8.990	0,04
Summe Guernsey, Kanalinseln		89.144	0,42

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
HONGKONG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Ala Group Ltd. 2,700 % fällig am 07.04.2026 (f)	\$ 2.500	2.539	0,01
3,900 % fällig am 06.04.2028	5.600	6.299	0,03
CMHI Finance BVI Co. Ltd. 4,375 % fällig am 06.08.2023	\$ 14.800	15.760	0,07
Horse Gallop Finance Ltd. 3,250 % fällig am 30.05.2022	22.000	22.399	0,11
Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023	18.100	13.804	0,06
Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030	10.600	11.099	0,05
5,875 % fällig am 24.04.2025	9.100	10.307	0,05
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3,150 % fällig am 12.05.2025	10.100	10.516	0,05
3,500 % fällig am 12.11.2029	12.000	12.443	0,06
4,150 % fällig am 18.04.2023	36.400	38.106	0,18
4,200 % fällig am 07.06.2024	9.400	10.096	0,05
Yanlord Land HK Co. Ltd. 6,800 % fällig am 27.02.2024	900	947	0,00
		154.315	0,72

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
STAATSEMISSIONEN			
Airport Authority Hong Kong 2,100 % fällig am 08.03.2026 (f)	2.750	2.767	0,02
2,400 % fällig am 08.03.2028 (f)	2.550	2.549	0,01
3,450 % fällig am 21.02.2029	5.900	6.591	0,03
		11.907	0,06
Summe Hongkong		166.222	0,78

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
INDIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Adani Electricity Mumbai Ltd. 3,949 % fällig am 12.02.2030	2.000	2.001	0,01
Adani Transmission Ltd. 4,250 % fällig am 21.05.2036	20.757	21.196	0,10
Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023	5.700	5.880	0,03
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	8.900	9.519	0,04
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,700 % fällig am 27.02.2022	20.500	20.761	0,10
5,950 % fällig am 24.10.2022	21.200	21.720	0,10
State Bank of India 4,000 % fällig am 24.01.2022	2.700	2.746	0,01
		83.823	0,39

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
STAATSEMISSIONEN			
Export-Import Bank of India 1,166 % fällig am 28.03.2022 (i)	19.200	19.275	0,09
3,875 % fällig am 01.02.2028	300	325	0,00
		19.600	0,09
Summe Indien		103.423	0,48

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
INDONESIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Bank Mandiri Persero Tbk PT 3,750 % fällig am 11.04.2024	15.000	15.960	0,08
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT 4,625 % fällig am 20.07.2023	18.000	19.283	0,09
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 3,000 % fällig am 30.06.2030	700	703	0,00
4,000 % fällig am 30.06.2050	8.300	8.259	0,04
4,125 % fällig am 15.05.2027	7.300	7.926	0,04
4,875 % fällig am 17.07.2049	900	983	0,00
6,150 % fällig am 21.05.2048	2.500	3.166	0,02
		56.280	0,27

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
STAATSEMISSIONEN			
Indonesia Government International Bond 2,875 % fällig am 08.07.2021	€ 2.500	2.968	0,01
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,800 % fällig am 23.06.2030	\$ 7.000	7.170	0,03
4,450 % fällig am 20.02.2029	1.000	1.151	0,01
		11.289	0,05
Summe Indonesien		67.569	0,32

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS
Logico Financing SARL				Trust Fibra Uno				Lundin Energy Finance BV			
0,750 % fällig am 15.07.2024	€ 1.000	\$ 1.206	0,01	4,869 % fällig am 15.01.2030	2.100	2.318	0,01	2,000 % fällig am 15.07.2026	\$ 10.700	10.730	0,05
1,500 % fällig am 14.11.2022	40.500	48.914	0,23	6,950 % fällig am 30.01.2044	7.700	9.419	0,05	3,100 % fällig am 15.07.2031	3.200	3.239	0,01
1,500 % fällig am 13.07.2026	11.400	14.216	0,07			170.420	0,80	Nationale-Niederlanden Bank NV			
1,625 % fällig am 15.07.2027	46.500	58.157	0,27					0,375 % fällig am 31.05.2023	€ 3.900	\$ 4.681	0,02
2,750 % fällig am 15.01.2030	€ 3.430	4.985	0,02	STAATSEMISSIONEN				Prosus NV			
3,250 % fällig am 13.11.2028	€ 6.109	8.436	0,04	Mexico Government International Bond				1,539 % fällig am 03.08.2028	3.900	4.792	0,02
Medtronic Global Holdings S.C.A.				3,375 % fällig am 23.02.2031	€ 10.000	13.811	0,06	2,031 % fällig am 03.08.2032	27.480	33.566	0,16
1,625 % fällig am 15.10.2050	17.700	21.614	0,10	Summe Mexiko		184.231	0,86	3,832 % fällig am 08.02.2051	\$ 5.600	5.232	0,02
Prologis International Funding S.A.								4,027 % fällig am 03.08.2050	4.000	3.862	0,02
1,876 % fällig am 17.04.2025	799	1.016	0,00	MULTINATIONAL				Sagax Euro Mtn NL BV			
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,750 % fällig am 26.01.2028	€ 6.200	7.299	0,03
5,125 % fällig am 29.10.2022	\$ 52.050	54.456	0,26	Delta Air Lines, Inc.				Stellantis NV			
5,250 % fällig am 23.05.2023 (h)	13.000	13.791	0,06	4,500 % fällig am 20.10.2025	\$ 15.000	16.126	0,08	0,750 % fällig am 18.01.2029	10.000	11.822	0,05
6,125 % fällig am 07.02.2022	26.350	27.230	0,13	4,750 % fällig am 20.10.2028	3.800	4.228	0,02	Syngenta Finance NV			
SELP Finance SARL				NXP BV				3,375 % fällig am 16.04.2026	22.100	29.224	0,14
1,250 % fällig am 25.10.2023	€ 1.300	1.583	0,01	3,875 % fällig am 01.09.2022	34.900	36.200	0,17	4,441 % fällig am 24.04.2023	\$ 3.300	3.485	0,02
		747.289	3,50	4,625 % fällig am 01.06.2023	3.000	3.225	0,01	4,892 % fällig am 24.04.2025	9.100	10.093	0,05
				Summe multinational		59.779	0,28	5,182 % fällig am 24.04.2028	43.017	49.200	0,23
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				NIEDERLANDE				Volkswagen Financial Services NV			
Delos Finance SARL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,875 % fällig am 20.02.2025	£ 7.500	10.344	0,05
1,897 % fällig am 06.10.2023	\$ 18.243	18.250	0,08	ABN AMRO Bank NV				1,125 % fällig am 18.09.2023	22.400	31.210	0,15
Intelsat Jackson Holdings S.A.				4,375 % fällig am 22.09.2025	€ 11.000	14.137	0,07	1,625 % fällig am 30.11.2022	17.700	24.786	0,12
3,600 % - 6,500 % fällig		2.303	0,01	(f)(h)				1,875 % fällig am 07.09.2021	6.200	8.585	0,04
am 13.07.2022	2.275			Airbus SE				Vonovia Finance BV			
Jazz Financing Lux SARL				2,375 % fällig am 09.06.2040	3.600	4.970	0,02	5,000 % fällig am 02.10.2023	\$ 500	545	0,00
4,000 % fällig am 21.04.2028	7.600	7.637	0,04	ASR Nederland NV				Wabtec Transportation Netherlands BV			
Ortho-Clinical Diagnostics S.A.				3,375 % fällig am 02.05.2049	4.600	6.117	0,03	1,250 % fällig am 03.12.2027	€ 1.500	1.795	0,01
3,089 % fällig am 30.06.2025	2.133	2.134	0,01	4,625 % fällig am 19.10.2027	6.700	8.780	0,04	WPC Eurobond BV			
		30.324	0,14	(f)(h)				1,350 % fällig am 15.04.2028	5.800	7.125	0,03
Summe Luxemburg		777.613	3,64	Atrium Finance Issuer BV						633.852	2,97
				2,625 % fällig am 05.09.2027	13.100	16.813	0,08	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
MAURITIUS				Cetin Finance BV				Diamond (BC) BV			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,423 % fällig am 06.12.2021	9.700	11.577	0,05	3,147 % - 3,186 % fällig			
Azure Power Energy Ltd.				Clear Channel International BV				am 06.09.2024	\$ 200	199	0,00
5,500 % fällig am 03.11.2022	5.700	5.793	0,03	6,625 % fällig am 01.08.2025	\$ 400	422	0,00	Sigma Bidco BV			
Azure Power Solar Energy Pvt Ltd.				Coöperatieve Rabobank UA				3,500 % fällig am 02.07.2025	€ 3.000	3.472	0,01
5,650 % fällig am 24.12.2024	10.800	11.484	0,05	3,100 % fällig am 29.06.2028	€ 1.800	2.163	0,01			3.671	0,01
Greenko Investment Co.				(f)(h)				NON-AGENCY-MBS			
4,875 % fällig am 16.08.2023	6.000	6.101	0,03	4,375 % fällig am 29.06.2027	21.200	27.916	0,13	EMF-NL Prime BV			
Greenko Solar Mauritius Ltd.				(f)(h)				0,263 % fällig am 17.04.2041	825	944	0,01
5,550 % fällig am 29.01.2025	16.400	16.898	0,08	4,625 % fällig am 29.12.2025	5.800	7.571	0,04	Eurosail PLC			
5,950 % fällig am 29.07.2026	7.400	7.988	0,04	CTP NV				0,963 % fällig am 17.10.2040	471	562	0,00
India Green Energy Holdings				0,500 % fällig am 21.06.2025	12.000	14.180	0,07			1.506	0,01
5,375 % fällig am 29.04.2024	10.600	11.105	0,05	1,250 % fällig am 21.06.2029	9.800	11.500	0,05	STAATSEMISSIONEN			
		59.369	0,28	Digital Dutch Finco BV				BNG Bank NV			
AKTIEN				1,000 % fällig am 15.01.2032	2.800	3.294	0,02	2,375 % fällig am 16.03.2026 (j)	\$ 9.900	10.577	0,05
MEXIKO				1,250 % fällig am 01.02.2031	3.200	3.883	0,02	Summe Niederlande		649.606	3,04
STAMMAKTIEN				Enel Finance International NV				NORWEGEN			
Desarrolladora Homex S.A.B.				1,000 % fällig am 20.10.2027	£ 3.600	4.890	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
de C.V. (d)	427.064	0	0,00	2,650 % fällig am 10.09.2024	\$ 16.850	17.724	0,08	Aker BP ASA			
				2,750 % fällig am 06.04.2023	10.855	11.261	0,05	1,125 % fällig am 12.05.2029	€ 9.200	10.941	0,05
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,875 % fällig am 25.05.2022	15.700	16.047	0,07	3,000 % fällig am 15.01.2025	\$ 8.800	9.252	0,04
Banco Inbursa S.A. Institucion de Banca Multiple				4,250 % fällig am 14.09.2023	2.300	2.480	0,01	3,750 % fällig am 15.01.2030	800	864	0,01
4,375 % fällig am 11.04.2027	\$ 17.393	18.631	0,09	4,625 % fällig am 14.09.2025	26.200	29.728	0,14	Yara International ASA			
Banco Mercantil del Norte S.A.				Global Switch Finance BV				4,750 % fällig am 01.06.2028	26.500	31.257	0,15
6,750 % fällig am 27.09.2024	1.600	1.725	0,01	1,375 % fällig am 07.10.2030	€ 5.100	6.184	0,03	Summe Norwegen		52.314	0,25
(f)(h)				IMCD NV				PANAMA			
Banco Santander Mexico S.A.				2,500 % fällig am 26.03.2025	5.000	6.220	0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,375 % fällig am 17.04.2025	17.400	19.764	0,09	ING Groep NV				Banco General S.A.			
BBVA Bancomer S.A.				4,875 % fällig am 16.05.2029	\$ 31.700	33.186	0,15	4,125 % fällig am 07.08.2027	6.300	6.908	0,03
5,125 % fällig am 18.01.2033 (h)	19.300	20.163	0,10	(f)(h)				InterCorp Financial Services, Inc.			
6,750 % fällig am 30.09.2022	11.650	12.393	0,06	5,750 % fällig am 16.11.2026	18.700	20.728	0,10	4,125 % fällig am 19.10.2027	9.200	9.199	0,04
Cibanco S.A. Ibm				(f)(h)	1.300	1.354	0,01			16.107	0,07
4,962 % fällig am 18.07.2029	400	443	0,00	JAB Holdings BV				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Petroleos Mexicanos				1,000 % fällig am 20.12.2027	€ 5.300	6.444	0,03	Carnival Corp.			
2,500 % fällig am 21.08.2021	€ 15.400	18.305	0,09	1,750 % fällig am 25.06.2026	5.100	6.464	0,03	3,750 % fällig am 30.06.2025	€ 19.206	23.332	0,11
2,750 % fällig am 21.04.2027	200	222	0,00	2,200 % fällig am 23.11.2030	\$ 21.450	20.869	0,10	8,500 % fällig am 30.06.2025	\$ 12.208	12.513	0,06
3,750 % fällig am 21.02.2024	100	122	0,00	2,250 % fällig am 19.12.2039	€ 10.000	12.494	0,06			35.845	0,17
4,500 % fällig am 23.01.2026	\$ 4.766	4.831	0,02	JT International Financial Services BV				Summe Panama		51.952	0,24
4,875 % fällig am 21.02.2028	€ 500	603	0,00	3,500 % fällig am 28.09.2023	\$ 8.300	8.845	0,04				
6,350 % fällig am 12.02.2048	\$ 3.119	2.662	0,01	LeasePlan Corp. NV							
6,490 % fällig am 23.01.2027	8.300	8.777	0,04	0,125 % fällig am 13.09.2023	€ 8.200	9.783	0,05				
6,500 % fällig am 13.03.2027	6.900	7.292	0,03	1,000 % fällig am 02.05.2023	17.600	21.335	0,10				
6,500 % fällig am 23.01.2029	10.500	10.820	0,05	2,875 % fällig am 24.10.2024	\$ 1.220	1.282	0,01				
6,840 % fällig am 23.01.2030	\$ 30.200	31.159	0,15	7,375 % fällig am 29.05.2024	€ 1.200	1.596	0,01				
6,950 % fällig am 28.01.2060	870	771	0,00	(f)(h)							

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖG ENS	% DES
PERU				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco de Credito del Peru				
2,700 % fällig am 11.01.2025	\$	10.400	10.772	0,05
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	9.800	2.647	0,01
		13.419	0,06	
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
5,350 % fällig am 12.08.2040		24.550	5.688	0,02
5,400 % fällig am 12.08.2034		10.800	2.671	0,01
5,940 % fällig am 12.02.2029		96.259	27.519	0,13
6,150 % fällig am 12.08.2032		110.930	29.687	0,14
6,350 % fällig am 12.08.2028		187.800	54.893	0,26
6,950 % fällig am 12.08.2031		35.600	10.438	0,05
8,200 % fällig am 12.08.2026		340.600	110.554	0,52
		241.450	1,13	
Summe Peru		254.869	1,19	

KATAR				
STAATSEMISSIONEN				
Qatar Government International Bond				
3,375 % fällig am 14.03.2024	\$	16.800	18.043	0,08
4,400 % fällig am 16.04.2050		12.100	14.756	0,07
Summe Katar		32.799	0,15	

RUMÄNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
RCS & RDS S.A.				
3,250 % fällig am 05.02.2028	€	2.100	2.504	0,01

STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
1,375 % fällig am 02.12.2029		3.625	4.296	0,02
2,625 % fällig am 02.12.2040		24.000	28.297	0,13
		32.593	0,15	
Summe Rumänien		35.097	0,16	

RUSLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ALROSA Finance S.A.				
4,650 % fällig am 09.04.2024	\$	5.200	5.629	0,03
MMK International Capital DAC				
4,375 % fällig am 13.06.2024		5.200	5.586	0,02
		11.215	0,05	

STAATSEMISSIONEN				
Russia Government International Bond				
7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB	2.389.000	34.055	0,16
8,500 % fällig am 17.09.2031		2.385.500	36.037	0,17
		70.092	0,33	
Summe Russland		81.307	0,38	

SAUDI-ARABIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Saudi Arabian Oil Co.				
2,250 % fällig am 24.11.2030	\$	25.100	24.683	0,12

STAATSEMISSIONEN				
Saudi Government International Bond				
2,250 % fällig am 02.02.2033		21.500	20.929	0,10
2,375 % fällig am 26.10.2021		34.800	35.027	0,16
2,875 % fällig am 04.03.2023		6.200	6.441	0,03
		62.397	0,29	
Summe Saudi-Arabien		87.080	0,41	

SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BOC Aviation Ltd.				
2,375 % fällig am 15.09.2021		2.400	2.404	0,01
2,750 % fällig am 18.09.2022		19.700	20.063	0,09
3,500 % fällig am 31.01.2023		1.600	1.654	0,01
3,500 % fällig am 10.10.2024		10.900	11.629	0,05

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖG ENS	% DES
3,500 % fällig am 18.09.2027	\$	20.800	22.192	0,10
4,000 % fällig am 25.01.2024		3.400	3.620	0,02
Flex Ltd.				
4,875 % fällig am 15.06.2029		9.600	11.091	0,05
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.				
1,832 % fällig am 10.09.2030 (h)		14.400	14.440	0,07
SingTel Group Treasury Pte. Ltd.				
3,875 % fällig am 28.08.2028		1.100	1.243	0,01
SP PowerAssets Ltd.				
3,000 % fällig am 26.09.2027		2.600	2.840	0,01
United Overseas Bank Ltd.				
1,750 % fällig am 16.03.2031 (h)		3.700	3.681	0,02
Summe Singapur		94.857	0,44	

SLOWAKEI				
STAATSEMISSIONEN				
Slovakia Government International Bond				
1,875 % fällig am 09.03.2037	€	500	721	0,00

SUDAFRIKA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AngloGold Ashanti Holdings PLC				
3,750 % fällig am 01.10.2030	\$	8.300	8.597	0,04
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.				
5,872 % fällig am 02.05.2023		3.250	3.488	0,02
		12.085	0,06	

STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	929.500	73.983	0,34
Summe Südafrika		86.068	0,40	

SÜDKOREA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Shinhan Bank Co. Ltd.				
0,250 % fällig am 16.10.2024	€	9.200	11.021	0,05
1,183 % fällig am 29.09.2025	AUD	4.000	2.988	0,01
Shinhan Financial Group Co. Ltd.				
3,340 % fällig am 05.02.2030 (h)	\$	3.200	3.349	0,02
SK Hynix, Inc.				
1,000 % fällig am 19.01.2024		5.600	5.572	0,03
		22.930	0,11	

STAATSEMISSIONEN				
Korea Development Bank				
4,625 % fällig am 16.11.2021		300	305	0,00
Summe Südkorea		23.235	0,11	

SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Abertis Infraestructuras S.A.				
2,250 % fällig am 29.03.2029	€	13.700	17.834	0,08
3,000 % fällig am 27.03.2031		1.200	1.667	0,01
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h)		5.000	6.419	0,03
6,000 % fällig am 29.03.2024 (f)(h)		1.000	1.300	0,01
6,000 % fällig am 15.01.2026 (f)(h)		25.000	33.933	0,16
Banco de Sabadell S.A.				
1,125 % fällig am 11.03.2027		5.600	6.830	0,03
Banco Santander S.A.				
1,500 % fällig am 14.04.2026	£	8.900	12.357	0,06
6,250 % fällig am 11.09.2021 (f)(h)	€	22.000	26.377	0,12
Bankinter S.A.				
0,875 % fällig am 08.07.2026		8.700	10.572	0,05
CaixaBank S.A.				
1,750 % fällig am 24.10.2023		7.500	9.267	0,04
3,750 % fällig am 15.02.2029		4.100	5.245	0,03
5,250 % fällig am 23.03.2026 (f)(h)		8.800	11.232	0,05
5,875 % fällig am 09.10.2027 (f)(h)		33.000	44.907	0,21
Merlin Properties Socimi S.A.				
1,375 % fällig am 01.06.2030		4.300	5.069	0,03
2,225 % fällig am 25.04.2023		2.100	2.577	0,01
Summe Spanien		195.586	0,92	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖG ENS	% DES
SUPRANATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
1,500 % fällig am 13.02.2025	\$	5.500	5.659	0,03
1,625 % fällig am 27.09.2024		500	516	0,00
Europäische Investitionsbank				
0,750 % fällig am 15.11.2024	£	16.350	22.859	0,11
Summe supranational		29.034	0,14	

SCHWEDEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Castellum AB				
2,125 % fällig am 20.11.2023	€	4.600	5.723	0,03
Fastighets AB Balder				
1,125 % fällig am 29.01.2027		4.800	5.802	0,03
Intrum AB				
3,500 % fällig am 15.07.2026		6.100	7.393	0,03
Sagax AB				
1,125 % fällig am 30.01.2027		4.500	5.456	0,03
2,250 % fällig am 13.03.2025		9.000	11.353	0,05
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB				
1,000 % fällig am 12.08.2027		20.800	24.957	0,12
1,125 % fällig am 04.09.2026		4.000	4.870	0,02
1,750 % fällig am 14.01.2025		6.867	8.536	0,04
Summe Schweden		74.090	0,35	

SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	\$	94.560	104.682	0,49
Credit Suisse Group AG				
0,625 % fällig am 18.01.2033	€	2.000	2.234	0,01
1,000 % fällig am 24.06.2027		7.200	8.719	0,04
2,593 % fällig am 11.09.2025	\$	21.700	22.589	0,11
3,750 % fällig am 26.03.2025		11.900	12.917	0,06
4,194 % fällig am 01.04.2031		14.500	16.310	0,08
4,207 % fällig am 12.06.2024		35.350	37.665	0,18
6,250 % fällig am 18.12.2024 (f)(h)		17.160	18.831	0,09
6,375 % fällig am 21.08.2026 (f)(h)		12.400	13.832	0,06
7,125 % fällig am 29.07.2022 (f)(h)		1.900	1.984	0,01
7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h)		26.300	28.667	0,13
7,500 % fällig am 11.12.2023 (f)(h)		200	222	0,00
UBS AG				
5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)		9.500	10.494	0,05
7,625 % fällig am 17.08.2022 (h)		78.521	84.491	0,39
UBS Group AG				
1,106 % fällig am 15.08.2023		31.300	31.581	0,15
4,125 % fällig am 24.09.2025		69.850	77.982	0,36
5,125 % fällig am 29.07.2026 (f)(h)		16.100	17.559	0,08
7,125 % fällig am 10.08.2021 (f)(h)		3.500	3.522	0,02
Summe Schweiz		494.281	2,31	

TURKEI				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Turkish Airlines Pass-Through Trust				
4,200 % fällig am 15.09.2028		5.409	5.076	0,02

UKRAINE				
STAATSEMISSIONEN				
Ukraine Government International Bond				
7,750 % fällig am 01.09.2021		1.600	1.616	0,01
7,750 % fällig am 01.09.2022		8.700	9.157	0,04
Summe Ukraine		10.773	0,05	

VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
DAE Sukuk Dfc Ltd.				
3,750 % fällig am 15.02.2026		9.200	9.762	0,04
Dolphin Energy Ltd. LLC				
5,500 % fällig am 15.12.2021		1.100	1.124	0,01
First Abu Dhabi Bank PJSC				
1,134 % fällig am 16.04.2022		26.200	26.320	0,12
		37.206	0,17	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS
STAATSEMISSIONEN											
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond	\$	20.000	20.457	0,10							
3,125 % fällig am 30.09.2049											
Summe Vereinigte Arabische Emirate			57.663	0,27							
GROSSBRITANNIEN											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
Amcor UK Finance PLC											
1,125 % fällig am 23.06.2027	€	1.600	1.980	0,01							
Assura Financing PLC											
3,000 % fällig am 19.07.2028	€	3.800	5.824	0,03							
Babcock International Group PLC											
1,375 % fällig am 13.09.2027	€	3.300	3.984	0,02							
Barclays PLC											
2,845 % fällig am 24.06.2031	\$	11.700	11.868	0,06							
3,125 % fällig am 17.01.2024	€	11.200	16.322	0,08							
3,250 % fällig am 12.02.2027			19.103	0,13							
3,375 % fällig am 02.04.2025	€	15.700	20.290	0,09							
4,375 % fällig am 12.01.2026	\$	17.100	19.157	0,09							
4,836 % fällig am 09.05.2028			4.800	0,03							
6,125 % fällig am 15.12.2025											
(f)(h)			2.900	0,02							
7,125 % fällig am 15.06.2025	€	14.500	22.936	0,11							
(f)(h)											
7,250 % fällig am 15.03.2023			23.850	0,17							
(f)(h)											
8,000 % fällig am 15.06.2024	\$	4.600	5.235	0,02							
(f)(h)											
BAT International Finance PLC											
1,668 % fällig am 25.03.2026		7.900	7.902	0,04							
Bellis Acquisition Co. PLC											
3,250 % fällig am 16.02.2026	€	20.600	28.547	0,13							
BG Energy Capital PLC											
5,125 % fällig am 15.10.2041	\$	2.800	3.728	0,02							
Broadgate Financing PLC											
4,851 % fällig am 05.04.2033	€	60	100	0,00							
Bunzl Finance PLC											
2,250 % fällig am 11.06.2025		100	145	0,00							
Cadent Finance PLC											
2,625 % fällig am 22.09.2038		300	431	0,00							
2,750 % fällig am 22.09.2046		3.400	4.926	0,02							
Chanel Ceres PLC											
0,500 % fällig am 31.07.2026	€	13.000	15.556	0,07							
1,000 % fällig am 31.07.2031		8.100	9.656	0,05							
Connect Plus M25 Issuer PLC											
2,607 % fällig am 31.03.2039	€	2.243	3.450	0,02							
Direct Line Insurance Group PLC											
4,000 % fällig am 05.06.2032		1.400	2.180	0,01							
DWR Cymru Financing UK PLC											
3,514 % fällig am 31.03.2030		26	53	0,00							
FCE Bank PLC											
0,869 % fällig am 13.09.2021	€	9.900	11.756	0,05							
Ferguson Finance PLC											
3,250 % fällig am 02.06.2030	\$	4.600	4.975	0,02							
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC											
1,500 % fällig am 17.02.2027	€	20.700	24.524	0,11							
2,950 % fällig am 27.01.2029	\$	46.600	45.778	0,21							
3,000 % fällig am 29.06.2027			3.400	0,02							
3,250 % fällig am 25.02.2030			22.600	0,11							
Grainger PLC											
3,375 % fällig am 24.04.2028	€	7.500	11.228	0,05							
Greene King Finance PLC											
2,161 % fällig am 15.03.2036		1.000	1.161	0,01							
4,064 % fällig am 15.03.2035		5.353	8.105	0,04							
5,106 % fällig am 15.03.2034		100	160	0,00							
5,318 % fällig am 15.09.2031		250	399	0,00							
HSBC Holdings PLC											
1,355 % fällig am 11.03.2025	\$	15.750	16.077	0,08							
1,645 % fällig am 18.04.2026		26.800	27.172	0,13							
1,750 % fällig am 24.07.2027	€	32.800	45.849	0,21							
2,357 % fällig am 18.08.2031	\$	7.000	7.011	0,03							
2,848 % fällig am 04.06.2031		12.300	12.779	0,06							
3,000 % fällig am 22.07.2028	€	5.100	7.603	0,04							
3,973 % fällig am 22.05.2030	\$	15.500	17.363	0,08							
4,041 % fällig am 13.03.2028		22.800	25.301	0,12							
4,292 % fällig am 12.09.2026			3.800	0,02							
4,600 % fällig am 17.12.2030 (f)(h)		21.200	22.048	0,10							
5,875 % fällig am 28.09.2026											
(f)(h)	€	335	520	0,00							
6,000 % fällig am 29.09.2023											
(f)(h)	€	5.044	6.568	0,03							
6,000 % fällig am 22.05.2027											
(f)(h)	\$	6.600	7.342	0,03							
6,500 % fällig am 23.03.2028											
(f)(h)		25.335	29.104	0,14							
Imperial Brands Finance PLC											
1,125 % fällig am 14.08.2023	€	2.800									
3,500 % fällig am 26.07.2026	\$	23.800									
3,750 % fällig am 21.07.2022			3.100								
3,875 % fällig am 26.07.2029		14.400									
INEOS Quattro Finance PLC											
2,500 % fällig am 15.01.2026	€	4.600	5.516	0,03							
Infoma PLC											
1,250 % fällig am 22.04.2028		20.500	24.780	0,12							
1,500 % fällig am 05.07.2023		20.350	24.859	0,12							
2,125 % fällig am 06.10.2025		29.400	37.169	0,17							
3,125 % fällig am 05.07.2026	€	100	147	0,00							
InterContinental Hotels Group PLC											
1,625 % fällig am 08.10.2024	€	16.700	20.652	0,10							
2,125 % fällig am 24.08.2026	€	2.840	3.998	0,02							
2,125 % fällig am 15.05.2027	€	3.400	4.350	0,02							
3,375 % fällig am 08.10.2028	€	11.500	17.207	0,08							
3,875 % fällig am 28.11.2022		800	1.152	0,01							
ITV PLC											
1,375 % fällig am 26.09.2026	€	11.800	14.652	0,07							
Jaguar Land Rover Automotive PLC											
2,200 % fällig am 15.01.2024		4.100	4.861	0,02							
5,875 % fällig am 15.11.2024		5.800	7.576	0,04							
John Lewis PLC											
4,250 % fällig am 18.12.2034	€	3.000	4.354	0,02							
6,125 % fällig am 21.01.2025		1.850	2.894	0,01							
Lloyds Bank PLC											
7,500 % fällig am 02.04.2032	\$	27.200	21.470	0,10							
Lloyds Banking Group PLC											
2,250 % fällig am 16.10.2024	€	1.000	1.440	0,01							
3,500 % fällig am 01.04.2026	€	23.700	31.641	0,15							
4,947 % fällig am 27.06.2025			5.500								
(f)(h)			7.212	0,03							
5,125 % fällig am 27.12.2024											
(f)(h)	€	4.400	6.458	0,03							
7,500 % fällig am 27.09.2025											
(f)(h)	\$	2.200	2.579	0,01							
7,625 % fällig am 27.06.2023											
(f)(h)	€	2.500	3.788	0,02							
7,875 % fällig am 27.06.2029		11.130	19.654	0,09							
(f)(h)											
M&G PLC											
6,340 % fällig am 19.12.2063		500	911	0,00							
Marks & Spencer PLC											
3,750 % fällig am 19.05.2026		7.400	10.647	0,05							
4,500 % fällig am 10.07.2027		1.800	2.666	0,01							
6,000 % fällig am 12.06.2025		8.355	13.004	0,06				</			

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES			
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS		
Amerquest Mortgage Securities Trust 0,872 % fällig am 25.03.2036	\$	1.023	1.019	0,01	\$	4.400	4.646	0,02	\$	20.436	20.267	0,10	
Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 0,797 % fällig am 25.01.2036	8.371	8.366	0,04	Advantage Sales & Marketing, Inc. 6,500 % fällig am 15.11.2028	550	540	0,00	2,550 % fällig am 01.12.2033					
Asset-Backed Funding Certificates Trust 0,872 % fällig am 25.06.2035	490	493	0,00	AEP Texas, Inc. 2,100 % fällig am 01.07.2030	150	156	0,00	2,850 % fällig am 25.05.2024 (i)	CAD	2.900	2.442	0,01	
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 0,832 % fällig am 25.08.2032	113	110	0,00	2,450 % fällig am 15.05.2051	700	694	0,00	3,100 % fällig am 01.02.2043	\$	23.900	23.466	0,11	
First Franklin Mortgage Loan Trust 0,832 % fällig am 25.10.2035	449	449	0,00	AES Corp. 3,300 % fällig am 15.07.2025	11.000	11.772	0,06	3,150 % fällig am 04.09.2036	€	10.500	15.167	0,07	
Fremont Home Loan Trust 0,252 % fällig am 25.08.2036	8.187	3.535	0,02	3,450 % fällig am 15.07.2030	7.000	7.676	0,04	3,300 % fällig am 01.02.2052	\$	23.700	23.116	0,11	
GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates 0,592 % fällig am 25.12.2035	180	181	0,00	Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029	9.944	11.029	0,05	3,500 % fällig am 01.06.2041		14.950	15.557	0,07	
GSAMP Trust 0,262 % fällig am 25.01.2037	2.340	2.291	0,01	Alexandria Real Estate Equities, Inc. 3,450 % fällig am 30.04.2025	2.800	3.054	0,01	3,500 % fällig am 15.09.2053		5.017	5.048	0,02	
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 0,822 % fällig am 25.04.2037	5.761	4.388	0,02	4,300 % fällig am 15.01.2026	19.250	21.599	0,10	3,550 % fällig am 15.09.2055		30.508	30.655	0,14	
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,302 % fällig am 25.10.2036	2.894	2.850	0,01	Allegion U.S. Holding Co., Inc. 3,550 % fällig am 01.10.2027	10.500	11.435	0,05	3,650 % fällig am 01.06.2051		13.100	13.635	0,06	
L2L Education Loan Trust 0,413 % fällig am 15.06.2031	2.379	2.362	0,01	Ally Financial, Inc. 1,450 % fällig am 02.10.2023	4.700	4.772	0,02	3,650 % fällig am 15.09.2059		39.253	39.866	0,19	
Labrador Aviation Finance Ltd. 4,300 % fällig am 15.01.2042	15.910	15.828	0,08	3,050 % fällig am 05.06.2023	2.300	2.401	0,01	3,850 % fällig am 01.06.2060		20.000	21.125	0,10	
Lehman XS Trust 0,892 % fällig am 25.10.2035	291	292	0,00	8,000 % fällig am 01.11.2031	19.390	27.767	0,13	4,850 % fällig am 25.05.2047 (i)	CAD	3.600	3.238	0,02	
Long Beach Mortgage Loan Trust 0,252 % fällig am 25.12.2036	5.356	4.191	0,02	American Airlines Pass-Through Trust 3,000 % fällig am 15.04.2030	2.547	2.595	0,01	Aviation Capital Group LLC 2,875 % fällig am 20.01.2022	\$	2.989	3.020	0,01	
0,992 % fällig am 25.06.2035	149	149	0,00	3,150 % fällig am 15.08.2033	10.579	10.936	0,05	3,500 % fällig am 01.11.2027		8.802	9.255	0,04	
1,142 % fällig am 25.06.2035	7.100	7.132	0,03	3,200 % fällig am 15.12.2029	11.552	11.813	0,06	3,875 % fällig am 01.05.2023		2.143	2.246	0,01	
MASTR Asset-Backed Securities Trust 0,812 % fällig am 25.12.2034	2.284	2.226	0,01	3,250 % fällig am 15.02.2030	1.874	1.827	0,01	4,375 % fällig am 30.01.2024		14.899	15.988	0,08	
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 1,142 % fällig am 25.04.2035	1.900	1.888	0,01	3,350 % fällig am 15.04.2031	9.214	9.394	0,04	5,500 % fällig am 15.12.2024		2.800	3.167	0,02	
New Century Home Equity Loan Trust 1,022 % fällig am 25.11.2034	285	281	0,00	3,375 % fällig am 01.11.2028	9.851	9.809	0,05	Bank of America Corp. 0,580 % fällig am 08.08.2029	€	16.300	19.453	0,09	
Option One Mortgage Loan Trust 0,232 % fällig am 25.01.2037	5.763	4.029	0,02	3,500 % fällig am 15.08.2033	13.857	13.457	0,06	1,133 % fällig am 23.07.2024	\$	38.000	38.542	0,18	
Residential Asset Mortgage Products Trust 0,522 % fällig am 25.11.2035	261	261	0,00	3,575 % fällig am 15.07.2029	2.357	2.407	0,01	1,898 % fällig am 23.07.2031		4.500	4.379	0,02	
0,552 % fällig am 25.12.2035	464	420	0,00	3,600 % fällig am 22.03.2029	1.145	1.187	0,01	2,687 % fällig am 22.04.2032		14.300	14.721	0,07	
Residential Asset Securities Corp. Trust 0,362 % fällig am 25.05.2037	382	382	0,00	3,600 % fällig am 15.04.2031	5.026	4.982	0,02	3,550 % fällig am 05.03.2024		3.500	3.678	0,02	
0,752 % fällig am 25.11.2035	2.726	2.720	0,01	3,650 % fällig am 15.02.2029	1.624	1.678	0,01	4,271 % fällig am 23.07.2029		2.400	2.759	0,01	
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 0,672 % fällig am 25.12.2035	747	737	0,01	4,000 % fällig am 15.01.2027	2.988	2.912	0,01	4,300 % fällig am 28.01.2025 (f)		30.900	31.989	0,15	
0,767 % fällig am 25.01.2035	119	116	0,00	4,100 % fällig am 15.07.2029	1.245	1.239	0,01	Bank of America N.A. 6,000 % fällig am 15.10.2036		7.650	10.725	0,05	
SLM Private Credit Student Loan Trust 0,359 % fällig am 16.12.2041	2.434	2.375	0,01	American Campus Communities Operating Partnership LP 3,300 % fällig am 15.07.2026	3.200	3.437	0,02	BAT Capital Corp. 2,726 % fällig am 25.03.2031		6.900	6.819	0,03	
Soundview Home Loan Trust 0,262 % fällig am 25.06.2036	475	475	0,00	3,750 % fällig am 15.04.2023	7.650	8.020	0,04	4,540 % fällig am 15.08.2047		3.000	3.196	0,02	
0,552 % fällig am 25.06.2036	6.502	6.386	0,03	3,875 % fällig am 30.01.2031	700	778	0,00	Bayer U.S. Finance LLC 1,129 % fällig am 15.12.2023		12.700	12.888	0,06	
Structured Asset Investment Loan Trust 0,712 % fällig am 25.01.2036	5.072	4.914	0,02	American Electric Power Co., Inc. 4,300 % fällig am 01.12.2028	3.500	4.032	0,02	3,375 % fällig am 15.07.2024		1.500	1.599	0,01	
0,812 % fällig am 25.02.2035	234	235	0,00	American Homes 4 Rent LP 4,250 % fällig am 15.02.2028	500	562	0,00	3,875 % fällig am 15.12.2023		13.100	14.035	0,07	
Towd Point Mortgage Trust 2,750 % fällig am 25.06.2057	9.067	9.341	0,05	4,900 % fällig am 15.02.2029	9.800	11.403	0,05	4,375 % fällig am 15.12.2028		25.500	29.243	0,14	
		102.404	0,48	American Tower Corp. 0,500 % fällig am 15.01.2028	€	19.100	22.475	0,11	Berry Global, Inc. 1,000 % fällig am 15.01.2025	€	12.000	14.391	0,07
				1,000 % fällig am 15.01.2032	15.200	18.109	0,09	1,500 % fällig am 15.01.2027		12.000	14.513	0,07	
				1,375 % fällig am 04.04.2025	900	1.115	0,01	4,875 % fällig am 15.07.2026	\$	3.300	3.496	0,02	
				1,875 % fällig am 15.10.2030	\$	11.100	10.726	0,05	BGC Partners, Inc. 5,375 % fällig am 24.07.2023		700	758	0,00
				1,950 % fällig am 22.05.2026	€	13.600	17.418	0,08	Black Hills Corp. 2,500 % fällig am 15.06.2030		14.000	14.275	0,07
				2,100 % fällig am 15.06.2030	\$	7.500	7.384	0,03	BlueScope Finance Americas LLC 4,625 % fällig am 25.05.2023		29.000	30.711	0,14
				2,400 % fällig am 15.03.2025		4.100	4.288	0,02	Boardwalk Pipelines LP 3,400 % fällig am 15.02.2031		12.900	13.705	0,06
				2,950 % fällig am 15.01.2025	38.900	41.404	0,19	BOC Aviation USA Corp. 1,625 % fällig am 29.04.2024		4.600	4.639	0,02	
				2,950 % fällig am 15.01.2051	8.400	8.044	0,04	Boeing Co. 1,433 % fällig am 04.02.2024		24.500	24.567	0,12	
				3,100 % fällig am 15.06.2050	6.059	5.935	0,03	2,196 % fällig am 04.02.2026		40.000	40.389	0,19	
				3,125 % fällig am 15.01.2027	6.300	6.769	0,03	3,250 % fällig am 01.02.2028		15.300	16.237	0,08	
				3,375 % fällig am 15.05.2024	2.500	2.676	0,01	5,150 % fällig am 01.05.2030		71.500	84.735	0,40	
				3,375 % fällig am 15.10.2026	4.800	5.235	0,02	5,705 % fällig am 01.05.2040		7.300	9.415	0,04	
				3,700 % fällig am 15.10.2049	600	654	0,00	5,805 % fällig am 01.05.2050		22.000	29.675	0,14	
				3,800 % fällig am 15.08.2029	17.234	19.220	0,09	5,930 % fällig am 01.05.2060		3.000	4.150	0,02	
				3,950 % fällig am 15.03.2029	600	674	0,00	Booking Holdings, Inc. 0,100 % fällig am 08.03.2025	€	2.900	3.451	0,02	
				American Transmission Systems, Inc. 5,000 % fällig am 01.09.2044	1.639	2.107	0,01	0,500 % fällig am 08.03.2028		9.100	10.884	0,05	
				5,250 % fällig am 15.01.2022	13.535	13.861	0,07	Boston Scientific Corp. 0,625 % fällig am 01.12.2027		7.560	9.106	0,04	
				Anheuser-Busch Cos. LLC 4,900 % fällig am 01.02.2046	15.500	19.654	0,09	2,650 % fällig am 01.06.2030	\$	16.900	17.496	0,08	
				Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,600 % fällig am 15.04.2048	10.000	12.232	0,06	Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % fällig am 15.12.2023		2.317	2.417	0,01	
				5,450 % fällig am 23.01.2039	8.500	11.234	0,05	3,950 % fällig am 15.11.2027		3.700	4.024	0,02	
				5,550 % fällig am 23.01.2049	700	964	0,00	British Airways Pass-Through Trust 3,300 % fällig am 15.06.2034		14.064	14.356	0,07	
				Antares Holdings LP 3,950 % fällig am 15.07.2026	3.800	3.959	0,02	3,350 % fällig am 15.12.2030		1.142	1.146	0,01	
				Ares Finance Co. LLC 3,250 % fällig am 15.06.2030	17.700	18.482	0,09	3,800 % fällig am 20.03.2033		83	87	0,00	
				Arrow Electronics, Inc. 3,875 % fällig am 12.01.2028	1.500	1.681	0,01	4,125 % fällig am 20.03.2033		83	85	0,00	
				Ashtead Capital, Inc. 4,000 % fällig am 01.05.2028	8.441	8.895	0,04	4,250 % fällig am 15.05.2034		830	896	0,00	
				4,250 % fällig am 01.11.2029	3.300	3.572	0,02	4,625 % fällig am 20.12.2025		1.127	1.190	0,01	
				AT&T, Inc.				Brixmor Operating Partnership LP 1,226 % fällig am 01.02.2022		5.000	5.020	0,02	
								Broadcom, Inc. 2,450 % fällig am 15.02.2031		17.000	16.719	0,08	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS
2,600 % fällig am 15.02.2033	\$ 3.500	\$ 3.427	0,02	Continental Airlines Pass-Through Trust	\$ 2.061	\$ 2.193	0,01	5,250 % fällig am 16.08.2077	\$ 5.039	\$ 5.290	0,03
3,469 % fällig am 15.04.2034	23.049	24.404	0,11	4,150 % fällig am 11.10.2025				5,375 % fällig am 15.02.2078	6.014	6.268	0,03
3,500 % fällig am 15.02.2041	20.900	21.408	0,10	Continental Resources, Inc.	730	762	0,00	EPR Properties			
4,110 % fällig am 15.09.2028	28.146	31.691	0,15	4,500 % fällig am 15.04.2023				4,500 % fällig am 01.04.2025	4.720	5.057	0,02
4,150 % fällig am 15.11.2030	4.000	4.490	0,02	Corporate Office Properties LP				4,500 % fällig am 01.06.2027	7.250	7.740	0,04
4,300 % fällig am 15.11.2032	8.800	10.032	0,05	2,250 % fällig am 15.03.2026	5.500	5.658	0,03	4,750 % fällig am 15.12.2026	4.725	5.128	0,02
4,750 % fällig am 15.04.2029	32.331	37.644	0,18	CoStar Group, Inc.				4,950 % fällig am 15.04.2028	2.086	2.255	0,01
5,000 % fällig am 15.04.2030	16.835	19.882	0,09	2,800 % fällig am 15.07.2030	5.500	5.596	0,03	5,250 % fällig am 15.07.2023	1.500	1.585	0,01
Builders FirstSource, Inc.				Crown Castle International Corp.				EQM Midstream Partners LP			
6,750 % fällig am 01.06.2027	715	768	0,00	2,250 % fällig am 15.01.2031	16.500	16.304	0,08	4,750 % fällig am 15.01.2031	600	619	0,00
Caesars Entertainment, Inc.				3,100 % fällig am 15.11.2029	13.605	14.468	0,07	Equinix, Inc.			
6,250 % fällig am 01.07.2025	11.900	12.629	0,06	3,250 % fällig am 15.01.2051	13.300	13.266	0,06	2,625 % fällig am 18.11.2024	600	632	0,00
Caesars Resort Collection LLC				3,800 % fällig am 15.02.2028	4.065	4.520	0,02	3,000 % fällig am 15.07.2050	6.800	6.542	0,03
5,750 % fällig am 01.07.2025	13.300	14.032	0,07	4,150 % fällig am 01.07.2050	200	229	0,00	Equitable Holdings, Inc.			
Camden Property Trust				4,300 % fällig am 15.02.2029	20.100	23.149	0,11	4,350 % fällig am 20.04.2028	6.850	7.863	0,04
3,500 % fällig am 15.09.2024	800	859	0,00	4,450 % fällig am 15.02.2026	27.313	30.892	0,14	Essex Portfolio LP			
Cameron LNG LLC				Crown Castle Towers LLC				2,650 % fällig am 15.03.2032	4.700	4.778	0,02
3,402 % fällig am 15.01.2038	4.600	4.876	0,02	3,720 % fällig am 15.07.2043	8.900	9.200	0,04	3,250 % fällig am 01.05.2033	1.050	1.096	0,01
3,701 % fällig am 15.01.2039	10.825	12.090	0,06	4,241 % fällig am 15.07.2048	6.200	7.013	0,03	3,500 % fällig am 01.04.2025	1.500	1.625	0,01
Cantor Fitzgerald LP				CubeSmart LP				3,625 % fällig am 01.05.2027	4.300	4.753	0,02
4,875 % fällig am 01.05.2024	3.700	4.058	0,02	3,000 % fällig am 15.02.2030	200	210	0,00	3,875 % fällig am 01.05.2024	5.300	5.708	0,03
6,500 % fällig am 17.06.2022	200	211	0,00	CVS Health Corp.				Exelon Corp.			
Carlyle Holdings Finance LLC				2,700 % fällig am 21.08.2040	1.962	1.905	0,01	4,050 % fällig am 15.04.2030	4.240	4.834	0,02
5,625 % fällig am 30.03.2043	100	134	0,00	CVS Pass-Through Trust				Exelon Generation Co. LLC			
CCO Holdings LLC				4,704 % fällig am 10.01.2036	231	262	0,00	5,750 % fällig am 01.10.2041	2.700	3.188	0,02
4,250 % fällig am 01.02.2031	4.214	4.298	0,02	7,507 % fällig am 10.01.2032	1.521	1.928	0,01	Expedia Group, Inc.			
4,500 % fällig am 15.08.2030	950	990	0,00	8,353 % fällig am 10.07.2031	267	350	0,00	2,950 % fällig am 15.03.2031	9.150	9.291	0,04
4,500 % fällig am 01.05.2032	2.000	2.079	0,01	CyrusOne LP				3,250 % fällig am 15.02.2030	7.500	7.841	0,04
4,750 % fällig am 01.03.2030	4.900	5.188	0,02	1,450 % fällig am 22.01.2027	€ 5.800	7.019	0,03	3,600 % fällig am 15.12.2023	12.500	13.295	0,06
Centene Corp.				DAE Funding LLC				3,800 % fällig am 15.02.2028	12.125	13.195	0,06
2,450 % fällig am 15.07.2028 (b)	4.000	4.059	0,02	1,550 % fällig am 01.08.2024	\$ 15.000	14.998	0,07	6,250 % fällig am 01.05.2025	1.083	1.261	0,01
Charter Communications Operating LLC				1,625 % fällig am 15.02.2024	24.800	25.203	0,12	Fidelity National Financial, Inc.			
2,300 % fällig am 01.02.2032	28.500	27.436	0,13	3,375 % fällig am 20.03.2028	26.200	26.866	0,13	5,500 % fällig am 01.09.2022	37.208	39.302	0,18
2,800 % fällig am 01.04.2031	4.900	5.015	0,02	5,000 % fällig am 01.08.2024	5.800	5.971	0,03	Fidelity National Information Services, Inc.			
3,500 % fällig am 01.06.2041	10.900	10.992	0,05	5,250 % fällig am 15.11.2021	8.700	8.776	0,04	0,125 % fällig am 03.12.2022	€ 13.700	16.330	0,08
3,700 % fällig am 01.04.2051	7.200	7.138	0,03	DaVita, Inc.				First American Financial Corp.			
3,750 % fällig am 15.02.2028	21.200	23.399	0,11	4,625 % fällig am 01.06.2030	10.830	11.149	0,05	4,300 % fällig am 01.02.2023	\$ 5.935	6.261	0,03
3,850 % fällig am 01.04.2061	2.988	2.940	0,01	Dell International LLC				FirstEnergy Transmission LLC			
3,900 % fällig am 01.06.2052	12.500	12.764	0,06	4,900 % fällig am 01.10.2026	16.900	19.528	0,09	4,350 % fällig am 15.01.2025	3.757	4.124	0,02
4,400 % fällig am 01.12.2061	750	807	0,00	5,300 % fällig am 01.10.2029	4.800	5.797	0,03	4,550 % fällig am 01.04.2049	2.183	2.569	0,01
4,464 % fällig am 23.07.2022	4.400	4.556	0,02	5,450 % fällig am 15.06.2023	42.015	45.593	0,21	Fiserv, Inc.			
4,800 % fällig am 01.03.2050	16.800	19.332	0,09	5,850 % fällig am 15.07.2025	8.497	9.976	0,05	0,375 % fällig am 01.07.2023	€ 2.500	2.993	0,01
4,908 % fällig am 23.07.2025	2.613	2.962	0,01	6,020 % fällig am 15.06.2026	37.399	44.919	0,21	1,125 % fällig am 01.07.2027	800	992	0,00
5,125 % fällig am 01.07.2049	9.900	11.812	0,06	6,100 % fällig am 15.07.2027	5.352	6.564	0,03	1,625 % fällig am 01.07.2030	9.400	11.989	0,06
5,375 % fällig am 01.04.2038	17.400	21.412	0,10	Delta Air Lines, Inc.				3,000 % fällig am 01.07.2031	£ 2.600	3.940	0,02
Cheniery Corpus Christi Holdings LLC				2,900 % fällig am 28.10.2024	20.712	21.087	0,10	Flex Intermediate Holdco LLC			
3,700 % fällig am 15.11.2029	14.400	15.743	0,07	3,750 % fällig am 28.10.2029	20.200	20.191	0,09	3,363 % fällig am 30.06.2031	\$ 44.900	45.543	0,21
5,125 % fällig am 30.06.2027	11.462	13.340	0,06	7,000 % fällig am 01.05.2025	36.655	42.801	0,20	Ford Foundation			
7,000 % fällig am 30.06.2024	4.978	5.705	0,03	7,375 % fällig am 15.01.2026	11.700	13.737	0,06	2,415 % fällig am 01.06.2050	6.700	6.465	0,03
Chobani LLC				Devon Energy Corp.				2,815 % fällig am 01.06.2070	1.700	1.715	0,01
4,625 % fällig am 15.11.2028	1.100	1.142	0,01	5,250 % fällig am 15.09.2024	9.264	10.326	0,05	Ford Motor Credit Co. LLC			
Choice Hotels International, Inc.				Diamond Sports Group LLC				0,000 % fällig am 07.12.2022	€ 3.050	3.601	0,02
3,700 % fällig am 01.12.2029	700	760	0,00	5,375 % fällig am 15.08.2026	6.300	4.087	0,02	0,157 % fällig am 01.12.2024	3.387	3.915	0,02
Chubb INA Holdings, Inc.				Discovery Communications LLC				0,189 % fällig am 15.11.2023	1.133	1.327	0,01
0,300 % fällig am 15.12.2024	€ 1.600	1.916	0,01	2,500 % fällig am 20.09.2024	£ 10.000	14.420	0,07	2,330 % fällig am 25.11.2025	6.250	7.676	0,04
0,875 % fällig am 15.12.2029	200	245	0,00	Doctors Co. An Interinsurance Exchange				3,021 % fällig am 06.03.2024	14.190	17.674	0,08
Churchill Downs, Inc.				6,500 % fällig am 15.10.2023	\$ 17.925	19.264	0,09	3,250 % fällig am 15.09.2025	1.500	1.910	0,01
4,750 % fällig am 15.01.2028	\$ 2.000	2.072	0,01	DTE Electric Co.				3,810 % fällig am 09.01.2024	\$ 1.200	1.257	0,01
CIT Group, Inc.				1,900 % fällig am 01.04.2028	5.000	5.081	0,02	4,535 % fällig am 06.03.2025	£ 7.400	10.977	0,05
5,250 % fällig am 07.03.2025	2.100	2.369	0,01	Duquesne Light Holdings, Inc.				5,125 % fällig am 16.06.2025	\$ 700	772	0,00
Citigroup, Inc.				5,900 % fällig am 01.12.2021	200	204	0,00	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			
2,312 % fällig am 04.11.2022	1.700	1.711	0,01	Enable Midstream Partners LP				6,500 % fällig am 01.10.2025	19.950	20.748	0,10
2,561 % fällig am 01.05.2032 (i)	10.300	10.492	0,05	4,400 % fällig am 15.03.2027	7.145	7.885	0,04	Fortune Brands Home & Security, Inc.			
2,572 % fällig am 03.06.2031 (i)	43.400	44.660	0,21	Energy Transfer LP				3,250 % fällig am 15.09.2029	2.250	2.424	0,01
Citrix Systems, Inc.				5,150 % fällig am 01.02.2043	2.494	2.827	0,01	Freedom Mortgage Corp.			
3,300 % fällig am 01.03.2030	2.700	2.844	0,01	5,150 % fällig am 15.03.2045	11.203	12.982	0,06	7,625 % fällig am 01.05.2026	6.100	6.358	0,03
4,500 % fällig am 01.12.2027	4.500	5.104	0,02	5,300 % fällig am 01.04.2044	4.430	5.124	0,02	8,125 % fällig am 15.11.2024	12.541	13.008	0,06
Cleveland Electric Illuminating Co.				5,300 % fällig am 15.04.2047	675	791	0,00	8,250 % fällig am 15.04.2025	16.450	17.224	0,08
3,500 % fällig am 01.04.2028	3.165	3.389	0,02	5,350 % fällig am 15.05.2045	7.681	8.934	0,04	Freepoint Minerals Corp.			
Comcast Corp.				6,050 % fällig am 01.06.2041	8.600	10.942	0,05	9,500 % fällig am 01.06.2031	300	446	0,00
1,950 % fällig am 15.01.2031	4.800	4.737	0,02	6,500 % fällig am 01.02.2042	1.800	2.341	0,01	Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc.			
2,650 % fällig am 01.02.2030	17.000	17.911	0,08	6,850 % fällig am 15.02.2040	40	51	0,00	2,375 % fällig am 16.02.2031	5.400	5.276	0,03
2,800 % fällig am 15.01.2051	34.500	33.253	0,16	7,500 % fällig am 01.07.2038	6.584	9.299	0,04	FS KKR Capital Corp.			
3,750 % fällig am 01.04.2040	41.600	46.968	0,22	7,600 % fällig am 01.02.2024	15.400	17.525	0,08	2,625 % fällig am 15.01.2027	5.800	5.741	0,03
Community Health Systems, Inc.				Entergy Louisiana LLC				GE Capital Funding LLC			
4,750 % fällig am 15.02.2031	5.000	5.025	0,02	3,780 % fällig am 01.04.2025	26.800	29.151	0,14	3,450 % fällig am 15.05.2025	8.500	9.256	0,04
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.				Enterprise Products Operating LLC				4,400 % fällig am 15.05.2030	61.200	71.369	0,33
3,600 % fällig am 15.06.2061	1.000	1.037	0,01	4,875 % fällig am 16.08.2077	7.500	7.365	0,03	4,550 % fällig am 15.05.2032	3.200	3.828	0,02
5,500 % fällig am 01.12.2039	303	401	0,00								

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
General Electric Co. 3,625 % fällig am 01.05.2030	\$ 500	\$ 558	0,00	Intercontinental Exchange, Inc. 1,850 % fällig am 15.09.2032	\$ 17.400	\$ 16.508	0,08	Live Nation Entertainment, Inc. 3,750 % fällig am 15.01.2028	\$ 2.000	\$ 2.012	0,01
6,875 % fällig am 10.01.2039	616	924	0,00	3,000 % fällig am 15.09.2060	17.150	16.629	0,08	6,500 % fällig am 15.05.2027	23.545	26.200	0,12
General Mills, Inc. 0,450 % fällig am 15.01.2026	€ 4.000	4.826	0,02	3,750 % fällig am 01.12.2025	1.100	1.221	0,01	Marriott International, Inc. 2,300 % fällig am 15.01.2022	10.200	10.274	0,05
Globe Life, Inc. 2,150 % fällig am 15.08.2030	\$ 10.000	9.848	0,05	International Flavors & Fragrances, Inc. 1,832 % fällig am 15.10.2027	13.500	13.474	0,06	3,500 % fällig am 15.10.2032	15.800	16.805	0,08
GLP Capital LP 3,350 % fällig am 01.09.2024	4.300	4.567	0,02	International Lease Finance Corp. 8,625 % fällig am 15.01.2022	1.300	1.356	0,01	3,600 % fällig am 15.04.2024	5.500	5.870	0,03
4,000 % fällig am 15.01.2031	3.900	4.207	0,02	IPALCO Enterprises, Inc. 3,700 % fällig am 01.09.2024	8.958	9.649	0,05	4,150 % fällig am 01.12.2023	5.800	6.223	0,03
5,300 % fällig am 15.01.2029	17.714	20.681	0,10	4,250 % fällig am 01.05.2030	200	225	0,00	4,625 % fällig am 15.06.2030	14.900	17.173	0,08
5,375 % fällig am 15.04.2026	6.000	6.921	0,03	Jackson National Life Global Funding 2,650 % fällig am 21.06.2024	7.800	8.177	0,04	5,750 % fällig am 01.05.2025	4.000	4.620	0,02
5,750 % fällig am 01.06.2028	14.800	17.630	0,08	3,250 % fällig am 30.01.2024	10.200	10.870	0,05	Masco Corp. 6,500 % fällig am 15.08.2032	500	667	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 0,900 % fällig am 23.02.2023	25.200	25.433	0,12	Jefferies Finance LLC 6,250 % fällig am 03.06.2026	16.000	16.800	0,08	MassMutual Global Funding 2,500 % fällig am 17.10.2022	5.436	5.592	0,03
1,181 % fällig am 05.06.2023	36.200	36.486	0,17	Jersey Central Power & Light Co. 4,300 % fällig am 15.01.2026	480	532	0,00	3,400 % fällig am 08.03.2026	3.900	4.290	0,02
1,326 % fällig am 15.05.2026	20.000	20.540	0,10	4,700 % fällig am 01.04.2024	4.100	4.465	0,02	McDonald's Corp. 2,625 % fällig am 01.09.2029	12.800	13.467	0,06
3,125 % fällig am 25.07.2029	€ 8.700	13.368	0,06	JetBlue Pass-Through Trust 4,000 % fällig am 15.05.2034	1.161	1.284	0,01	MetLife Capital Trust 7,875 % fällig am 15.12.2067	3.282	4.578	0,02
3,375 % fällig am 27.03.2025	€ 3.500	4.656	0,02	JPMorgan Chase & Co. 1,063 % fällig am 23.07.2024	24.600	24.949	0,12	MetLife, Inc. 5,875 % fällig am 15.03.2028 (f)	7.400	8.568	0,04
4,223 % fällig am 01.05.2029	\$ 20.700	23.624	0,11	2,069 % fällig am 01.06.2029	7.000	7.062	0,03	Metropolitan Edison Co. 3,500 % fällig am 15.03.2023	7.400	7.664	0,04
Goodman U.S. Finance Four LLC 4,500 % fällig am 15.10.2037	7.682	8.889	0,04	2,301 % fällig am 15.10.2025	34.600	36.060	0,17	4,000 % fällig am 15.04.2025	6.700	7.106	0,03
Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % fällig am 15.03.2028	13.675	14.837	0,07	2,580 % fällig am 22.04.2032	12.500	12.838	0,06	4,300 % fällig am 15.01.2029	765	859	0,00
Guardian Life Global Funding 1,100 % fällig am 23.06.2025	4.000	4.016	0,02	2,739 % fällig am 15.10.2030	38.200	40.013	0,19	Metropolitan Life Global Funding 0,450 % fällig am 01.09.2023	5.600	5.599	0,03
2,900 % fällig am 06.05.2024	5.000	5.305	0,03	3,509 % fällig am 23.01.2029	1.400	1.544	0,01	MGM Growth Properties Operating Partnership LP 3,875 % fällig am 15.02.2029	7.900	8.044	0,04
Gulfstream Natural Gas System LLC 4,600 % fällig am 15.09.2025	4.860	5.430	0,03	3,702 % fällig am 06.05.2030	9.900	11.069	0,05	4,500 % fällig am 15.01.2028	4.500	4.768	0,02
Hanover Insurance Group, Inc. 4,500 % fällig am 15.04.2026	6.140	6.947	0,03	3,782 % fällig am 01.02.2028	3.769	4.188	0,02	5,750 % fällig am 01.02.2027	2.100	2.340	0,01
Hasbro, Inc. 2,600 % fällig am 19.11.2022	1.100	1.132	0,01	3,797 % fällig am 23.07.2024	12.300	13.109	0,06	Micron Technology, Inc. 4,640 % fällig am 06.02.2024	5.180	5.682	0,03
Hawaiian Airlines Pass-Through Certificates 7,375 % fällig am 15.09.2027	16.307	18.600	0,09	Kansas City Southern 3,125 % fällig am 01.06.2026	5.200	5.632	0,03	Mid-America Apartments LP 3,600 % fällig am 01.06.2027	2.025	2.256	0,01
HCA, Inc. 3,500 % fällig am 15.07.2051	5.000	5.007	0,02	Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032	1.200	1.186	0,01	3,950 % fällig am 15.03.2029	12.100	13.741	0,06
4,125 % fällig am 15.06.2029	3.300	3.719	0,02	3,800 % fällig am 15.01.2023	19.269	20.063	0,09	4,000 % fällig am 15.11.2025	2.000	2.223	0,01
4,500 % fällig am 15.02.2027	4.000	4.525	0,02	4,375 % fällig am 01.10.2025	4.400	4.881	0,02	Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC 4,100 % fällig am 15.05.2028	22.100	24.895	0,12
Helmerich & Payne, Inc. 4,650 % fällig am 15.03.2025	6.866	7.644	0,04	Kinder Morgan Energy Partners LP 6,950 % fällig am 15.01.2038	720	1.032	0,01	Midwest Connector Capital Co. LLC 3,625 % fällig am 01.04.2022	8.000	8.136	0,04
Hess Corp. 7,300 % fällig am 15.08.2031	1.096	1.488	0,01	7,500 % fällig am 15.11.2040	71	105	0,00	3,900 % fällig am 01.04.2024	33.682	35.248	0,17
Highwoods Realty LP 2,600 % fällig am 01.02.2031	7.300	7.358	0,03	Kinder Morgan, Inc. 7,420 % fällig am 15.02.2037	3.700	4.842	0,02	4,625 % fällig am 01.04.2029	300	319	0,00
3,050 % fällig am 15.02.2030	3.400	3.557	0,02	7,750 % fällig am 15.01.2032	3.900	5.600	0,03	Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % fällig am 20.06.2027	8.400	9.259	0,04
4,200 % fällig am 15.04.2029	4.300	4.833	0,02	8,050 % fällig am 15.10.2030	36	50	0,00	Mississippi Power Co. 4,250 % fällig am 15.03.2042	2.800	3.315	0,02
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2032	4.400	4.351	0,02	KKR Financial Holdings LLC 5,400 % fällig am 23.05.2033	11.400	12.131	0,06	Monongahela Power Co. 3,550 % fällig am 15.05.2027	7.373	8.138	0,04
3,750 % fällig am 01.05.2029	10.550	10.669	0,05	5,400 % fällig am 23.05.2033	11.400	12.131	0,06	4,100 % fällig am 15.04.2024	2.937	3.164	0,02
4,000 % fällig am 01.05.2031	14.350	14.496	0,07	KKR Group Finance Co. LLC 3,500 % fällig am 25.08.2050	13.900	14.597	0,07	5,400 % fällig am 15.12.2043	150	197	0,00
4,875 % fällig am 15.01.2030	2.400	2.567	0,01	Kraft Heinz Foods Co. 2,250 % fällig am 25.05.2028	€ 600	776	0,00	Morgan Stanley 1,382 % fällig am 08.05.2024	6.300	6.417	0,03
5,375 % fällig am 01.05.2025	3.800	4.011	0,02	4,125 % fällig am 01.07.2027	€ 6.550	10.147	0,05	7,500 % fällig am 02.04.2032 (i)	50.000	40.580	0,19
Host Hotels & Resorts LP 3,375 % fällig am 15.12.2029	5.000	5.249	0,02	4,625 % fällig am 30.01.2029	\$ 5.900	6.873	0,03	MPLX LP 1,223 % fällig am 09.09.2022	6.000	6.004	0,03
3,500 % fällig am 15.09.2030	6.000	6.303	0,03	Las Vegas Sands Corp. 2,900 % fällig am 25.06.2025	7.400	7.714	0,04	4,900 % fällig am 15.04.2058	3.341	4.007	0,02
3,875 % fällig am 01.04.2024	8.700	9.292	0,04	3,200 % fällig am 08.08.2024	152.300	159.923	0,75	MPT Operating Partnership LP 3,500 % fällig am 15.03.2031	1.900	1.921	0,01
4,000 % fällig am 15.06.2025	1.725	1.868	0,01	3,500 % fällig am 18.08.2026	30.200	32.131	0,15	3,692 % fällig am 05.06.2028	€ 25.362	37.401	0,18
Howard Hughes Corp. 4,125 % fällig am 01.02.2029	300	301	0,00	Lazard Group LLC 4,375 % fällig am 11.03.2029	5.268	5.991	0,03	4,625 % fällig am 01.08.2029	\$ 11.000	11.807	0,06
4,375 % fällig am 01.02.2031	100	100	0,00	Legacy LifePoint Health LLC 4,375 % fällig am 15.02.2027	100	101	0,00	Murphy Oil USA, Inc. 3,750 % fällig am 15.02.2031	300	297	0,00
Hudson Pacific Properties LP 3,250 % fällig am 15.01.2030	4.325	4.569	0,02	Lehman Brothers Holdings, Inc. 0,000 % fällig am 31.12.2013 ^	900	7	0,00	Nasdaq, Inc. 2,500 % fällig am 21.12.2040	600	559	0,00
Huntsman International LLC 4,500 % fällig am 01.05.2029	4.333	4.932	0,02	5,259 % fällig am 12.06.2013 ^	€ 2.807	42	0,00	National Fuel Gas Co. 2,950 % fällig am 01.03.2031	3.900	3.930	0,02
Hyatt Hotels Corp. 3,135 % fällig am 01.09.2022	39.100	39.249	0,18	6,875 % fällig am 02.05.2049 ^	\$ 3.000	23	0,00	National Health Investors, Inc. 3,000 % fällig am 01.02.2031	1.900	1.841	0,01
5,375 % fällig am 15.08.2021	2.700	2.708	0,01	Leidos, Inc. 2,300 % fällig am 15.02.2031	2.134	2.087	0,01	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,125 % fällig am 15.12.2030	2.500	2.493	0,01
Hyundai Capital America 0,875 % fällig am 14.06.2024	13.600	13.544	0,06	Lendlease U.S. Capital, Inc. 4,500 % fällig am 26.05.2026	7.958	8.801	0,04	Nationwide Financial Services, Inc. 3,900 % fällig am 30.11.2049	10.400	11.503	0,05
1,150 % fällig am 10.11.2022	10.000	10.071	0,05	Level 3 Financing, Inc. 3,400 % fällig am 01.03.2027	3.500	3.721	0,02	Nationwide Mutual Insurance Co. 9,375 % fällig am 15.08.2039	200	349	0,00
1,500 % fällig am 15.06.2026	13.000	12.913	0,06	3,625 % fällig am 15.01.2029	2.300	2.223	0,01	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.05.2027	€ 13.750	18.791	0,09
2,850 % fällig am 01.11.2022	3.100	3.189	0,02	3,875 % fällig am 15.11.2029	14.000	15.012	0,07				
Infor, Inc. 1,450 % fällig am 15.07.2023	7.600	7.691	0,04	Liberty Mutual Group, Inc. 3,625 % fällig am 23.05.2059	€ 3.100	3.839	0,02				
1,750 % fällig am 15.07.2025	5.000	5.108	0,02	4,569 % fällig am 01.02.2029	\$ 800	936	0,00				
Integris Baptist Medical Center, Inc. 3,875 % fällig am 15.08.2050	8.800	9.960	0,05	Life Storage LP 3,500 % fällig am 01.07.2026	9.200	10.071	0,05				
				3,875 % fällig am 15.12.2027	1.100	1.229	0,01				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
3,625 % fällig am 15.06.2030	€ 31.373	\$ 44.321	0,21	4,950 % fällig am 01.07.2050	8.100	\$ 8.345	0,04	Shift4 Payments LLC			
3,875 % fällig am 15.11.2029	28.250	40.411	0,19	Pacific Life Global Funding				4,625 % fällig am 01.11.2026	\$ 1.000	\$ 1.045	0,01
4,625 % fällig am 15.05.2029	6.400	9.498	0,04	1,200 % fällig am 24.06.2025	\$ 8.600	\$ 8.631	0,04	SL Green Operating Partnership LP			
Neuberger Berman Group LLC				Pacific Life Insurance Co.				1,136 % fällig am 16.08.2021	4.100	4.101	0,02
4,500 % fällig am 15.03.2027	\$ 13.000	14.664	0,07	9,250 % fällig am 15.06.2039	600	983	0,00	3,250 % fällig am 15.10.2022	2.686	2.766	0,01
Newmark Group, Inc.				Pennsylvania Electric Co.				SL Green Realty Corp.			
6,125 % fällig am 15.11.2023	900	992	0,00	3,250 % fällig am 15.03.2028	2.289	2.406	0,01	4,500 % fällig am 01.12.2022	22.800	23.750	0,11
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				3,600 % fällig am 01.06.2029	7.170	7.680	0,04	SLM Corp.			
4,800 % fällig am 01.12.2077	140	157	0,00	4,150 % fällig am 15.04.2025	2.305	2.491	0,01	4,200 % fällig am 29.10.2025	6.600	7.115	0,03
5,650 % fällig am 01.05.2079	500	582	0,00	6,150 % fällig am 01.10.2038	4.715	6.189	0,03	5,125 % fällig am 05.04.2022	6.950	7.103	0,03
NextEra Energy Operating Partners LP				Penske Truck Leasing Co. LP				Southern California Edison Co.			
4,250 % fällig am 15.07.2024	600	634	0,00	3,350 % fällig am 01.11.2029	18.800	20.089	0,09	2,500 % fällig am 01.06.2031	6.200	6.221	0,03
NGPL PipeCo LLC				PetSmart, Inc.				2,850 % fällig am 01.08.2029	700	728	0,00
4,875 % fällig am 15.08.2027	9.455	10.843	0,05	4,750 % fällig am 15.02.2028	3.500	3.640	0,02	2,950 % fällig am 01.02.2051	12.200	11.087	0,05
Nissan Motor Acceptance Corp.				Philip Morris International, Inc.				3,650 % fällig am 01.02.2050	8.190	8.206	0,04
0,836 % fällig am 28.09.2022	1.650	1.652	0,01	2,750 % fällig am 19.03.2025	€ 5.000	6.536	0,03	3,650 % fällig am 01.06.2051	5.000	5.027	0,02
1,078 % fällig am 13.01.2022	1.400	1.403	0,01	Physicians Realty LP				3,900 % fällig am 01.12.2041	450	466	0,00
2,600 % fällig am 28.09.2022	13.152	13.429	0,06	3,950 % fällig am 15.01.2028	\$ 13.100	14.400	0,07	4,000 % fällig am 01.04.2047	8.600	9.063	0,04
2,650 % fällig am 13.07.2022	7.017	7.134	0,03	4,300 % fällig am 15.03.2027	11.100	12.531	0,06	4,125 % fällig am 01.03.2048	3.343	3.573	0,02
2,800 % fällig am 13.01.2022	1.755	1.775	0,01	Piedmont Natural Gas Co., Inc.				5,625 % fällig am 01.02.2036	2.053	2.613	0,01
Northwest Airlines Pass-Through Trust				4,100 % fällig am 18.09.2034	290	334	0,00	5,950 % fällig am 01.02.2038	400	520	0,00
7,041 % fällig am 01.10.2023	116	116	0,00	Pioneer Natural Resources Co.				6,650 % fällig am 01.04.2029	14.700	18.366	0,09
NVR, Inc.				7,200 % fällig am 15.01.2028	500	646	0,00	Southern Co. Gas Capital Corp.			
3,000 % fällig am 15.05.2030	34.300	36.423	0,17	Plains All American Pipeline LP				1,750 % fällig am 15.01.2031	14.500	13.743	0,06
Oaktree Specialty Lending Corp.				6,700 % fällig am 15.05.2036	300	369	0,00	3,250 % fällig am 15.06.2026	1.200	1.302	0,01
3,500 % fällig am 25.02.2025	2.100	2.207	0,01	PNC Bank N.A.				4,400 % fällig am 30.05.2047	400	472	0,00
Occidental Petroleum Corp.				0,634 % fällig am 22.07.2022	3.300	3.301	0,02	5,875 % fällig am 15.03.2041	2.020	2.791	0,01
1,606 % fällig am 15.08.2022	5.000	4.977	0,02	Principal Life Global Funding				Southwest Airlines Co.			
Oglethorpe Power Corp.				3,000 % fällig am 18.04.2026	6.100	6.593	0,03	5,125 % fällig am 15.06.2027	8.100	9.535	0,04
5,950 % fällig am 01.11.2039	4.000	5.383	0,03	Progress Energy, Inc.				Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust			
Omega Healthcare Investors, Inc.				7,750 % fällig am 01.03.2031	750	1.071	0,01	6,650 % fällig am 01.08.2022	629	641	0,00
3,625 % fällig am 01.10.2029	500	536	0,00	Protective Life Corp.				Spirit AeroSystems, Inc.			
4,500 % fällig am 01.04.2027	500	560	0,00	3,400 % fällig am 15.01.2030	22.700	24.240	0,11	3,850 % fällig am 15.06.2026	5.500	5.753	0,03
5,250 % fällig am 15.01.2026	9.800	11.192	0,05	Protective Life Global Funding				5,500 % fällig am 15.01.2025	1.800	1.918	0,01
OneMain Finance Corp.				1,999 % fällig am 14.09.2021	2.350	2.359	0,01	7,500 % fällig am 15.04.2025	6.400	6.850	0,03
5,375 % fällig am 15.11.2029	7.400	8.064	0,04	Provident Funding Associates LP				Spirit Airlines Pass-Through Trust			
6,875 % fällig am 15.03.2025	8.700	9.830	0,05	6,375 % fällig am 15.06.2025	4.400	4.473	0,02	4,100 % fällig am 01.10.2029	2.961	3.102	0,01
8,250 % fällig am 01.10.2023	100	113	0,00	Radian Group, Inc.				Spirit Realty LP			
ONEOK Partners LP				4,500 % fällig am 01.10.2024	200	214	0,00	3,200 % fällig am 15.01.2027	5.100	5.434	0,03
6,200 % fällig am 15.09.2043	3.558	4.697	0,02	6,625 % fällig am 15.03.2025	5.975	6.751	0,03	3,200 % fällig am 15.02.2031	2.345	2.449	0,01
6,850 % fällig am 15.10.2037	5.945	8.118	0,04	Realty Income Corp.				4,000 % fällig am 15.07.2029	1.100	1.223	0,01
ONEOK, Inc.				1,625 % fällig am 15.12.2030	€ 600	822	0,00	4,450 % fällig am 15.09.2026	7.700	8.597	0,04
4,350 % fällig am 15.03.2029	22.940	25.917	0,12	Regency Centers LP				Sprint Communications, Inc.			
4,550 % fällig am 15.07.2028	17.100	19.523	0,09	2,950 % fällig am 15.09.2029	\$ 5.200	5.482	0,03	6,000 % fällig am 15.11.2022	6.600	6.996	0,03
Oracle Corp.				3,700 % fällig am 15.06.2030	6.400	7.091	0,03	Sprint Corp.			
3,850 % fällig am 01.04.2060	1.900	2.023	0,01	Reliance Standard Life Global Funding				7,125 % fällig am 15.06.2024	1.525	1.761	0,01
4,100 % fällig am 25.03.2061 (i)	7.900	8.778	0,04	2,750 % fällig am 21.01.2027	6.500	6.859	0,03	7,875 % fällig am 15.09.2023	4.600	5.232	0,02
Organon Finance LLC				Rio Oil Finance Trust				Sprint Spectrum Co. LLC			
2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 2.500	3.011	0,01	8,200 % fällig am 06.04.2028	4.656	5.392	0,03	3,360 % fällig am 20.03.2023	2.494	2.509	0,01
5,125 % fällig am 30.04.2031	\$ 4.900	5.054	0,02	9,250 % fällig am 06.07.2024	4.287	4.758	0,02	4,738 % fällig am 20.03.2025	20.063	21.577	0,10
Ovintiv Exploration, Inc.				9,750 % fällig am 06.01.2027	220	260	0,00	5,152 % fällig am 20.09.2029	4.300	4.955	0,02
5,625 % fällig am 01.07.2024	750	835	0,00	Rockies Express Pipeline LLC				Standard Industries, Inc.			
Pacific Gas & Electric Co.				4,800 % fällig am 15.05.2030	7.000	7.013	0,03	2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 30.200	35.717	0,17
1,598 % fällig am 16.06.2022	1.750	1.751	0,01	Sabine Pass Liquefaction LLC				4,375 % fällig am 15.07.2030	\$ 12.100	12.514	0,06
2,950 % fällig am 01.03.2026 ^	7.100	7.272	0,03	4,200 % fällig am 15.03.2028	6.100	6.893	0,03	4,750 % fällig am 15.01.2028	9.800	10.270	0,05
3,000 % fällig am 15.06.2028	18.300	18.410	0,09	4,500 % fällig am 15.05.2030	11.400	13.170	0,06	5,000 % fällig am 15.02.2027	12.014	12.457	0,06
3,150 % fällig am 01.01.2026	11.099	11.456	0,05	5,000 % fällig am 15.03.2027	1.900	2.196	0,01	Station Casinos LLC			
3,250 % fällig am 15.06.2023 ^	7.461	7.713	0,04	5,625 % fällig am 15.04.2023	32.925	35.384	0,17	4,500 % fällig am 15.02.2028	4.400	4.484	0,02
3,250 % fällig am 01.06.2031	3.980	3.919	0,02	5,750 % fällig am 15.05.2024	11.555	12.974	0,06	Stifel Financial Corp.			
3,300 % fällig am 15.03.2027 ^	12.635	13.094	0,06	Sammons Financial Group, Inc.				4,000 % fällig am 15.05.2030	8.900	9.886	0,05
3,300 % fällig am 01.12.2027 ^	18.869	19.416	0,09	4,450 % fällig am 12.05.2027	700	785	0,00	STORE Capital Corp.			
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	10.276	10.792	0,05	San Diego Gas & Electric Co.				2,750 % fällig am 18.11.2030	2.100	2.118	0,01
3,450 % fällig am 01.07.2025	6.277	6.583	0,03	1,700 % fällig am 01.10.2030	10.610	10.254	0,05	4,500 % fällig am 15.03.2028	800	905	0,00
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	17.300	18.155	0,09	3,320 % fällig am 15.04.2050	5.200	5.519	0,03	4,625 % fällig am 15.03.2029	2.200	2.504	0,01
3,500 % fällig am 01.08.2050	1.000	893	0,00	3,750 % fällig am 01.06.2047	100	115	0,00	Stryker Corp.			
3,750 % fällig am 15.02.2024 ^	3.483	3.654	0,02	4,100 % fällig am 15.06.2049	9.000	10.880	0,05	1,950 % fällig am 15.06.2030	10.250	10.148	0,05
3,750 % fällig am 01.07.2028	100	105	0,00	Santander Holdings USA, Inc.				Synchrony Financial			
3,750 % fällig am 15.08.2042 ^	3.500	3.200	0,02	3,244 % fällig am 05.10.2026	2.700	2.889	0,01	3,950 % fällig am 01.12.2027	5.500	6.136	0,03
3,850 % fällig am 15.11.2023 ^	5.477	5.744	0,03	3,500 % fällig am 07.06.2024	12.800	13.700	0,06	Syneos Health, Inc.			
3,950 % fällig am 01.12.2047	2.400	2.236	0,01	4,500 % fällig am 17.07.2025	4.300	4.775	0,02	3,625 % fällig am 15.01.2029	2.500	2.478	0,01
4,000 % fällig am 01.12.2046 ^	100	94	0,00	SBA Communications Corp.				Synovus Bank			
4,250 % fällig am 01.08.2023	6.700	7.103	0,03	3,125 % fällig am 01.02.2029	2.000	1.933	0,01	2,289 % fällig am 10.02.2023	3.600	3.628	0,02
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	300	289	0,00	SBA Tower Trust				Sysco Corp.			
4,450 % fällig am 15.04.2042 ^	7.443	7.389	0,03	1,884 % fällig am 15.07.2050	27.200	27.577	0,13	5,650 % fällig am 01.04.2025	1.400	1.623	0,01
4,500 % fällig am 01.07.2040	4.900	4.910	0,02	2,836 % fällig am 15.01.2050	7.509	7.887	0,04	Systems Energy Resources, Inc.			
4,500 % fällig am 15.12.2041 ^	3.600	3.515	0,02	SBL Holdings, Inc.				2,140 % fällig am 09.12.2025	18.400	18.612	0,09
4,550 % fällig am 01.07.2030	4.701	5.032	0,02	5,125 % fällig am 13.11.2026	1.800	2.001	0,01	T-Mobile USA, Inc.			
4,650 % fällig am 01.08.2028	1.600	1.763	0,01					1,500 % fällig am 15.02.2026	11.300	11.419	0,05
4,750 % fällig am 15.02.2044 ^	1.800	1.826	0,01								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
2,893 % fällig am 25.02.2034	\$ 6	\$ 6	0,00	MortgageIT Trust				2,031 % fällig am 01.04.2037	0	0	0,00
3,171 % fällig am 25.08.2035 ^	55	55	0,00	0,832 % fällig am 25.12.2034	\$ 149	\$ 153	0,00	2,106 % fällig am 01.03.2037	0	0	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				2,203 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00
0,412 % fällig am 25.06.2046 ^	2.845	2.675	0,01	0,542 % fällig am 25.02.2035 ^	306	268	0,00	2,250 % fällig am 01.01.2037	0	0	0,00
3,344 % fällig am 25.11.2036 ^	485	339	0,00	Residential Accredit Loans, Inc. Trust				2,291 % fällig am 01.10.2036	0	0	0,00
BWAY Mortgage Trust				0,512 % fällig am 25.04.2046	6.038	2.382	0,01	2,517 % fällig am 01.09.2037	1	1	0,00
2,909 % fällig am 10.03.2033	461	478	0,00	1,616 % fällig am 25.08.2035	264	244	0,00	2,529 % fällig am 01.09.2037	2	2	0,00
Chase Mortgage Finance Trust				6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	3.594	3.478	0,02	3,000 % fällig am 01.06.2042 - 01.10.2046	50.847	54.010	0,25
2,858 % fällig am 25.02.2037	19	20	0,00	Residential Asset Securitization Trust				3,500 % fällig am 01.10.2045	4.817	5.209	0,03
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				6,500 % fällig am 25.04.2037 ^	2.142	916	0,01	4,000 % fällig am 01.05.2030 - 01.11.2041	357	384	0,00
0,322 % fällig am 25.10.2035	109	109	0,00	Sequoia Mortgage Trust				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
0,372 % fällig am 25.01.2035	165	168	0,00	0,493 % fällig am 20.05.2035	195	201	0,00	3,000 % fällig am 01.09.2051	20	21	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				0,744 % fällig am 20.05.2034	739	760	0,01	3,500 % fällig am 01.08.2051	194.000	204.340	0,96
2,210 % fällig am 25.09.2035	22	23	0,00	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				4,000 % fällig am 01.08.2051	443.700	472.887	2,21
Countrywide Alternative Loan Trust				2,987 % fällig am 25.04.2035	274	280	0,00				
0,513 % fällig am 20.07.2046 ^	5.856	4.657	0,02	Structured Asset Mortgage Investments Trust							
0,652 % fällig am 25.02.2037	48	43	0,00	0,472 % fällig am 25.07.2046 ^	220	192	0,00				
0,712 % fällig am 25.08.2035 ^	728	661	0,01	0,512 % fällig am 25.04.2036	152	145	0,00				
0,792 % fällig am 25.12.2035 ^	1.543	1.497	0,01	0,512 % fällig am 25.05.2036	15	13	0,00				
1,466 % fällig am 25.08.2035 ^	2.207	1.999	0,01	0,593 % fällig am 19.07.2035	2	2	0,00				
5,750 % fällig am 25.04.2047 ^	664	533	0,00	0,652 % fällig am 25.02.2036 ^	31	30	0,00				
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				1,576 % fällig am 25.03.2046	233	233	0,00				
0,552 % fällig am 25.05.2035	5	5	0,00	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates							
2,195 % fällig am 20.02.2036 ^	35	31	0,00	2,242 % fällig am 25.07.2033	255	263	0,00				
2,800 % fällig am 25.11.2034	24	24	0,00	2,337 % fällig am 25.06.2033	3	3	0,00				
2,808 % fällig am 25.01.2036 ^	314	300	0,00	Thornburg Mortgage Securities Trust							
5,500 % fällig am 25.10.2034	540	556	0,00	2,224 % fällig am 25.09.2037	483	488	0,00				
5,500 % fällig am 25.07.2035	58	48	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
5,500 % fällig am 25.12.2035	246	232	0,00	0,462 % fällig am 25.05.2034	2.128	1.882	0,01				
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	126	118	0,00	0,632 % fällig am 25.12.2045	7	7	0,00				
6,000 % fällig am 25.11.2037 ^	37	29	0,00	0,712 % fällig am 25.01.2045	25	25	0,00				
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				1,116 % fällig am 25.08.2046	9	9	0,00				
2,736 % fällig am 25.06.2033	8	8	0,00	1,717 % fällig am 25.11.2041	193	190	0,00				
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				2,725 % fällig am 25.03.2035	79	83	0,00				
2,148 % fällig am 25.07.2033	4	4	0,00	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
6,500 % fällig am 25.12.2033	20	20	0,00	0,282 % fällig am 25.06.2037	4.108	3.986	0,02				
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				0,956 % fällig am 25.11.2046 ^	2.756	2.385	0,01				
2,858 % fällig am 26.06.2037	8.314	8.379	0,04	3,186 % fällig am 25.06.2033	121	127	0,00				
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				Wells Fargo Alternative Loan Trust							
3,100 % fällig am 27.05.2037	4.668	3.448	0,02	0,632 % fällig am 25.03.2037 ^	1.815	1.610	0,01				
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				2,705 % fällig am 25.07.2037 ^	260	240	0,00				
0,232 % fällig am 25.07.2047	592	563	0,00	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust							
GSC Capital Corp. Mortgage Trust				2,968 % fällig am 25.08.2036 ^	397	392	0,00				
0,452 % fällig am 25.05.2036 ^	546	536	0,00								
GSMPs Mortgage Loan Trust											
0,442 % fällig am 25.01.2036	2.453	2.050	0,01								
GSR Mortgage Loan Trust											
1,790 % fällig am 25.04.2032	131	117	0,00								
2,793 % fällig am 25.09.2035	1	1	0,00								
HarborView Mortgage Loan Trust											
0,283 % fällig am 19.08.2037	6.032	5.818	0,01								
0,298 % fällig am 19.12.2036	3.794	3.568	0,02								
0,773 % fällig am 20.06.2035	2.040	2.005	0,01								
2,187 % fällig am 19.04.2034	7	7	0,00								
HomeBanc Mortgage Trust											
0,592 % fällig am 25.03.2035	444	407	0,00								
Impac CMB Trust											
0,792 % fällig am 25.03.2035	320	318	0,00								
IndyMac Mortgage Loan Trust											
2,931 % fällig am 25.03.2036	1.023	917	0,01								
JPMorgan Alternative Loan Trust											
5,692 % fällig am 26.05.2037	302	256	0,00								
JPMorgan Mortgage Trust											
2,849 % fällig am 25.07.2035	29	30	0,00								
Lehman Mortgage Trust											
5,750 % fällig am 25.02.2037 ^	1.777	1.516	0,01								
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust											
2,876 % fällig am 21.11.2034	9	10	0,00								
MASTR Alternative Loan Trust											
5,500 % fällig am 25.02.2034	19	20	0,00								
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust											
0,752 % fällig am 25.06.2028	1	1	0,00								
0,852 % fällig am 25.08.2035	3	3	0,00								
0,859 % fällig am 25.01.2029	192	192	0,00								
2,309 % fällig am 25.05.2033	4	4	0,00								
2,809 % fällig am 25.02.2035	27	27	0,00								
2,842 % fällig am 25.05.2036	426	406	0,00								
6,000 % fällig am 25.04.2036 ^	47	34	0,00								

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS
KURZFRISTIGE SCHULDITITEL								BORSENGEHADELTE FONDS			
Pacific Gas & Electric Co. 1,531 % fällig am 15.11.2021	\$ 21.300	\$ 21.345	0,10	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)	11.356.637	\$ 134.576	0,63	PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	2.587.040	\$ 262.710	1,23
Summe kurzfristige Instrumente		44.361	0,21	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (g)	3.637.652	46.633	0,22	Summe Investmentfonds		\$ 1.275.100	5,97
Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 20.321.585	95,14	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (g)	79.132.691	788.241	3,69				
				PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)	329.257	4.422	0,02				
						1.012.390	4,74				
AKTIEN											
INVESTMENTFONDS											
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN											
PIMCO Funds: Global Investors Series plc – Asia Strategic Interest Bond Fund (g)	3.787.451	38.518	0,18								

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHADELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	1.391	\$ 1.967	0,01
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2021	81	7	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	1.143	1.978	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	7.760	9.716	0,04
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2021	5.277	(131)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	5.249	10.100	0,05
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	770	3.594	0,02
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2021	263	2.327	0,01
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2021	602	760	0,00
				\$ 30.318	0,14
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 30.318	0,14

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Kraft Heinz Foods Co.	(1,000) %	20.06.2022	\$ 6.300	\$ 22	0,00
Toll Brothers Finance Corp.	(1,000)	20.06.2024	23.500	(123)	0,00
				\$ (101)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AES Corp.	5,000 %	20.12.2025	\$ 7.900	\$ (44)	0,00
AES Corp.	5,000	20.06.2026	2.400	9	0,00
Airbus Group Finance BV	1,000	20.12.2025	€ 10.300	153	0,00
Anadarko Petroleum Corp.	1,000	20.06.2022	\$ 300	(1)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2024	11.200	28	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	2.000	14	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	64.400	168	0,00
Atlantia SpA	1,000	20.06.2025	€ 15.200	1.227	0,01
Atlantia SpA	1,000	20.12.2025	1.800	78	0,00
Auchan Holding S.A.	1,000	20.12.2027	2.900	171	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2021	\$ 48.500	(46)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.06.2022	29.900	(396)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2022	63.800	(510)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.06.2023	7.100	172	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 6.800	72	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	23.900	209	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	6.000	42	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	500	5	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	8.900	(84)	0,00
Canadian Natural Resources Ltd.	1,000	20.06.2022	\$ 3.900	(17)	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.12.2021	2.500	122	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.06.2022	26.500	(139)	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.06.2022	15.000	118	0,00

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Co.	5,000 %	20.06.2022	\$ 3.000	\$ 6	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2022	200	(27)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2023	5.400	(432)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2023	8.100	(745)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2023	33.100	253	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	42.850	2.499	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	32.050	622	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	27.900	806	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2021	9.300	(151)	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.06.2022	6.700	(84)	0,00
Hess Corp.	1,000	20.12.2021	1.300	0	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20.12.2023	6.100	(241)	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2023	€ 21.500	590	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.09.2021	\$ 7.200	23	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2021	23.750	380	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2022	6.200	(95)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2022	15.800	(162)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2023	11.000	524	0,00
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2026	11.300	50	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2023	€ 13.300	(297)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	25.300	(898)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	55.700	(2.381)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	800	89	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	2.300	94	0,00
Ryder System, Inc.	1,000	20.06.2022	\$ 9.400	(158)	0,00
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.06.2022	5.900	(71)	0,00
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.12.2022	17.800	(120)	0,00
Simon Property Group LP	1,000	20.06.2022	6.300	(74)	0,00
Stellantis NV	5,000	20.06.2026	€ 14.900	(41)	0,00
Syngenta Finance N.V.	1,000	20.06.2028	2.600	2	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2026	17.000	106	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	7.800	(22)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	63.700	1.564	0,01
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	4.700	38	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2022	\$ 3.000	(24)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	€ 26.100	264	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	12.700	143	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2024	4.100	46	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	11.100	21	0,00
				\$ 3.448	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽³⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000 %	20.06.2026	\$ 100.400	\$ 130	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 1.020.400	6.447	0,03
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	1.208.000	1.756	0,01
				\$ 8.333	0,04

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt/ variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.09.2025	£ 50.200	\$ 508	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	89.200	(150)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2023	¥ 910.000	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,789	02.01.2023	BRL 4.006.400	(214)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	CAD 49.900	(4)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,250	16.06.2031	51.600	615	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,270	03.03.2022	286.300	1.883	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025	40.800	134	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	52.500	173	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2022	129.700	467	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	334.800	6.147	0,03
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	60.400	879	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2025	1.000	15	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,640	18.02.2026	\$ 205.700	(1.814)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,935	22.06.2051	13.000	(375)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,943	15.06.2051	35.200	(1.082)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,945	23.06.2051	11.900	(371)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,968	23.06.2051	18.300	(665)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,848	17.12.2025	ZAR 96.000	(252)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,848	11.01.2026	170.500	(439)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,850	07.01.2026	287.300	(728)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,025	04.12.2025	3.724.600	(8.075)	(0,04)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,410	31.01.2025	CLP 20.848.000	(560)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,000	19.09.2023	HUF 37.770.400	(629)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250 %	19.09.2023	HUF 16.157.700	\$ (626)	0,00	
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,000	18.12.2029	¥ 5.198.520	(596)	0,00	
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	7.992.900	(1.361)	(0,01)	
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	1,000	20.09.2024	1.829.900	56	0,00	
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,400	05.03.2026	MXN 4.266.000	(10.044)	(0,05)	
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,015	03.06.2026	844.700	(1.006)	(0,01)	
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,060	04.06.2026	2.000.000	(2.193)	(0,01)	
Zahlung	UKRPI	3,530	15.10.2031	£ 60.800	1.668	0,01	
						\$ (18.636)	(0,09)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (6.956)	(0,03)

- (1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.
- (2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	53.270	\$ 6.064	\$ 11.096	0,05
JPM	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	35.260	3.891	7.345	0,04
MYC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	29.09.2021	156.800	3.450	702	0,00
							\$ 13.405	\$ 19.143	0,09

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	21.500	\$ 121	\$ 3	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,156	05.08.2021	5.800	55	18	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	6.300	59	25	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	16.500	94	61	0,00
					\$ 329	\$ 107	0,00

VERKAUFSoPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000 %	20.10.2021	11.900	\$ (54)	\$ (33)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	130.100	(127)	(25)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	39.500	(41)	(3)	0,00
BPS	Put – OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	11.400	(71)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	35.000	(41)	(7)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	19.000	(26)	(7)	0,00
BRC	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	53.900	(40)	(39)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	53.900	(67)	(18)	0,00
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	88.900	(49)	(57)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	88.900	(117)	(4)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	34.800	(39)	(3)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	109.300	(152)	(30)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	36.300	(42)	(8)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	34.600	(38)	(7)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	36.000	(39)	(6)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	76.000	(103)	(30)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	48.900	(48)	(33)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	230.600	(246)	(139)	(0,01)
CBK	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	14.000	(63)	(39)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	33.800	(36)	(5)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	128.900	(124)	(28)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
DUB	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475 %	18.08.2021	41.100	\$ (33)	\$ (30)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	41.100	(49)	(14)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	260.300	(263)	(65)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	127.000	(143)	(25)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	38.300	(41)	(7)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	33.500	(44)	(13)	0,00
FBF	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	55.600	(62)	(52)	0,00
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	15.09.2021	7.000	(41)	(16)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	64.000	(67)	(16)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	29.600	(29)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	35.100	(45)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	37.800	(38)	(5)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	75.500	(80)	(50)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	75.200	(79)	(43)	0,00
JPM	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	39.200	(52)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	20.000	(26)	(1)	0,00
MYC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	67.500	(83)	(41)	0,00
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	10.700	(26)	(2)	0,00
						\$ (2.764)	\$ (908)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month CAD-LIBOR	Erhalt	0,013 %	06.07.2021	83.100	\$ (118)	\$ (7)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month CAD-LIBOR	Zahlung	0,015	06.07.2021	83.100	(118)	(38)	0,00
BPS	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	159.840	(5.928)	(10.868)	(0,05)
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	14.07.2021	33.300	(210)	(352)	0,00
CBK	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	14.07.2021	33.300	(210)	(20)	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	06.07.2021	41.700	(313)	(882)	(0,01)
DUB	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	23.07.2021	40.100	(253)	(309)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	23.07.2021	40.100	(253)	(154)	0,00
GLM	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	06.07.2021	41.700	(329)	0	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	21.07.2021	17.400	(135)	(88)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	21.07.2021	17.400	(135)	(70)	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	11.08.2021	33.200	(340)	(440)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	11.08.2021	33.200	(340)	(141)	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	11.08.2021	33.200	(340)	(440)	0,00
JPM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	105.770	(3.823)	(7.192)	(0,04)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	15.900	(122)	0	0,00
MYC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	19.07.2021	45.400	(196)	(288)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	19.07.2021	45.400	(196)	(7)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	156.800	(1.247)	(98)	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,019	02.07.2021	20.700	(126)	(502)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,022	02.07.2021	20.700	(126)	0	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	10.08.2021	33.000	(450)	(739)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	10.08.2021	33.000	(450)	(27)	0,00
						\$ (15.418)	\$ (22.222)	(0,10)	

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
FAR	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	67.200	\$ (294)	\$ (60)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	05.08.2021	16.900	(60)	(25)	0,00
GSC	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,797	05.08.2021	16.900	(51)	(21)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,227	07.07.2021	23.000	(118)	(36)	0,00
JPM	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,367	05.08.2021	10.400	(35)	(29)	0,00
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	12.08.2021	23.100	(74)	(38)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	11.600	(73)	(18)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	12.500	(78)	(24)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	11.500	(40)	(13)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	33.000	(103)	(46)	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	11.500	(23)	(9)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,375	07.07.2021	2.200	(9)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,547	07.07.2021	5.700	(22)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,609	07.07.2021	17.700	(75)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,672	07.07.2021	5.900	(25)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,203	07.07.2021	52.500	(193)	(89)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,375	07.07.2021	2.200	(6)	(2)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,422	07.07.2021	22.600	(97)	(20)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,547	07.07.2021	2.700	(6)	(2)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,641	07.07.2021	12.400	(40)	(5)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,645	07.07.2021	20.900	(69)	(8)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,172	05.08.2021	11.600	(72)	(18)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,406	05.08.2021	31.400	(135)	(58)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,688	05.08.2021	10.100	(32)	(23)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,938	05.08.2021	2.900	(9)	(8)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,406	05.08.2021	31.400	(71)	(83)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,801	05.08.2021	4.800	(21)	(5)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,078	05.08.2021	4.600	(20)	(5)	0,00
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,102	05.08.2021	2.100	(9)	(3)	0,00	

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	\$ 102,344	05.08.2021	5.700	\$ (19)	\$ (9)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,586	05.08.2021	5.000	(18)	(10)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,609	05.08.2021	2.400	(8)	(5)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,258	05.08.2021	5.300	(16)	(11)	0,00
					\$ (1.921)	\$ (687)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 14.500	\$ (304)	\$ 618	\$ 314	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	14.200	(395)	622	227	0,00
BRC	Huarong Finance Co. Ltd.	1,000	20.12.2024	23.000	(471)	(6.025)	(6.496)	(0,03)
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.500	(294)	586	292	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	19.100	54	396	450	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	49.700	(1.207)	2.000	793	0,01
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2025	7.800	170	37	207	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	31.400	(1.186)	786	(400)	0,00
CBK	AXA Equitable Holdings, Inc.	1,000	20.06.2023	8.700	(237)	329	92	0,00
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 3.000	286	44	330	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	\$ 11.100	(270)	447	177	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	4.100	(27)	41	14	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	5.700	(5)	148	143	0,00
FBF	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.000	7	64	71	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	13.000	(201)	480	279	0,00
GLM	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	44.900	(502)	1.647	1.145	0,01
GST	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 43.500	5.274	(488)	4.786	0,03
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	\$ 5.700	(7)	150	143	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.500	24	10	34	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	10.700	(430)	294	(136)	0,00
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 10.000	1.189	(89)	1.100	0,01
JPM	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	29.400	6.791	(417)	6.374	0,03
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2024	\$ 16.300	223	149	372	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2024	8.100	112	85	197	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	7.600	(1)	191	190	0,00
	Southern Co.	1,000	20.12.2022	23.000	285	12	297	0,00
MYC	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20.06.2025	7.900	0	4	4	0,00
	Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	1,000	20.12.2024	16.500	322	49	371	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	13.900	(191)	298	107	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	33.900	(197)	311	114	0,00
	Pioneer Natural Resources Co.	1,000	20.06.2025	8.400	(408)	587	179	0,00
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 2.700	311	(14)	297	0,00
					\$ 8.715	\$ 3.352	\$ 12.067	0,06

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2021	\$ 7.100	\$ 1.079	\$ (901)	\$ 178	0,00
BPS	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	5.800	676	(42)	634	0,00
BRC	iTraxx Japan 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	¥ 3.899.226	917	49	966	0,01
CBK	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	\$ 29.550	2.782	(2.042)	740	0,01
	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	8.000	828	47	875	0,01
	iTraxx Japan 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	¥ 5.632.214	1.326	70	1.396	0,01
GST	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	\$ 13.500	1.141	(803)	338	0,00
	CDX.HY-29 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2022	6.000	833	(403)	430	0,00
	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	24.000	2.849	(224)	2.625	0,01
JPM	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	3.550	304	(215)	89	0,00
	CDX.HY-29 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2022	4.900	779	(427)	352	0,00
	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	44.300	5.450	(605)	4.845	0,02
MYC	iTraxx Japan 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	¥ 16.463.403	3.996	83	4.079	0,02
	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	\$ 6.600	784	(62)	722	0,00
					\$ 23.744	\$ (5.475)	\$ 18.269	0,09

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einerreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einerreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	07.2021	\$	21.746	AUD	28.879	\$	(65)	0,00		
	07.2021		8.959	€	7.357		(234)	0,00		
	08.2021	AUD	28.879	\$	21.749		64	0,00		
	09.2021	\$	52.125	INR	3.837.698		0	(0,01)		
	09.2021		12.382	PLN	47.002		0	(33)	0,00	
	09.2021		655	RUB	47.822		0	(8)	0,00	
	02.2022	ZAR	61.806	\$	3.954		24	(268)	(244)	0,00
BPS	07.2021	AUD	115.337		89.633		3.043	0	3.043	0,01
	07.2021	NZD	21.823		15.268		20	0	20	0,00
	07.2021	\$	6.654	CAD	8.043		0	(159)	(159)	0,00
	07.2021		88.302	€	73.954		0	(600)	(600)	0,00
	07.2021		2.834	£	2.036		0	(21)	(21)	0,00
	07.2021		119.999	¥	13.124.123		0	(1.754)	(1.754)	(0,01)
	07.2021		607	MXN	12.042		0	(3)	(3)	0,00
	07.2021		1.094	TRY	9.449		2	(19)	(17)	0,00
	08.2021		15.268	NZD	21.823		0	(20)	(20)	0,00
	09.2021		143	THB	4.486		0	(4)	(4)	0,00
	10.2021		213	\$	56		1	0	1	0,00
	11.2021	\$	36.989	MXN	747.360		0	(74)	(74)	0,00
BRC	07.2021		1.680	£	1.192		0	(33)	(33)	0,00
	07.2021		591	MXN	11.859		4	0	4	0,00
	07.2021		110	TRY	929		0	(3)	(3)	0,00
	09.2021		8.115	PLN	30.877		0	(3)	(3)	0,00
CBK	07.2021	BRL	68.093	\$	13.863		292	0	292	0,00
	07.2021	CHF	8.081		8.778		35	0	35	0,00
	07.2021	PEN	658.846		178.930		6.842	(103)	6.739	0,03
	07.2021	RUB	424.280		5.493		0	(299)	(299)	0,00
	07.2021	\$	9.013	CHF	8.081		0	(270)	(270)	0,00
	07.2021		1.008	¥	111.000		0	(8)	(8)	0,00
	08.2021	HUF	150.335	\$	500		0	(8)	(8)	0,00
	08.2021	PEN	91.514		24.026		175	(107)	68	0,00
	08.2021	\$	13.819	BRL	68.093		0	(294)	(294)	0,00
	08.2021		8.785	CHF	8.081		0	(35)	(35)	0,00
	08.2021		31.718	COP	117.594.549		0	(287)	(287)	0,00
	08.2021		35.147	MXN	735.000		1.617	0	1.617	0,01
	09.2021	PEN	109.763	\$	29.276		541	0	541	0,00
	09.2021	ZAR	422.384		30.730		1.428	0	1.428	0,01
	10.2021	PEN	87.102		22.646		0	(148)	(148)	0,00
	11.2021	\$	2.468	MXN	50.140		5	0	5	0,00
GLM	12.2021	PEN	30.818	\$	8.271		213	0	213	0,00
	07.2021	BRL	138.374		27.565		0	(12)	(12)	0,00
	07.2021	MXN	149.362		7.552		62	0	62	0,00
	07.2021	RUB	850.481		11.020		0	(591)	(591)	0,00
	07.2021	\$	3.753	€	3.096		0	(81)	(81)	0,00
	07.2021		3.355	MXN	66.547		0	(18)	(18)	0,00
	07.2021		158	TRY	1.327		0	(5)	(5)	0,00
	08.2021	HUF	614.793	\$	2.064		0	(12)	(12)	0,00
	08.2021	\$	27.477	BRL	138.374		9	0	9	0,00
	08.2021		2.994	COP	11.151.852		0	(13)	(13)	0,00
	08.2021		2.177	RUB	159.000		0	(15)	(15)	0,00
	09.2021	HKD	12.729	\$	1.641		1	0	1	0,00
	09.2021	TWD	3.372		123		1	0	1	0,00
	09.2021	\$	13.009	PLN	49.426		0	(23)	(23)	0,00
	09.2021		832	RUB	60.971		0	(6)	(6)	0,00
HUS	09.2021	ZAR	203.853	\$	14.809		667	0	667	0,00
	07.2021	€	52.087		62.063		293	0	293	0,00
	07.2021	MXN	123.981		6.034		0	(184)	(184)	0,00
	07.2021	PEN	1.300		356		16	0	16	0,00
	07.2021	\$	27.562	€	22.882		0	(426)	(426)	0,00
	07.2021		5.411	£	3.860		0	(79)	(79)	0,00
	07.2021		399	MXN	7.986		2	0	2	0,00
	08.2021	£	1.566	\$	2.168		4	0	4	0,00
	09.2021	CNH	31.606		4.918		50	0	50	0,00
	09.2021	KRW	382.630		343		5	0	5	0,00
	09.2021	PEN	10.138		2.744		89	0	89	0,00
	09.2021	\$	14.714	PLN	56.354		92	0	92	0,00
	09.2021		344	RUB	25.179		0	(3)	(3)	0,00
	10.2021	PEN	1.926	\$	512		8	0	8	0,00
	02.2022	ZAR	26.452		1.829		32	0	32	0,00
JPM	07.2021	CAD	256.157		211.599		4.737	0	4.737	0,02
	07.2021	\$	2.803	€	2.291		0	(86)	(86)	0,00
	07.2021		114	ILS	369		0	0	0	0,00
	07.2021		15.926	NZD	21.823		0	(677)	(677)	0,00
	07.2021		1.010	TRY	8.914		1	0	1	0,00
	09.2021		23.790	IDR	342.880.050		0	(416)	(416)	0,00
	10.2021		2.731	MXN	55.376		17	0	17	0,00
MYI	07.2021	BRL	243.306	\$	48.875		387	0	387	0,00
	07.2021	CHF	502		545		2	0	2	0,00
	07.2021	€	1.020		1.215		5	0	5	0,00
	07.2021	£	1.732		2.409		17	0	17	0,00
	07.2021	ILS	11		3		0	0	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2021	RUB 417.534	\$ 5.450	\$ 0	\$ (250)	\$ (250)	0,00
	07.2021	SGD 4	\$ 3	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 16.170	AUD 21.377	0	(121)	(121)	0,00
	07.2021	84.181	BRL 449.773	5.454	0	5.454	0,02
	07.2021	1.092	€ 916	0	(6)	(6)	0,00
	07.2021	27.641	£ 19.956	0	(71)	(71)	0,00
	07.2021	191	SEK 1.626	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	235	SGD 315	0	0	0	0,00
	08.2021	AUD 21.377	\$ 16.172	121	0	121	0,00
	08.2021	\$ 48.724	BRL 243.306	0	(394)	(394)	0,00
	09.2021	1.054	ZAR 15.104	0	(6)	(6)	0,00
	11.2021	633	MXN 12.831	0	0	0	0,00
RBC	07.2021	€ 3.018.351	\$ 3.692.508	113.045	0	113.045	0,53
	09.2021	PEN 15.010	4.044	114	0	114	0,00
SCX	07.2021	\$ 1.098	AUD 1.423	0	(30)	(30)	0,00
	07.2021	3.983	€ 3.274	0	(100)	(100)	0,00
	08.2021	412	HUF 124.476	8	0	8	0,00
	12.2021	SGD 1.067	\$ 806	13	0	13	0,00
SOG	07.2021	RUB 484.630	€ 6.239	0	(377)	(377)	0,00
SSB	07.2021	\$ 1.579	£ 1.114	0	(40)	(40)	0,00
	08.2021	£ 751.211	\$ 1.038.200	348	0	348	0,00
	02.2022	ZAR 50.086	3.212	0	(192)	(192)	0,00
TOR	07.2021	CAD 7.423	6.144	150	0	150	0,00
UAG	07.2021	AUD 39.964	30.978	975	0	975	0,00
	07.2021	£ 774.387	1.097.204	27.427	0	27.427	0,13
	07.2021	RUB 1.372.912	17.905	0	(839)	(839)	0,00
	07.2021	\$ 78.603	AUD 103.623	0	(808)	(808)	0,00
	07.2021	€ 2.759	€ 2.268	0	(69)	(69)	0,00
	07.2021	50.260	RUB 3.708.761	640	(267)	373	0,00
	08.2021	AUD 103.623	\$ 78.614	806	0	806	0,00
	09.2021	\$ 339	RUB 24.876	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 169.904	\$ (12.039)	\$ 157.865	0,74

ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Investor AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	AUD 29.024	\$ 21.855	\$ 65	\$ 0	\$ 65	0,00
	07.2021	\$ 23.409	AUD 30.297	0	(663)	(663)	0,00
	08.2021	21.848	29.011	0	(65)	(65)	0,00
BPS	07.2021	AUD 472	\$ 354	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 16.723	AUD 21.521	0	(566)	(566)	0,00
BRC	07.2021	AUD 2	\$ 1	0	0	0	0,00
CBK	07.2021	\$ 4.422	AUD 5.744	0	(110)	(110)	0,00
GLM	07.2021	AUD 21	\$ 16	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	190	146	4	0	4	0,00
	07.2021	\$ 402	AUD 519	0	(12)	(12)	0,00
MYI	07.2021	AUD 13.132	\$ 9.930	72	0	72	0,00
	07.2021	\$ 507	AUD 668	0	(5)	(5)	0,00
	08.2021	9.371	12.388	0	(70)	(70)	0,00
SCX	07.2021	AUD 414	\$ 320	10	0	10	0,00
	07.2021	\$ 53	AUD 69	0	(1)	(1)	0,00
SSB	07.2021	16	21	0	0	0	0,00
UAG	07.2021	AUD 19.611	\$ 14.876	153	0	153	0,00
	07.2021	\$ 22.252	AUD 28.707	0	(700)	(700)	(0,01)
	08.2021	14.878	19.611	0	(153)	(153)	0,00
				\$ 304	\$ (2.345)	\$ (2.041)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die ausschüttende Investor CAD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	CAD 697	\$ 563	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2021	\$ 321	CAD 388	0	(8)	(8)	0,00
	08.2021	563	697	0	0	0	0,00
BPS	07.2021	516	623	0	(13)	(13)	0,00
CBK	07.2021	CAD 721	\$ 586	4	0	4	0,00
	08.2021	\$ 586	CAD 721	0	(4)	(4)	0,00
HUS	07.2021	510	616	0	(12)	(12)	0,00
MYI	07.2021	CAD 11	\$ 8	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	\$ 179	CAD 217	0	(4)	(4)	0,00
SSB	07.2021	241	298	0	0	0	0,00
				\$ 4	\$ (41)	\$ (37)	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) ausschüttend, Administrative CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	CHF 65	\$ 73	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07.2021	\$ 49.788	CHF 44.656	0	(1.476)	(1.476)	(0,01)
BPS	07.2021	169	155	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2021	CHF 385.986	\$ 419.265	1.691	0	1.691	0,01
	07.2021	\$ 321.856	CHF 288.584	0	(9.654)	(9.654)	(0,04)
	08.2021	419.620	385.986	0	(1.689)	(1.689)	(0,01)
GLM	07.2021	CHF 1.013	\$ 1.103	7	0	7	0,00
	07.2021	\$ 206.982	CHF 186.330	0	(5.403)	(5.403)	(0,03)
MYI	07.2021	CHF 16	\$ 17	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 289.727	CHF 261.036	0	(7.328)	(7.328)	(0,03)
SCX	07.2021	CHF 2.042	\$ 2.228	20	0	20	0,00
SSB	07.2021	3.270	3.585	47	0	47	0,00
	07.2021	\$ 429.270	CHF 387.299	0	(10.274)	(10.274)	(0,05)
UAG	07.2021	CHF 212	\$ 236	6	0	6	0,00
	07.2021	\$ 662	CHF 599	0	(14)	(14)	0,00
				\$ 1.773	\$ (35.839)	\$ (34.066)	(0,16)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklasse Institutional CZK (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 35.308	CZK 736.545	\$ 0	\$ (1.064)	\$ (1.064)	(0,01)
CBK	07.2021	CZK 730.772	\$ 34.158	182	0	182	0,00
	08.2021	\$ 34.153	CZK 730.772	0	(183)	(183)	0,00
HUS	07.2021	CZK 37.694	\$ 1.805	53	0	53	0,00
MYI	07.2021	\$ 432	CZK 8.983	0	(14)	(14)	0,00
SOG	07.2021	34.325	718.099	0	(939)	(939)	0,00
UAG	07.2021	35.189	735.675	0	(985)	(985)	0,00
				\$ 235	\$ (3.185)	\$ (2.950)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, Class E EUR (Currency Exposure) ausschüttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 256	€ 211	\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00
BPS	07.2021	€ 363	\$ 432	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 174	€ 146	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	1.595	¥ 174.390	0	(23)	(23)	0,00
	07.2021	120	NZD 165	0	(4)	(4)	0,00
BRC	07.2021	736	CHF 661	0	(21)	(21)	0,00
	07.2021	110	€ 91	0	(3)	(3)	0,00
CBK	07.2021	1.755	AUD 2.269	0	(51)	(51)	0,00
GLM	07.2021	11.205	£ 7.926	0	(256)	(256)	0,00
HUS	07.2021	€ 1.219	\$ 1.459	13	0	13	0,00
	07.2021	£ 8.050	11.142	21	0	21	0,00
	07.2021	\$ 253	€ 210	0	(5)	(5)	0,00
	07.2021	308	£ 217	0	(8)	(8)	0,00
	07.2021	81	SEK 669	0	(3)	(3)	0,00
	08.2021	11.142	£ 8.050	0	(21)	(21)	0,00
MYI	07.2021	€ 93	\$ 129	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 72	€ 60	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	58.894	48.141	0	(1.804)	(1.804)	(0,01)
TOR	07.2021	5.973	CAD 7.216	0	(145)	(145)	0,00
UAG	07.2021	82	€ 67	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 36	\$ (2.353)	\$ (2.317)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€ 18.035	\$ 21.807	\$ 419	\$ 0	\$ 419	0,00
BPS	07.2021	16.886	20.183	158	0	158	0,00
	07.2021	\$ 1.649.802	€ 1.348.881	0	(50.164)	(50.164)	(0,23)
BRC	07.2021	7.033	5.774	0	(186)	(186)	0,00
GLM	07.2021	15.214	12.552	0	(329)	(329)	0,00
HUS	07.2021	€ 82.460	\$ 99.807	2.018	0	2.018	0,01
	07.2021	\$ 3.229	€ 2.648	0	(89)	(89)	0,00
MYI	07.2021	1.002	842	0	(4)	(4)	0,00
SCX	07.2021	1.922.052	1.571.133	0	(58.845)	(58.845)	(0,28)
TOR	07.2021	1.918.478	1.568.195	0	(58.755)	(58.755)	(0,27)
UAG	07.2021	2.624	2.157	0	(66)	(66)	0,00
				\$ 2.595	\$ (168.438)	\$ (165.843)	(0,77)

Zum 30. Juni 2021 standen für die ausschüttende Investor RMB (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BFS	07.2021	\$	CNH	122	776	\$ 0	0,00
	08.2021			117	758	\$ (1)	0,00
GLM	08.2021			121	785	0	0,00
HUS	07.2021			114	725	(1)	0,00
MYI	07.2021			128	813	(2)	0,00
SCX	07.2021			2	12	0	0,00
UAG	07.2021	CNH	\$	783	121	0	0,00
	08.2021	\$	CNH	121	783	0	0,00
						\$ 0	0,00
						\$ (4)	0,00
						\$ (4)	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SEK	qs	2.026	239	2	0,00
BFS	07.2021			1.910	228	5	0,00
	07.2021	\$	SEK	167.775	1.390.939	(5.133)	(0,02)
BRC	07.2021			18.481	153.209	(566)	0,00
GLM	07.2021	SEK	\$	7.216	872	28	0,00
	07.2021	\$	SEK	466	3.944	(4)	0,00
HUS	07.2021	SEK	\$	1.016	120	1	0,00
RBC	07.2021	\$	SEK	178.720	1.481.594	(5.478)	(0,03)
SCX	07.2021	SEK	\$	2.856	344	10	0,00
	07.2021	\$	SEK	162.787	1.349.511	(4.989)	(0,02)
SSB	07.2021	SEK	\$	858	103	3	0,00
	07.2021	\$	SEK	101.936	841.603	(3.527)	(0,02)
	08.2021	SEK	\$	781	92	0	0,00
UAG	07.2021			277.094	32.506	106	0,00
	08.2021	\$	SEK	32.351	275.731	(101)	0,00
						\$ 155	0,00
						\$ (19.798)	0,00
						\$ (19.643)	(0,09)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD	\$	26.237	19.541	23	0,00
	08.2021	\$	SGD	19.540	26.237	(23)	0,00
BFS	07.2021			24.989	33.058	(396)	(0,01)
GLM	07.2021	SGD	\$	15.321	11.406	8	0,00
	08.2021			315	234	0	0,00
HUS	07.2021	\$	SGD	24.875	32.911	(391)	0,00
MYI	07.2021	SGD	\$	26.171	19.470	1	0,00
	08.2021	\$	SGD	19.469	26.171	(1)	0,00
SCX	07.2021			24.666	32.692	(345)	0,00
SSB	07.2021	SGD	\$	6.326	4.746	40	0,00
	07.2021	\$	SGD	864	1.144	(12)	0,00
UAG	07.2021	SGD	\$	162	122	1	0,00
						\$ 73	0,00
						\$ (1.168)	0,00
						\$ (1.095)	(0,01)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (156.806)	(0,73)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 17.300	\$ (17.435)	(0,08)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (17.435)	(0,08)
Summe Anlagen		\$ 21.445.806	100,41
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (87.145)	(0,41)
Nettovermögen		\$ 21.358.661	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only – („IO“) bzw. IO-Strip.
 (b) Wertpapier per Emissionstermin.
 (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
 (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
 (e) Nullkuponwertpapier.
 (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
 (g) Mit dem Fonds verbunden.
 (h) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (i) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
AT&T, Inc. 2,850 % fällig am 25.05.2024	23.06.2020	\$ 2.213	\$ 2.442	0,01
AT&T, Inc. 4,850 % fällig am 25.05.2047	17.05.2017 - 09.04.2019	2.675	3.238	0,02
AWAS Aviation Capital Ltd. 4,870 % fällig am 03.10.2021	02.10.2014	23.145	23.370	0,11
Citigroup, Inc. 2,561 % fällig am 01.05.2032	27.04.2021	10.300	10.492	0,05
Citigroup, Inc. 2,572 % fällig am 03.06.2031	26.05.2020 - 09.07.2020	43.811	44.660	0,21
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	14.06.2021	1.111	1.121	0,01
Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032	11.01.2021 - 21.01.2021	33.390	33.962	0,16
Export-Import Bank of India 1,166 % fällig am 28.03.2022	19.12.2019	19.147	19.275	0,09
Morgan Stanley 7,500 % fällig am 02.04.2032	11.02.2020	42.919	40.580	0,19
Oracle Corp. 4,100 % fällig am 25.03.2061	24.03.2021 - 26.03.2021	8.190	8.778	0,04
Stearns Holdings LLC 'B'	15.03.2021	2.648	2.173	0,01
Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 30.12.2021	11.01.2021	22.998	23.016	0,11
		\$ 212.547	\$ 213.107	1,01

- (j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 30.996 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 10 und Barmittel in Höhe von USD 1.805 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 292.415 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 261.310 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 20.272.707	\$ 48.878	\$ 20.321.585
Investmentfonds	1.012.390	262.710	0	1.275.100
Finanzderivate ⁽³⁾	14.297	(147.741)	0	(133.444)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(17.435)	0	(17.435)
Summen	\$ 1.026.687	\$ 20.370.241	\$ 48.878	\$ 21.445.806

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 27.388.138	\$ 50.954	\$ 27.439.093
Investmentfonds	2.455.952	263.068	0	2.719.020
Pensionsgeschäfte	0	30.802	0	30.802
Finanzderivate ⁽³⁾	461	310.161	(31)	310.591
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(13.586)	0	(13.586)
Summen	\$ 2.456.414	\$ 27.978.583	\$ 50.923	\$ 30.485.920

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BPS	(2,500) %	23.04.2020	TBD ⁽¹⁾	€ (1.837)	\$ (2.114)	(0,01)
	(0,450)	18.06.2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (10.377)	(10.375)	(0,05)
BRC	(2,500)	30.04.2020	TBD ⁽¹⁾	€ (1.196)	(1.376)	(0,01)
	(2,500)	15.09.2020	TBD ⁽¹⁾	(2.436)	(2.831)	(0,01)
CFR	(0,900)	01.04.2020	TBD ⁽¹⁾	(4.865)	(5.704)	(0,02)
	(0,900)	13.08.2020	TBD ⁽¹⁾	(3.060)	(3.599)	(0,02)
	(0,900)	22.09.2020	TBD ⁽¹⁾	(1.030)	(1.213)	(0,01)
	(0,900)	31.03.2021	22.10.2022	(613)	(726)	0,00
MEI	(2,000)	29.04.2021	TBD ⁽¹⁾	\$ (502)	(500)	0,00
TDM	0,000	12.01.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.168)	(1.168)	(0,01)
Total Reverse Repurchase Agreements					\$ (29.606)	(0,14)

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (3.704)	\$ 3.350	\$ (354)
BPS	(55.301)	47.680	(7.621)
BRC	(5.002)	5.120	118
CBK	1.508	(8.740)	(7.232)
DUB	(526)	(930)	(1.456)
FAR	(106)	110	4
FBF	318	(250)	68
GLM	(40.594)	35.720	(4.874)
GSC	(65)	0	(65)
GST	8.117	(8.140)	(23)
HUS	1.740	(1.130)	610
JLN	1.100	0	1.100
JPM	20.440	(21.580)	(1.140)
MYC	536	(2.545)	(2.009)
MYI	(2.860)	260	(2.600)
RBC	107.681	(95.000)	12.681
RYL	287	(300)	(13)
SAL	(368)	530	162
SCX	(66.311)	58.270	(8.041)
SOG	(1.316)	990	(326)
SSB	(51.312)	46.000	(5.312)
TOR	(58.750)	51.660	(7.090)
UAG	(12.318)	11.000	(1.318)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	72,32	65,07
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	21,81	31,23
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,01	1,08
Investmentfonds	5,97	9,65
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,14	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	0,13
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,73)	0,97
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,08)	(0,05)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,14)	(0,25)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,24)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Argentinien	0,01	0,01
Australien	1,39	1,04
Österreich	0,36	0,35
Belgien	0,21	0,19
Bermudas	0,73	0,55
Brasilien	1,12	0,96
Kanada	2,02	1,65
Cayman Inseln	5,70	4,65
Chile	0,05	0,06
China	1,45	1,59

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kolumbien	0,04	0,05
Curacao	k. A.	0,07
Dänemark	0,25	0,23
Finnland	0,14	0,15
Frankreich	2,07	2,46
Deutschland	2,52	2,08
Guernsey, Kanalinseln	0,42	0,37
Hongkong	0,78	0,88
Indien	0,48	0,52
Indonesien	0,32	0,28
Irland	0,88	0,98
Insel Man	0,16	0,13
Israel	k. A.	0,07
Italien	1,95	2,00
Japan	2,07	2,54
Jersey, Kanalinseln	0,67	0,51
Kuwait	0,12	0,16
Luxemburg	3,64	3,37
Mauritius	0,28	0,25
Mexiko	0,86	0,95
Multinational	0,28	0,10
Niederlande	3,04	2,92
Norwegen	0,25	0,18
Panama	0,24	0,19
Peru	1,19	1,08
Portugal	k. A.	0,02
Katar	0,15	0,17
Rumänien	0,16	0,15
Russland	0,38	0,89
Saudi-Arabien	0,41	0,24
Singapur	0,44	0,39
Slowakei	0,00	0,00
Slowenien	k. A.	0,03
Südafrika	0,40	0,22
Südkorea	0,11	0,09
Spanien	0,92	1,06
Sri Lanka	k. A.	0,00
Supranational	0,14	0,10
Schweden	0,35	0,36
Schweiz	2,31	2,14
Türkei	0,02	0,02
Ukraine	0,05	0,04
Vereinigte Arabische Emirate	0,27	0,21
Großbritannien	7,37	7,21
USA	45,41	50,20
Uruguay	0,00	0,00
Jungferinseln (Britisch)	0,35	0,19
Kurzfristige Instrumente	0,21	0,08
Investmentfonds	5,97	9,65
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,14	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,04	0,05
Zinsswaps	(0,09)	0,11
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,09	0,03
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,10)	(0,04)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,06	0,05
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,09	0,07
Devisenterminkontrakte	0,74	(0,37)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,60)	1,24
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,08)	(0,05)
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,41)	(8,19)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
AUSTRALIEN											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
Boral Finance Pty. Ltd. 3,750 % fällig am 01.05.2028	\$ 200	\$ 216	0,04	Natura Cosmetics S.A. 4,125 % fällig am 03.05.2028	2.000	2.052	0,34	6,850 % fällig am 27.01.2045	\$ 100	\$ 113	0,02
Commonwealth Bank of Australia 3,743 % fällig am 12.09.2039 (f)	200	221	0,04	Suzano Austria GmbH 3,125 % fällig am 15.01.2032 (b)	1.300	1.289	0,22	Summe Dominikanische Republik		2.231	0,37
Lendlease Finance Ltd. 3,400 % fällig am 27.10.2027	AUD 1.370	1.090	0,18	XP, Inc. 3,250 % fällig am 01.07.2026 (b)	2.200	2.178	0,36				
3,700 % fällig am 31.03.2031	800	638	0,10	Summe Brasilien		9.018	1,50				
Macquarie University 2,250 % fällig am 22.05.2030	750	565	0,09	KANADA							
Optus Finance Pty. Ltd. 1,000 % fällig am 20.06.2029	€ 300	369	0,06	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,375 % fällig am 30.04.2025	\$ 150	160	0,03	Bank of Montreal 1,758 % fällig am 10.03.2026	CAD 2.900	2.357	0,39	Balder Finland Oyj 1,000 % fällig am 20.01.2029	€ 400	468	0,08
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 2,450 % fällig am 16.03.2031	1.300	1.310	0,22	Brookfield Finance, Inc. 2,724 % fällig am 15.04.2031	\$ 1.850	1.906	0,32	Kemira Oyj 1,000 % fällig am 30.03.2028	1.000	1.187	0,20
		4.569	0,76	National Bank of Canada 0,550 % fällig am 15.11.2024	250	249	0,04	Neste Oyj 0,750 % fällig am 25.03.2028	900	1.063	0,18
				0,550 % fällig am 15.11.2024		4.512	0,75	Nokia Oyj 2,375 % fällig am 15.05.2025	300	379	0,06
				STAATSEMISSIONEN				SATO Oyj 1,375 % fällig am 24.02.2028	1.200	1.478	0,24
				Canada Housing Trust 2,650 % fällig am 15.12.2028	CAD 1.000	870	0,14	SBB Treasury Oyj 1,125 % fällig am 26.11.2029	2.100	2.482	0,41
				Ontario Teachers' Finance Trust 0,050 % fällig am 25.11.2030	€ 600	697	0,12	Tornator Oyj 1,250 % fällig am 14.10.2026	200	247	0,04
				Province of Quebec 1,850 % fällig am 13.02.2027	CAD 500	415	0,07	Summe Finnland		7.304	1,21
						1.982	0,33				
				Summe Kanada		6.494	1,08	FRANKREICH			
				CAYMAN INSELN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				Alibaba Group Holding Ltd. 2,700 % fällig am 09.02.2041	\$ 1.000	957	0,16	AXA S.A. 1,375 % fällig am 07.10.2041	2.400	2.847	0,47
				CIFI Holdings Group Co. Ltd. 4,450 % fällig am 17.08.2026	800	798	0,13	Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,250 % fällig am 29.06.2028	€ 900	1.066	0,18
				MAF Sukuk Ltd. 3,933 % fällig am 28.02.2030	400	434	0,07	1,750 % fällig am 19.12.2024	£ 100	143	0,02
				Tencent Holdings Ltd. 3,240 % fällig am 03.06.2050	500	491	0,08	BNP Paribas S.A. 1,000 % fällig am 17.04.2024	€ 1.000	1.223	0,20
				3,595 % fällig am 19.01.2028	700	767	0,13	1,125 % fällig am 28.08.2024	600	738	0,12
				3,840 % fällig am 22.04.2051	400	432	0,07	1,675 % fällig am 30.06.2027	\$ 3.000	3.001	0,50
				3,975 % fällig am 11.04.2029	500	558	0,10	2,219 % fällig am 09.06.2026	1.200	1.238	0,20
				Summe Cayman Inseln		4.437	0,74	2,871 % fällig am 19.04.2032	300	308	0,05
				CHILE				3,375 % fällig am 23.01.2026	€ 200	302	0,05
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Ceetrus S.A. 2,750 % fällig am 26.11.2026	€ 200	259	0,04
				Corp. Nacional del Cobre de Chile 3,625 % fällig am 01.08.2027	200	219	0,04	Credit Agricole S.A. 0,125 % fällig am 09.12.2027	700	816	0,13
				STAATSEMISSIONEN				0,375 % fällig am 21.10.2025	400	480	0,08
				Chile Government International Bond 1,250 % fällig am 29.01.2040	€ 200	233	0,04	0,750 % fällig am 05.12.2023	200	243	0,04
				1,250 % fällig am 22.01.2051	1.200	1.276	0,21	1,185 % fällig am 22.03.2024	\$ 2.000	2.024	0,34
				3,500 % fällig am 25.01.2050	\$ 300	315	0,05	Danone S.A. 2,947 % fällig am 02.11.2026	200	215	0,04
				3,500 % fällig am 15.04.2053	1.600	1.685	0,28	Electricite de France S.A. 2,625 % fällig am 01.12.2027	€ 1.400	1.672	0,28
				Summe Chile		3.509	0,58	3,625 % fällig am 13.10.2025	\$ 600	660	0,11
				CHINA				Faurecia SE 2,375 % fällig am 15.06.2029	€ 1.150	1.392	0,23
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Ile-de-France Mobilites 0,400 % fällig am 28.05.2031	1.700	2.036	0,34
				China Construction Bank Corp. 0,000 % fällig am 22.04.2024	€ 2.000	2.372	0,39	Societe Generale S.A. 0,500 % fällig am 12.06.2029	400	465	0,08
				(c)				0,875 % fällig am 22.09.2028	200	241	0,04
				Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 2,250 % fällig am 16.09.2022	\$ 800	815	0,14	3,625 % fällig am 01.03.2041	\$ 600	610	0,10
				Summe China		3.187	0,53	4,000 % fällig am 12.01.2027	500	554	0,09
				KROATIEN				4,750 % fällig am 26.05.2026 (e)(f)	500	519	0,09
				STAATSEMISSIONEN				6,750 % fällig am 06.04.2028 (e)(f)	300	340	0,06
				Croatia Government International Bond 1,500 % fällig am 17.06.2031	€ 300	371	0,06	7,875 % fällig am 18.12.2023 (e)(f)	200	224	0,04
				DOMINIKANISCHE REPUBLIK				Verallia S.A. 1,625 % fällig am 14.05.2028	€ 2.400	2.880	0,48
				STAATSEMISSIONEN				Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % fällig am 26.03.2028	1.100	1.303	0,22
				Dominican Republic Government International Bond 4,875 % fällig am 23.09.2032	\$ 600	620	0,10	Summe Frankreich		27.799	4,62
				5,875 % fällig am 30.01.2060	1.500	1.498	0,25				

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS			
FRANKREICH								ITALIEN						
Societe Du Grand Paris EPIC	€	500	\$ 580	0,10	Bharti Airtel Ltd.	\$	200	\$ 218	0,04	STAATSEMISSIONEN				
0,000 % fällig am 25.11.2030 (c)		900	975	0,16	4,375 % fällig am 10.06.2025					Cassa Depositi e Prestiti SpA	€	200	\$ 242	0,04
1,000 % fällig am 18.02.2070					ReNew Power Pvt Ltd.		2,000	2.038	0,34	1,500 % fällig am 11.02.2030				
UNEDIC ASSEO		300	351	0,06	4,500 % fällig am 14.07.2028		650	695	0,12	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		630	726	0,12
0,000 % fällig am 19.11.2030 (c)		500	580	0,10	5,875 % fällig am 05.03.2027					1,650 % fällig am 01.12.2030		1.300	1.669	0,27
0,250 % fällig am 16.07.2035					Shriram Transport Finance Co. Ltd.		1,000	1.005	0,17	1,800 % fällig am 01.03.2041		3.100	3.840	0,64
			9.537	1,58	4,400 % fällig am 13.03.2024		200	204	0,03					
Summe Frankreich			37.336	6,20	5,100 % fällig am 16.07.2023		200	205	0,03	Summe Italien			19.221	3,19
					5,950 % fällig am 24.10.2022		200	4.569	0,76	JAPAN				
DEUTSCHLAND								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								INDONESIEN						
Deutsche Bahn Finance GmbH		750	801	0,13	STAATSEMISSIONEN				Export-Import Bank of India		200	201	0,03	
0,625 % fällig am 08.12.2050					Summe Indien			4.770	0,79	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Deutsche Bank AG		500	623	0,11	INDONESIEN				Bank Mandiri Persero Tbk PT		1,300	1.303	0,22	
1,375 % fällig am 10.06.2026		\$	100	103	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,000 % fällig am 19.04.2026		1,200	1.285	0,21
2,222 % fällig am 18.09.2024		300	320	0,05	STAATSEMISSIONEN				Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT		1,200	1.285	0,21	
3,547 % fällig am 18.09.2031		800	815	0,14	INDONESIEN				4,625 % fällig am 20.07.2023					
3,729 % fällig am 14.01.2032 (g)		500	541	0,09	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL									
3,961 % fällig am 26.11.2025					STAATSEMISSIONEN									
Eurogrid GmbH	€	300	375	0,06	INDONESIEN				Indonesia Government International Bond	€	300	37	0,06	
1,113 % fällig am 15.05.2032					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,150 % fällig am 18.07.2024		500	52	0,09	
Infineon Technologies AG		1.000	1.319	0,22	STAATSEMISSIONEN				Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia	\$	500	89	0,15	
2,000 % fällig am 24.06.2032					INDONESIEN				2,300 % fällig am 23.06.2025			3,48	0,58	
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau		800	962	0,16	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Indonesien					
0,000 % fällig am 15.09.2028 (c)		\$	1.100	1,033	0,17	IRLAND				AIB Group PLC	€	900	1.143	0,19
0,750 % fällig am 30.09.2030					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,875 % fällig am 30.05.2031					
Schaeffler AG	€	2.300	3.013	0,50	IRLAND				Bank of Ireland Group PLC		400	472	0,08	
3,375 % fällig am 12.10.2028					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,375 % fällig am 10.05.2027					
Sixt SE		400	490	0,08	IRLAND				CCEP Finance Ireland DAC		1,900	2.252	0,37	
1,750 % fällig am 09.12.2024					IRLAND				0,500 % fällig am 06.09.2029		1,600	1.896	0,31	
ZF Finance GmbH		100	119	0,02	IRLAND				0,875 % fällig am 06.05.2033					
2,000 % fällig am 06.05.2027			10.514	1,75	IRLAND				Cyrusone Europe Finance DAC		1,900	2.242	0,37	
					IRLAND				1,125 % fällig am 26.05.2028					
STAATSEMISSIONEN								IRLAND						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Bundesrepublik Deutschland		10.200	12.495	2,07	IRLAND				Smurfit Kappa Acquisitions ULC		300	394	0,07	
0,000 % fällig am 15.08.2030 (c)					IRLAND				Summe Irland			8.399	1,39	
Land Nordrhein-Westfalen		700	787	0,13	IRLAND									
0,000 % fällig am 12.10.2035 (c)		200	238	0,04	IRLAND									
0,500 % fällig am 25.11.2039					IRLAND									
			13.520	2,24	IRLAND									
Summe Deutschland			24.034	3,99	IRLAND									
GUERNSEY, KANALINSELN								IRLAND						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								IRLAND						
Globalworth Real Estate Investments Ltd.		700	900	0,15	IRLAND									
2,950 % fällig am 29.07.2026		300	383	0,06	IRLAND									
3,000 % fällig am 29.03.2025					IRLAND									
Summe Guernsey, Kanalinseln			1.283	0,21	IRLAND									
HONGKONG								IRLAND						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								IRLAND						
AIA Group Ltd.	\$	800	829	0,14	IRLAND									
3,200 % fällig am 16.09.2040					IRLAND									
Lenovo Group Ltd.		800	838	0,14	IRLAND									
3,421 % fällig am 02.11.2030					IRLAND									
MTR Corp. Ltd.		900	874	0,15	IRLAND									
1,625 % fällig am 19.08.2030					IRLAND									
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.		200	208	0,03	IRLAND									
3,150 % fällig am 12.05.2025					IRLAND									
Yanlord Land HK Co. Ltd.		1.000	1.022	0,17	IRLAND									
5,125 % fällig am 20.05.2026					IRLAND									
			3.771	0,63	IRLAND									
STAATSEMISSIONEN								IRLAND						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								IRLAND						
Hong Kong Government International Bond		300	293	0,05	IRLAND									
2,375 % fällig am 02.02.2051					IRLAND									
Summe Hongkong			4.064	0,68	IRLAND									
INDIEN								IRLAND						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								IRLAND						
Axis Bank Ltd.		200	204	0,03	IRLAND									
3,000 % fällig am 08.08.2022					IRLAND									

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAATSEMISSIONEN											
Adif Alta Velocidad	€ 200	\$ 2	0,04	Assura Financing PLC	£ 2.400	\$ 3,2	0,55	3,373 % fällig am 05.01.2024	\$ 1.200	\$ 1,2	0,21
0,550 % fällig am 30.04.2030				1,625 % fällig am 30.06.2033				3,823 % fällig am 03.11.2028	400	4	0,07
Autonomous Community of Madrid				Atlantica Sustainable Infrastructure PLC	\$ 1.400	1,4	0,24	4,750 % fällig am 15.09.2025	600	6	0,11
0,419 % fällig am 30.04.2030	100	1	0,02	Barclays PLC				Santander UK PLC	150	1	0,03
0,827 % fällig am 30.07.2027	500	6	0,10	0,625 % fällig am 14.11.2023	€ 200	2	0,04	4,000 % fällig am 13.03.2024			
1,571 % fällig am 30.04.2029	100	1	0,02	1,536 % fällig am 16.05.2024	\$ 300	3	0,05	Severn Trent Utilities Finance PLC			
Xunta de Galicia				1,700 % fällig am 03.11.2026	£ 300	4	0,07	2,000 % fällig am 02.06.2040	£ 300	4	0,07
0,084 % fällig am 30.07.2027	150	1	0,03	3,250 % fällig am 12.02.2027	€ 300	4	0,08	SSE PLC			
		1,2	0,21	6,125 % fällig am 15.12.2025 (e)(f)	\$ 1.000	1,1	0,18	1,750 % fällig am 16.04.2030	€ 100	1	0,02
		19,9	3,31	7,250 % fällig am 15.03.2023 (e)(f)	£ 400	5	0,10	8,375 % fällig am 24.10.2028	€ 400	8	0,13
Summe Spanien				7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(f)	£ 300	3	0,05	Standard Chartered PLC			
				7,875 % fällig am 15.03.2022 (e)(f)	1,200	1,2	0,21	0,991 % fällig am 12.01.2025	\$ 700	6	0,12
				7,875 % fällig am 15.09.2022 (e)(f)	£ 200	2	0,05	1,214 % fällig am 23.03.2025	300	3	0,05
				British Telecommunications PLC				1,456 % fällig am 14.01.2027	1,868	1,8	0,31
				1,000 % fällig am 23.06.2024	€ 283	3	0,06	7,500 % fällig am 02.04.2022 (e)(f)	800	8	0,14
				Burberry Group PLC				Tesco Corporate Treasury Services PLC			
				1,125 % fällig am 21.09.2025	£ 500	6	0,11	0,375 % fällig am 27.07.2029	€ 700	8	0,13
				Chanel Ceres PLC				1,375 % fällig am 27.11.2023	€ 300	3	0,06
				1,000 % fällig am 31.07.2031	€ 2.500	2,9	0,50	2,750 % fällig am 27.04.2030	£ 500	7	0,12
				Clarion Funding PLC				Travis Perkins PLC			
				1,250 % fällig am 13.11.2032	£ 700	9	0,15	3,750 % fällig am 17.02.2026	500	7	0,12
				1,875 % fällig am 22.01.2035	200	2	0,05	Tritax Big Box REIT PLC			
				Direct Line Insurance Group PLC				1,500 % fällig am 27.11.2033	400	5	0,09
				4,000 % fällig am 05.06.2032	300	4	0,08	Vmed O2 UK Financing PLC	1.000	1,3	0,23
				Ferguson Finance PLC				4,500 % fällig am 15.07.2031 (b)			
				3,250 % fällig am 02.06.2030	\$ 300	3	0,05	Vodafone Group PLC			
				Grainger PLC				2,500 % fällig am 24.05.2039	€ 300	4	0,07
				3,000 % fällig am 03.07.2030	£ 1.260	1,8	0,31	5,125 % fällig am 04.06.2081	\$ 1.559	1,5	0,26
				3,375 % fällig am 24.04.2028	200	2	0,05	Weir Group PLC			
				HSBC Holdings PLC				2,200 % fällig am 13.05.2026	3.000	3,0	0,50
				1,500 % fällig am 04.12.2024	€ 100	1	0,02	Whitbread Group PLC			
				1,645 % fällig am 18.04.2026	\$ 200	2	0,03	2,375 % fällig am 31.05.2027	€ 400	5	0,09
				2,013 % fällig am 22.09.2028	900	9	0,15	3,000 % fällig am 31.05.2031	100	1	0,02
				2,357 % fällig am 18.08.2031	200	2	0,03	Workspace Group PLC			
				2,633 % fällig am 07.11.2025	1.200	1,2	0,21	2,250 % fällig am 11.03.2028	1.600	2,2	0,37
				2,804 % fällig am 24.05.2032	1.700	1,7	0,29				
				3,000 % fällig am 22.07.2028	£ 100	1	0,02				
				3,973 % fällig am 22.05.2030	\$ 1.600	1,7	0,30				
				4,600 % fällig am 17.12.2030 (e)(f)	500	5	0,09				
				Informa PLC				NON-AGENCY-MBS			
				1,500 % fällig am 05.07.2023	€ 400	4	0,08	Gemgarto PLC			
				3,125 % fällig am 05.07.2026	£ 200	2	0,05	0,639 % fällig am 16.12.2067	777	1,0	0,18
				InterContinental Hotels Group PLC				Summe Großbritannien			
				2,125 % fällig am 24.08.2026	100	1	0,02				
				3,375 % fällig am 08.10.2028	1.400	2,0	0,35				
				Legal & General Group PLC				USA			
				5,625 % fällig am 24.03.2031 (e)(f)	600	9	0,15	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
				Lloyds Banking Group PLC				GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust			
				2,438 % fällig am 05.02.2026	\$ 300	3	0,05	2,100 % fällig am 20.05.2048	\$ 3.550	3,5	0,59
				3,574 % fällig am 07.11.2028	200	2	0,04				
				3,870 % fällig am 09.07.2025	1.000	1,0	0,18				
				4,550 % fällig am 16.08.2028	300	3	0,06				
				London Stock Exchange Group PLC				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				1,625 % fällig am 06.04.2030	£ 700	9	0,16	AbbVie, Inc.			
				1,750 % fällig am 19.09.2029	€ 600	7	0,13	3,200 % fällig am 21.11.2029	1.400	1,5	0,25
				Marks & Spencer PLC				AES Corp.			
				3,750 % fällig am 19.05.2026	£ 1.000	1,4	0,24	1,375 % fällig am 15.01.2026	1.319	1,3	0,22
				4,250 % fällig am 08.12.2023	100	1	0,02	2,450 % fällig am 15.01.2031	1.700	1,6	0,28
				Motability Operations Group PLC				Alcon Finance Corp.			
				0,125 % fällig am 20.07.2028	€ 200	2	0,04	3,000 % fällig am 23.09.2029	1.900	2,0	0,33
				1,500 % fällig am 20.01.2041	£ 400	5	0,09	Alexandria Real Estate Equities, Inc.			
				National Grid Electricity Transmission PLC				2,000 % fällig am 18.05.2032	1.650	1,6	0,27
				0,190 % fällig am 20.01.2025	€ 300	3	0,06	3,000 % fällig am 18.05.2051	1.700	1,6	0,28
				Natwest Group PLC				Alllegion U.S. Holding Co., Inc.			
				0,750 % fällig am 15.11.2025	350	4	0,07	3,550 % fällig am 01.10.2027	230	2	0,04
				0,780 % fällig am 26.02.2030	500	5	0,10	Allstate Corp.			
				2,359 % fällig am 22.05.2024	\$ 600	6	0,10	1,450 % fällig am 15.12.2030	400	3	0,06
				4,269 % fällig am 22.03.2025	1.500	1,6	0,27	Ally Financial, Inc.			
				4,600 % fällig am 28.06.2031 (e)(f)	800	8	0,13	3,875 % fällig am 21.05.2024	100	1	0,02
				5,125 % fällig am 12.05.2027 (e)(f)	£ 400	5	0,10	8,000 % fällig am 01.11.2031	1.100	1,5	0,26
				8,625 % fällig am 15.08.2021 (e)(f)	\$ 800	8	0,13	Alphabet, Inc.			
				Pearson Funding PLC				1,100 % fällig am 15.08.2030	800	7	0,13
				3,750 % fällig am 04.06.2030	£ 500	7	0,13	2,050 % fällig am 15.08.2050	200	1	0,03
				Reckitt Benckiser Treasury Services PLC				Amazon.com, Inc.			
				1,750 % fällig am 19.05.2032	200	2	0,05	3,100 % fällig am 12.05.2051	350	3	0,06
				Santander UK Group Holdings PLC				American Tower Corp.			
				2,896 % fällig am 15.03.2032	\$ 850	8	0,15	0,500 % fällig am 15.01.2028	€ 400	4	0,08
								1,000 % fällig am 15.01.2032	100	1	0,02
								1,950 % fällig am 22.05.2026	200	2	0,04
								2,100 % fällig am 15.06.2030	\$ 1.000	9	0,16

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Amgen, Inc. 2,300 % fällig am 25.02.2031	\$ 1.100	\$ 1.114	0,18	CVS Health Corp. 1,750 % fällig am 21.08.2030	\$ 200	\$ 193	0,03	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 4,875 % fällig am 15.01.2030	\$ 400	\$ 428	0,07
Apple, Inc. 2,200 % fällig am 11.09.2029	1.961	2.041	0,34	4,300 % fällig am 25.03.2028	494	568	0,09	Host Hotels & Resorts LP 3,375 % fällig am 15.12.2029	1.900	1.995	0,33
2,450 % fällig am 04.08.2026	1.400	1.491	0,25	4,780 % fällig am 25.03.2038	150	185	0,03	3,500 % fällig am 15.09.2030	500	525	0,09
2,950 % fällig am 11.09.2049	50	52	0,01	Dell International LLC 5,300 % fällig am 01.10.2029	500	604	0,10	Hudson Pacific Properties LP 3,950 % fällig am 01.11.2027	1.870	2.052	0,34
AT&T, Inc. 3,650 % fällig am 15.09.2059	9	9	0,00	6,200 % fällig am 15.07.2030	800	1.030	0,17	Humana, Inc. 3,950 % fällig am 15.03.2027	95	107	0,02
3,800 % fällig am 01.12.2057	61	64	0,01	Digital Stout Holding LLC 3,300 % fällig am 19.07.2029	£ 100	153	0,03	Illumina, Inc. 2,550 % fällig am 23.03.2031	2.850	2.896	0,48
3,850 % fällig am 01.06.2060	536	566	0,09	3,750 % fällig am 17.10.2030	100	158	0,03	Intercontinental Exchange, Inc. 2,650 % fällig am 15.09.2040	500	481	0,08
4,300 % fällig am 15.02.2030	500	578	0,10	Doris Duke Charitable Foundation 2,345 % fällig am 01.07.2050	\$ 400	367	0,06	International Flavors & Fragrances, Inc. 1,230 % fällig am 01.10.2025	1.100	1.095	0,18
5,100 % fällig am 25.11.2048	CAD 300	279	0,05	DTE Electric Co. 3,250 % fällig am 01.04.2051	1.100	1.195	0,20	3,200 % fällig am 01.05.2023	100	104	0,02
Autodesk, Inc. 3,500 % fällig am 15.06.2027	\$ 30	33	0,01	3,950 % fällig am 01.03.2049	200	243	0,04	3,468 % fällig am 01.12.2050	500	521	0,09
Avangrid, Inc. 3,800 % fällig am 01.06.2029	1.500	1.695	0,28	Duke Energy Florida LLC 2,500 % fällig am 01.12.2029	300	315	0,05	Interstate Power & Light Co. 3,500 % fällig am 30.09.2049	300	325	0,05
Bank of America Corp. 0,455 % fällig am 24.08.2025	€ 600	724	0,12	Duke Realty LP 2,875 % fällig am 15.11.2029	100	105	0,02	3,600 % fällig am 01.04.2029	200	223	0,04
0,981 % fällig am 25.09.2025	\$ 800	800	0,13	E*TRADE Financial Corp. 3,800 % fällig am 24.08.2027	200	223	0,04	4,100 % fällig am 26.09.2028	200	230	0,04
1,486 % fällig am 19.05.2024	600	611	0,10	4,500 % fällig am 20.06.2028	1.000	1.159	0,19	Jackson National Life Global Funding 3,250 % fällig am 30.01.2024	200	213	0,04
2,087 % fällig am 14.06.2029	2.400	2.422	0,40	Electronic Arts, Inc. 1,850 % fällig am 15.02.2031	2.000	1.935	0,32	3,875 % fällig am 11.06.2025	300	330	0,05
2,456 % fällig am 22.10.2025	1.700	1.779	0,30	Equinix, Inc. 1,000 % fällig am 15.03.2033	€ 400	470	0,08	John D. & Catherine T. MacArthur Foundation 1,299 % fällig am 01.12.2030	400	383	0,06
2,687 % fällig am 22.04.2032	4.800	4.941	0,82	1,550 % fällig am 15.03.2028	\$ 900	885	0,15	JPMorgan Chase & Co. 0,563 % fällig am 16.02.2025	1.000	995	0,16
Bank of New York Mellon Corp. 3,000 % fällig am 30.10.2028	400	438	0,07	2,500 % fällig am 15.05.2031	1.590	1.618	0,27	0,653 % fällig am 16.09.2024	700	701	0,12
Becton Dickinson and Co. 3,794 % fällig am 20.05.2050	75	84	0,01	Equitable Holdings, Inc. 4,350 % fällig am 20.04.2028	900	1.033	0,17	1,001 % fällig am 25.07.2031	€ 300	366	0,06
BlueHub Loan Fund, Inc. 3,099 % fällig am 01.01.2030	650	667	0,11	ERP Operating LP 4,150 % fällig am 01.12.2028	100	115	0,02	1,040 % fällig am 04.02.2027	\$ 1.800	1.771	0,29
BMW U.S. Capital LLC 0,625 % fällig am 20.04.2022	€ 155	185	0,03	Essential Utilities, Inc. 2,400 % fällig am 01.05.2031	500	505	0,08	2,580 % fällig am 22.04.2032	6.500	6.676	1,11
Boise Cascade Co. 4,875 % fällig am 01.07.2030	\$ 600	639	0,11	Eversource Energy 1,650 % fällig am 15.08.2030	800	767	0,13	Kaiser Foundation Hospitals 2,810 % fällig am 01.06.2041	3.350	3.424	0,57
Boston Properties LP 2,550 % fällig am 01.04.2032	2.430	2.448	0,41	3,450 % fällig am 15.01.2050	400	422	0,07	Kellogg Co. 0,500 % fällig am 20.05.2029	€ 1.900	2.254	0,37
3,400 % fällig am 21.06.2029	200	217	0,04	Farmers Exchange Capital 5,454 % fällig am 15.10.2054	400	502	0,08	2,100 % fällig am 01.06.2030	\$ 600	604	0,10
Brandywine Operating Partnership LP 4,550 % fällig am 01.10.2029	100	112	0,02	First American Financial Corp. 4,000 % fällig am 15.05.2030	700	780	0,13	Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032	1.400	1.384	0,23
Bush Foundation 2,754 % fällig am 01.10.2050	250	251	0,04	Fiserv, Inc. 2,650 % fällig am 01.06.2030	100	104	0,02	4,750 % fällig am 15.12.2028	500	581	0,10
California Endowment 2,498 % fällig am 01.04.2051	1.000	968	0,16	3,000 % fällig am 01.07.2031	£ 100	152	0,02	Kimco Realty Corp. 2,700 % fällig am 01.10.2030	800	823	0,14
Campbell Soup Co. 4,150 % fällig am 15.03.2028	150	171	0,03	4,400 % fällig am 01.07.2049	\$ 100	121	0,02	Komatsu Finance America, Inc. 0,849 % fällig am 09.09.2023	400	402	0,07
Celgene Corp. 3,550 % fällig am 15.08.2022	500	516	0,09	Ford Foundation 2,415 % fällig am 01.06.2050	200	193	0,03	Kraft Heinz Foods Co. 4,625 % fällig am 30.01.2029	150	175	0,03
Charles Schwab Corp. 4,000 % fällig am 01.12.2030 (e)	900	922	0,15	Ford Motor Credit Co. LLC 0,157 % fällig am 01.12.2024	€ 200	231	0,04	Leeward Renewable Energy Operations LLC 4,250 % fällig am 01.07.2029 (b)	1.700	1.725	0,29
Chubb INA Holdings, Inc. 0,875 % fällig am 15.06.2027	€ 200	246	0,04	1,514 % fällig am 17.02.2023	200	241	0,04	Liberty Utilities Finance GP 2,050 % fällig am 15.09.2030	300	290	0,05
Citigroup, Inc. 0,500 % fällig am 29.01.2022	1.200	1.430	0,24	4,000 % fällig am 13.11.2030	\$ 500	524	0,09	Low Income Investment Fund 3,711 % fällig am 01.07.2029	300	322	0,05
0,776 % fällig am 30.10.2024	\$ 500	501	0,08	Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc. 2,375 % fällig am 16.02.2031	600	586	0,10	MercadoLibre, Inc. 2,375 % fällig am 14.01.2026	700	705	0,12
2,375 % fällig am 22.05.2024	€ 100	127	0,02	Gap, Inc. 8,625 % fällig am 15.05.2025	1.600	1.757	0,29	Microsoft Corp. 2,675 % fällig am 01.06.2060	393	390	0,06
2,572 % fällig am 03.06.2031 (g)	\$ 2.000	2.058	0,34	8,875 % fällig am 15.05.2027	1.000	1.160	0,19	Mississippi Power Co. 3,100 % fällig am 30.07.2051	2.000	2.020	0,34
3,875 % fällig am 18.02.2026 (e)	1.050	1.075	0,18	GE Capital Funding LLC 4,400 % fällig am 15.05.2030	1.800	2.099	0,35	Moody's Corp. 2,550 % fällig am 18.08.2060	500	445	0,07
Citrix Systems, Inc. 1,250 % fällig am 01.03.2026	900	889	0,15	Georgia Power Co. 3,250 % fällig am 15.03.2051	1.900	1.922	0,32	Morgan Stanley 0,168 % fällig am 08.11.2022	€ 200	238	0,04
Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	1.420	1.415	0,23	0,082 % fällig am 26.09.2023	€ 200	238	0,04	0,731 % fällig am 05.04.2024	\$ 6.000	6.014	1,00
4,750 % fällig am 15.03.2028	400	420	0,07	0,855 % fällig am 12.02.2026	\$ 1.500	1.490	0,25	MUFG Americas Holdings Corp. 3,500 % fällig am 18.06.2022	40	41	0,01
5,000 % fällig am 15.09.2026	700	721	0,12	1,000 % fällig am 16.12.2025	£ 200	276	0,05	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	3.500	3.543	0,59
Community Preservation Corp. 2,867 % fällig am 01.02.2030	1.225	1.281	0,21	2,615 % fällig am 22.04.2032	\$ 6.000	6.134	1,02	2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD 920	696	0,12
Conagra Brands, Inc. 1,375 % fällig am 01.11.2027	600	586	0,10	3,250 % fällig am 01.02.2023	€ 115	144	0,02	5,650 % fällig am 01.05.2079	\$ 300	349	0,06
5,300 % fällig am 01.11.2038	300	382	0,06	3,691 % fällig am 05.06.2028	\$ 500	552	0,09	NextEra Energy Operating Partners LP 3,875 % fällig am 15.10.2026	500	530	0,09
Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 3,600 % fällig am 15.06.2061	500	518	0,09	Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % fällig am 15.03.2028	130	141	0,02	4,250 % fällig am 15.07.2024	600	634	0,11
Continental Wind LLC 6,000 % fällig am 28.02.2033	387	445	0,07	Hanwha Energy USA Holdings Corp. 2,375 % fällig am 30.07.2022	400	407	0,07	Niagara Mohawk Power Corp. 1,960 % fällig am 27.06.2030	400	394	0,07
Corporate Office Properties LP 2,250 % fällig am 15.03.2026	500	514	0,09	HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	3.350	3.379	0,56	Northern States Power Co. 2,900 % fällig am 01.03.2050	200	205	0,03
Crown Castle International Corp. 3,250 % fällig am 15.01.2051	600	598	0,10	3,750 % fällig am 15.09.2030	200	196	0,03				
4,300 % fällig am 15.02.2029	1.000	1.152	0,19	HCA, Inc. 4,500 % fällig am 15.02.2027	700	792	0,13				
5,200 % fällig am 15.02.2049	100	131	0,02	5,250 % fällig am 15.06.2049	300	383	0,06				
				5,500 % fällig am 15.06.2047	100	130	0,02				

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
NSTAR Electric Co. 3,100 % fällig am 01.06.2051	\$ 800	\$ 830	0,14	Southern California Edison Co. 2,950 % fällig am 01.02.2051	\$ 500	\$ 454	0,08	VMware, Inc. 4,650 % fällig am 15.05.2027	\$ 100	\$ 115	0,02
OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027	3.400	3.430	0,57	3,600 % fällig am 01.02.2045	100	100	0,02	4,700 % fällig am 15.05.2030	900	1.066	0,18
Oracle Corp. 2,950 % fällig am 01.04.2030	1.700	1.792	0,30	3,650 % fällig am 01.06.2051	3.000	3.016	0,50	WEA Finance LLC 3,750 % fällig am 17.09.2024	300	321	0,05
3,950 % fällig am 25.03.2051 (g)	300	328	0,05	3,900 % fällig am 01.12.2044	100	104	0,02	Weyerhaeuser Co. 4,000 % fällig am 15.11.2029	400	457	0,08
Owens Corning 3,950 % fällig am 15.08.2029	760	859	0,14	3,900 % fällig am 15.03.2043	100	105	0,02	6,875 % fällig am 15.12.2033	70	97	0,02
Pacific Life Global Funding 1,375 % fällig am 14.04.2026	605	607	0,10	5,625 % fällig am 01.02.2036	300	382	0,06	7,375 % fällig am 15.03.2032	340	491	0,08
PepsiCo, Inc. 2,625 % fällig am 29.07.2029	1.400	1.502	0,25	6,650 % fällig am 01.04.2029	300	375	0,06	Xylem, Inc. 2,250 % fällig am 30.01.2031	1.700	1.714	0,28
PNC Bank N.A. 2,700 % fällig am 22.10.2029	600	636	0,11	Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust 6,650 % fällig am 01.08.2022	42	43	0,01	Zoetis, Inc. 2,000 % fällig am 15.05.2030	100	100	0,02
2,320 % fällig am 22.01.2028	1.300	1.436	0,24	Southwestern Public Service Co. 3,150 % fällig am 01.05.2050	870	912	0,15				
PNC Financial Services Group, Inc. 2,307 % fällig am 23.04.2032	1.000	1.023	0,17	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 600	710	0,12				
Potomac Electric Power Co. 7,900 % fällig am 15.12.2038	30	49	0,01	Starbucks Corp. 4,450 % fällig am 15.08.2049	\$ 500	621	0,10				
Public Service Co. of Colorado 2,700 % fällig am 15.01.2051	300	293	0,05	Starwood Property Trust, Inc. 3,625 % fällig am 15.07.2026 (b)	2.350	2.371	0,39				
3,200 % fällig am 22.01.2028	400	434	0,07	State Street Corp. 3,031 % fällig am 01.11.2034	200	213	0,04				
3,700 % fällig am 15.06.2028	2.100	2.372	0,39	T-Mobile USA, Inc. 2,550 % fällig am 15.02.2031	900	913	0,15				
Rayonier LP 2,750 % fällig am 17.05.2031	600	606	0,10	3,300 % fällig am 15.02.2051	900	900	0,15				
Regency Centers LP 3,700 % fällig am 15.06.2030	1.000	1.108	0,18	TerraForm Power Operating LLC 4,750 % fällig am 15.01.2030	50	51	0,01				
Reliance Standard Life Global Funding 3,850 % fällig am 19.09.2023	40	43	0,01	5,000 % fällig am 31.01.2028	750	796	0,13				
Reliance Steel & Aluminum Co. 2,150 % fällig am 15.08.2030	1.000	987	0,16	Topaz Solar Farms LLC 5,750 % fällig am 30.09.2039	1.478	1.717	0,28				
RELX Capital, Inc. 3,000 % fällig am 22.05.2030	600	642	0,11	Truist Financial Corp. 1,267 % fällig am 02.03.2027	1.900	1.899	0,31				
Renewable Energy Group, Inc. 5,875 % fällig am 01.06.2028	2.400	2.524	0,42	UDR, Inc. 3,100 % fällig am 01.11.2034	1.000	1.054	0,17				
Rockefeller Foundation 2,492 % fällig am 01.10.2050	500	489	0,08	Union Electric Co. 2,150 % fällig am 15.03.2032	620	622	0,10				
salesforce.com, Inc. 1,500 % fällig am 15.07.2028 (b)	1.750	1.748	0,29	USAA Capital Corp. 2,125 % fällig am 01.05.2030	1.000	1.012	0,17				
San Diego Gas & Electric Co. 3,950 % fällig am 15.11.2041	200	226	0,04	VeriSign, Inc. 2,700 % fällig am 15.06.2031	1.100	1.119	0,19				
4,300 % fällig am 01.04.2042	100	119	0,02	Verizon Communications, Inc. 1,500 % fällig am 18.09.2030	2.360	2.258	0,37				
Solar Star Funding LLC 5,375 % fällig am 30.06.2035	2.052	2.317	0,38	2,100 % fällig am 22.03.2028	400	409	0,07				
				2,550 % fällig am 21.03.2031	200	205	0,03				
				3,000 % fällig am 20.11.2060	600	562	0,09				
				3,875 % fällig am 08.02.2029	2.000	2.287	0,38				
				VICI Properties LP 3,500 % fällig am 15.02.2025	200	205	0,03				
				4,125 % fällig am 15.08.2030	200	206	0,03				
								Summe USA		271.199	45,03
								KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
								Elanco Animal Health, Inc. 1,842 % fällig am 02.08.2027	194	192	0,03
								KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL			
								San Francisco, California Public Utilities Commission Water Revenue Bonds, Series 2020 1,988 % fällig am 01.11.2031	850	863	0,14
								US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
								Freddie Mac 1,144 % fällig am 25.08.2029 (a)	2.400	170	0,03
								US-SCHATZobligationen			
								U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041 (h)(i)	24.500	23.991	3,98
								2,250 % fällig am 15.05.2041 (h)(i)	21.800	22.689	3,77
								U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,125 % fällig am 15.04.2026	9.061	9.861	1,64
								U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 30.04.2026 (h)	7.400	7.363	1,22
										63.904	10,61
										271.199	45,03
								JUNGFERNINSELN (BRITISCH)			
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								TSMC Global Ltd. 1,250 % fällig am 23.04.2026	1.600	1.587	0,26
								Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	639.632	106,20

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	10	\$ (12)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	10	14	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	167	(144)	(0,03)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	39	(185)	(0,03)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2021	108	(25)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	9	6	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	192	(436)	(0,07)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	2	(8)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	13	(22)	0,00
				\$ (812)	(0,14)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (812)	(0,14)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Koninklijke KPN N.V.	(1,000) %	20.12.2023	€ 200	\$ (8)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 3.200	\$ 8	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	€ 100	0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	300	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	\$ 300	11	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	800	27	0,01
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2026	€ 100	1	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	900	8	0,00
				\$ 58	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2051	£ 1.200	\$ (31)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 27.800	(25)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	600	1	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	1.100	1	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,270	03.03.2022	1.300	9	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,273	03.03.2022	200	1	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025	600	2	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	300	1	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,290	03.03.2025	200	1	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2022	400	1	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	500	9	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,935	22.06.2051	\$ 300	(9)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,943	15.06.2051	800	(25)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,945	23.06.2051	300	(9)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,968	23.06.2051	400	(14)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,600	15.12.2050	€ 3.100	287	0,05
Erhalt	CPURNSA	2,475	16.06.2031	\$ 2.600	9	0,00
					\$ 209	0,03
					\$ 259	0,04

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 100,156	05.08.2021	1.400	\$ 13	\$ 4	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	1.400	13	6	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	2.900	17	11	0,00
					\$ 43	\$ 21	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018 %	14.07.2021	900	\$ (5)	\$ (9)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	14.07.2021	900	(6)	(1)	0,00
CBK	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	06.07.2021	1.100	(8)	(23)	(0,01)
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	06.07.2021	1.100	(9)	0	0,00
GLM	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	21.07.2021	500	(4)	(2)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	21.07.2021	500	(4)	(2)	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	11.08.2021	900	(9)	(12)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	11.08.2021	900	(9)	(4)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	19.07.2021	1.100	(5)	(7)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	19.07.2021	1.100	(5)	0	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,019	02.07.2021	500	(3)	(12)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,022	02.07.2021	500	(3)	0	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	10.08.2021	800	(11)	(18)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	10.08.2021	800	(11)	(1)	0,00
							\$ (92)	\$ (91)	(0,01)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	\$ 102,234	12.08.2021	5.800	\$ (19)	\$ (10)	0,00
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	5.300	(18)	(9)	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	2.800	(18)	(4)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	2.800	(17)	(5)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,313	07.09.2021	2.500	(8)	(10)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	1.800	(6)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	5.800	(18)	(8)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	1.800	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	1.900	(3)	(3)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,695	07.09.2021	2.300	(7)	(4)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	2.100	(6)	(5)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,188	05.08.2021	1.200	(4)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,406	05.08.2021	5.800	(25)	(11)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,688	05.08.2021	3.200	(10)	(7)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,938	05.08.2021	1.200	(4)	(3)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,188	05.08.2021	1.200	(2)	(4)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,406	05.08.2021	5.800	(13)	(15)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,281	07.09.2021	2.400	(12)	(10)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,281	07.09.2021	4.200	(12)	(18)	(0,01)
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,297	07.09.2021	3.000	(10)	(12)	(0,01)
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,328	07.09.2021	2.900	(9)	(12)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,703	05.08.2021	1.200	(2)	(1)	0,00
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,344	05.08.2021	2.000	(7)	(3)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,586	05.08.2021	1.200	(4)	(2)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	101,844	07.09.2021	1.000	(3)	(3)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	103,844	07.09.2021	1.000	(1)	(2)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,258	05.08.2021	1.200	(4)	(3)	0,00	
					\$ (246)	\$ (169)	(0,03)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€ 5.427	\$ 6.554	\$ 118	\$ 0	\$ 118	0,02
	08.2021	CAD 6.966	\$ 5.774	148	0	148	0,03
	08.2021	£ 2.274	3.215	74	0	74	0,01
BPS	08.2021	\$ 1.377	NOK 11.525	0	(38)	(38)	(0,01)
	07.2021	€ 6.137	\$ 7.405	127	0	127	0,02
	08.2021	AUD 9.292	7.255	278	0	278	0,05
	08.2021	£ 2.095	2.901	7	0	7	0,00
	08.2021	SEK 5.285	640	22	0	22	0,00
BRC	08.2021	\$ 1.150	SEK 9.610	0	(26)	(26)	0,00
	07.2021	€ 1.242	\$ 1.513	40	0	40	0,01
CBK	08.2021	£ 187	263	5	0	5	0,00
	08.2021	215	304	7	0	7	0,00
GLM	08.2021	PEN 224	58	0	(1)	(1)	0,00
	10.2021	167	45	2	0	2	0,00
HUS	07.2021	€ 1.706	2.068	45	0	45	0,01
	07.2021	6.072	7.360	159	0	159	0,03
MYI	07.2021	\$ 2.361	€ 1.948	0	(51)	(51)	(0,01)
	08.2021	£ 17.453	\$ 24.673	559	0	559	0,09
	08.2021	\$ 1.647	¥ 178.980	0	(34)	(34)	(0,01)
MYI	07.2021	€ 818	\$ 974	4	0	4	0,00
	07.2021	£ 182	252	2	0	2	0,00
	07.2021	SEK 7.641	897	3	0	3	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
	07.2021	\$ 29	CHF 27	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2021	18	€ 15	0	0	0	0,00
	07.2021	295	£ 213	0	0	0	0,00
	08.2021	1.374	AUD 1.761	0	(51)	(51)	(0,01)
SCX	07.2021	€ 138.338	\$ 169.232	5.176	0	5.176	0,86
UAG	07.2021	3.386	4.119	103	0	103	0,02
	08.2021	\$ 1.371	NOK 11.335	0	(54)	(54)	(0,01)
				\$ 6.879	\$ (255)	\$ 6.624	1,10

ABGESICHERTE DEWISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2021	\$ 24.619	CHF 22.087	\$ 0	\$ (724)	\$ (724)	(0,12)
BRC	07.2021	161	145	0	(4)	(4)	0,00
CBK	07.2021	CHF 18.064	\$ 19.622	80	0	80	0,01
	07.2021	\$ 23.925	CHF 21.452	0	(718)	(718)	(0,12)
	08.2021	19.638	18.064	0	(79)	(79)	(0,01)
GLM	07.2021	CHF 137	\$ 152	4	0	4	0,00
	07.2021	\$ 3	CHF 3	0	0	0	0,00
MYI	07.2021	CHF 51	\$ 56	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 23.344	CHF 21.032	0	(590)	(590)	(0,10)
SCX	07.2021	CHF 20	\$ 22	1	0	1	0,00
SSB	07.2021	11.063	12.134	166	0	166	0,03
UAG	07.2021	\$ 67	CHF 61	0	(2)	(2)	0,00
	07.2021	11	10	0	0	0	0,00
				\$ 251	\$ (2.117)	\$ (1.866)	(0,31)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2021	€ 423	\$ 511	\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,00
BPS	07.2021	443	538	12	0	12	0,00
	07.2021	\$ 72.755	€ 59.501	0	(2.194)	(2.194)	(0,36)
BRC	07.2021	79.729	65.173	0	(2.441)	(2.441)	(0,40)
HUS	07.2021	29.410	24.208	0	(702)	(702)	(0,12)
MYI	07.2021	€ 7	\$ 8	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	\$ 83.711	€ 68.428	0	(2.563)	(2.563)	(0,43)
				\$ 21	\$ (7.900)	\$ (7.879)	(1,31)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) thesaurierend und Class E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BPS	07.2021	£ 8	\$ 11	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2021	\$ 254	£ 182	0	(3)	(3)	0,00
BRC	07.2021	£ 26	\$ 37	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 15.707	£ 11.247	0	(170)	(170)	(0,03)
GLM	07.2021	31.862	22.537	0	(727)	(727)	(0,12)
HUS	07.2021	£ 28.388	\$ 39.292	75	0	75	0,01
	07.2021	\$ 86	£ 61	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	39.295	28.388	0	(74)	(74)	(0,01)
MYI	07.2021	1.037	743	0	(11)	(11)	0,00
RYL	07.2021	404	287	0	(8)	(8)	0,00
SCX	07.2021	31.799	22.369	0	(897)	(897)	(0,15)
SSB	07.2021	£ 28.388	\$ 39.230	13	0	13	0,00
	07.2021	\$ 170	£ 121	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	39.234	28.388	0	(13)	(13)	0,00
UAG	07.2021	31.932	22.537	0	(798)	(798)	(0,13)
				\$ 89	\$ (2.705)	\$ (2.616)	(0,43)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 1.118	SEK 9.475	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	0,00
BPS	07.2021	30.527	253.570	0	(877)	(877)	(0,15)
BRC	07.2021	26.361	218.533	0	(808)	(808)	(0,13)
GLM	07.2021	4.828	40.086	0	(141)	(141)	(0,02)
HUS	07.2021	1.858	15.645	0	(29)	(29)	0,00
SCX	07.2021	25.852	215.041	10	(717)	(707)	(0,12)
SSB	07.2021	1.952	16.193	0	(59)	(59)	(0,01)
	08.2021	417	3.556	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07.2021	1.010	8.360	0	(32)	(32)	(0,01)
				\$ 10	\$ (2.674)	\$ (2.664)	(0,44)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (8.640)	(1,43)
Summe Anlagen						\$ 630.439	104,67
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (28.142)	(4,67)
Nettovermögen						\$ 602.297	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (g) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	2,572 %	03.06.2031	26.05.2020 - 08.09.2020	\$ 2.092	\$ 2.058	0,34
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	11.01.2021	800	815	0,14
Export-Import Bank of India	1,166	28.03.2022	19.12.2019	199	201	0,03
Oracle Corp.	3,950	25.03.2051	22.03.2021	299	328	0,05
				\$ 3.390	\$ 3.402	0,56

- (h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 28.187 als Sicherheiten verpfändet.
- (i) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 5.809 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 5.074 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 7.350 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 636.103	\$ 3.529	\$ 639.632
Finanzderivate ⁽³⁾	(348)	(8.845)	0	(9.193)
Summen	\$ (348)	\$ 627.258	\$ 3.529	\$ 630.439

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 366.476	\$ 0	\$ 366.476
Pensionsgeschäfte	0	111	0	111
Finanzderivate ⁽³⁾	(84)	1.732	0	1.648
Summen	\$ (84)	\$ 368.319	\$ 0	\$ 368.235

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	(0,050) %	14.06.2021	14.07.2021	\$ (7.409)	\$ (7.409)	(1,23)
	0,000	22.06.2021	06.07.2021	(9.281)	(9.281)	(1,54)
	0,070	18.06.2021	19.07.2021	(11.451)	(11.452)	(1,90)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (28.142)	(4,67)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte	% des Nettovermögens
BOS	0,000 %	25.06.2021	02.07.2021	\$ (3.116)	\$ (3.116)	(0,52)
BPG	0,010	24.06.2021	01.07.2021	(725)	(725)	(0,12)
	0,050	15.06.2021	15.07.2021	(1.935)	(1.935)	(0,32)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (5.776)	(0,96)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (423)	\$ 300	\$ (123)
BPS	(2.664)	2.140	(524)
BRC	(3.377)	2.970	(407)
CBK	(732)	500	(232)
GLM	(839)	560	(279)
HUS	(99)	0	(99)
JPM	(40)	0	(40)
MYC	(38)	0	(38)
MYI	(643)	350	(293)
RYL	(8)	0	(8)
SAL	(108)	0	(108)
SCX	1.010	(840)	170
SSB	102	0	102
UAG	(781)	530	(251)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	88,18	84,03
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	17,86	25,73
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,16	0,63
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,03
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,14)	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,04	(0,15)
Freiverkehrsfinauzderivate	(1,43)	0,67
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(4,67)	(0,38)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,96)	(5,62)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Australien	1,28	2,29
Österreich	0,48	0,22
Belgien	0,78	0,74
Bermudas	0,17	0,07
Brasilien	1,50	0,54
Kanada	1,08	1,24
Cayman-Inseln	0,74	0,30
Chile	0,62	0,74
China	0,53	0,71
Kroatien	0,06	0,12
Dänemark	k. A.	0,07
Dominikanische Republik	0,37	0,20
Ägypten	k. A.	0,26
Finnland	1,21	1,61
Frankreich	6,20	3,90
Deutschland	3,99	6,99
Guernsey, Kanalinseln	0,21	0,39
Hongkong	0,68	0,84
Indien	0,79	0,73
Indonesien	0,58	0,78

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Irland	1,39	0,49
Insel Man	0,13	0,24
Italien	3,19	2,34
Japan	2,36	2,22
Jersey, Kanalinseln	0,02	0,12
Luxemburg	1,98	2,28
Malaysia	k. A.	0,21
Mauritius	0,87	0,40
Mexiko	0,57	1,27
Multinational	0,68	0,31
Niederlande	6,83	4,97
Panama	0,11	0,20
Peru	0,02	0,04
Rumänien	0,33	0,59
Singapur	0,56	0,41
Südkorea	2,28	1,78
Spanien	3,31	3,01
Supranational	2,19	3,11
Schweden	1,31	0,65
Schweiz	0,86	1,15
Thailand	0,05	0,09
Großbritannien	10,60	8,87
USA	45,03	52,90
Jungferninseln (Britisch)	0,26	k. A.
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,03
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,14)	(0,03)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Zinsswaps	0,03	(0,16)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,01)
Optionen auf Wertpapiere	(0,03)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	1,10	(0,89)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,49)	1,57
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,67)	(10,91)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025	€ 2.900	\$ 3.708	0,12	Peugeot Invest 1,875 % fällig am 30.10.2026	€ 3.800	\$ 4.747	0,15	Wells Fargo Bank N.A. 3,550 % fällig am 14.08.2023	\$ 2.500	\$ 2.662	0,08
3,950 % fällig am 30.06.2022	€ 1.367	1.930	0,06	Piper Sandler Cos. 5,200 % fällig am 15.10.2023	\$ 1.600	1.604	0,05			515.705	16,03
KSA Sukuk Ltd. 2,894 % fällig am 20.04.2022	\$ 900	917	0,03	Places For People Treasury PLC 2,875 % fällig am 17.08.2026	€ 100	150	0,00	INDUSTRIEWERTE			
Lazard Group LLC 4,375 % fällig am 11.03.2029	6.300	7.165	0,22	Protective Life Global Funding 3,104 % fällig am 15.04.2024	\$ 5.000	5.307	0,16	AA Bond Co. Ltd. 2,875 % fällig am 31.07.2043	€ 400	555	0,02
4,500 % fällig am 19.09.2028	4.000	4.618	0,14	QNB Finance Ltd. 1,125 % fällig am 17.06.2024	6.600	6.603	0,21	AbbVie, Inc. 5,000 % fällig am 15.12.2021	\$ 400	404	0,01
LeasePlan Corp. NV 0,250 % fällig am 23.02.2026	€ 2.300	2.720	0,08	1,235 % fällig am 12.02.2022	10.000	10.044	0,31	Abertis Infraestructuras S.A. 1,125 % fällig am 26.03.2028	€ 300	364	0,01
2,875 % fällig am 24.10.2024	\$ 2.200	2.312	0,07	Sagax AB 1,125 % fällig am 30.01.2027	€ 1.700	2.061	0,06	1,625 % fällig am 15.02.2029	1.000	1.249	0,04
Legal & General Group PLC 5,625 % fällig am 24.03.2031 (f)(h)	€ 600	931	0,03	2,250 % fällig am 13.03.2025	2.900	3.658	0,11	Aeroporti di Roma SpA 1,750 % fällig am 30.07.2031	2.700	3.342	0,10
Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024	€ 3.000	3.607	0,11	Sagax Euro Mtn NL BV 0,750 % fällig am 26.01.2028	600	706	0,02	5,441 % fällig am 20.02.2023	€ 800	1.181	0,04
Lloyds Banking Group PLC 2,250 % fällig am 16.10.2024	€ 1.400	2.015	0,06	1,000 % fällig am 17.05.2029	2.400	2.838	0,09	Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029	\$ 2.018	2.238	0,07
3,750 % fällig am 11.01.2027	\$ 5.000	5.528	0,17	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,750 % fällig am 14.01.2025	1.300	1.616	0,05	Altice France Holding S.A. 4,000 % fällig am 15.02.2028 (j)	€ 1.100	1.256	0,04
4,375 % fällig am 22.03.2028	400	460	0,01	Santander Holdings USA, Inc. 3,244 % fällig am 05.10.2026	\$ 100	107	0,00	Altice France S.A. 2,125 % fällig am 15.02.2025	1.600	1.853	0,06
7,625 % fällig am 27.06.2023 (f)(h)	€ 260	394	0,01	Santander UK Group Holdings PLC 0,312 % fällig am 27.03.2024	€ 2.600	3.114	0,10	AMC Networks, Inc. 4,750 % fällig am 01.08.2025	\$ 100	103	0,00
Logicor Financing SARL 1,500 % fällig am 13.07.2026	€ 1.000	1.247	0,04	2,875 % fällig am 05.08.2021	\$ 2.700	2.706	0,08	American Airlines Pass-Through Trust 3,150 % fällig am 15.08.2033	662	684	0,02
3,250 % fällig am 13.11.2028	2.000	2.762	0,09	3,625 % fällig am 14.01.2026	€ 300	456	0,01	3,250 % fällig am 15.04.2030	20	19	0,00
Mid-America Apartments LP 3,600 % fällig am 01.06.2027	\$ 600	669	0,02	4,796 % fällig am 15.11.2024	5.000	5.469	0,17	3,375 % fällig am 01.11.2028	702	699	0,02
Mitsubishi HC Capital, Inc. 2,652 % fällig am 19.09.2022	2.500	2.560	0,08	7,375 % fällig am 24.06.2022 (f)(h)	€ 400	584	0,02	3,650 % fällig am 15.02.2029	805	832	0,03
3,406 % fällig am 28.02.2022	1.900	1.932	0,06	SBA Communications Corp. 3,875 % fällig am 15.02.2027	\$ 1.400	1.441	0,04	American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	1.900	2.014	0,06
3,960 % fällig am 19.09.2023	1.600	1.707	0,05	SBB Treasury Oyj 0,114 % fällig am 01.02.2023	€ 1.000	1.188	0,04	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 3,500 % fällig am 01.08.2030	600	668	0,02
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,339 % fällig am 19.07.2024	€ 1.600	1.924	0,06	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	1.100	1.301	0,04	ANR Pipeline Co. 9,625 % fällig am 01.11.2021	600	618	0,02
Mizuho Financial Group, Inc. 1,234 % fällig am 22.05.2027	\$ 6.500	6.407	0,20	SL Green Operating Partnership LP 1,136 % fällig am 16.08.2021	\$ 1.000	1.000	0,03	Anthem, Inc. 2,950 % fällig am 01.12.2022	200	207	0,01
1,324 % fällig am 13.09.2021	400	401	0,01	Societe Generale S.A. 7,375 % fällig am 13.09.2021 (f)(h)	200	202	0,01	APT Pipelines Ltd. 2,500 % fällig am 15.03.2036	€ 1.300	1.818	0,06
3,477 % fällig am 12.04.2026	6.100	6.673	0,21	7,375 % fällig am 04.10.2023 (f)(h)	1.500	1.640	0,05	Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 7.400	9.043	0,28
Morgan Stanley 1,576 % fällig am 24.10.2023	300	305	0,01	Standard Chartered PLC 1,214 % fällig am 23.03.2025	1.500	1.507	0,05	B.C. Unlimited Liability Co. 4,250 % fällig am 15.05.2024	\$ 362	366	0,01
MPT Operating Partnership LP 3,375 % fällig am 24.04.2030	€ 2.500	3.577	0,11	2,819 % fällig am 30.01.2026	11.100	11.658	0,36	Bacardi Ltd. 2,750 % fällig am 03.07.2023	€ 2.400	2.990	0,09
Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal 0,625 % fällig am 21.06.2027	€ 2.800	3.304	0,10	Stichting AK Rabobank Certificaten 2,188 % (f)	€ 683	1.092	0,03	Bayer U.S. Finance LLC 3,000 % fällig am 08.10.2021	\$ 300	302	0,01
Nationwide Building Society 1,000 % fällig am 24.01.2023	€ 2.900	4.042	0,13	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,130 % fällig am 08.07.2030	\$ 3.100	3.119	0,10	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	€ 6.200	8.592	0,27
3,766 % fällig am 08.03.2024	\$ 1.100	1.156	0,04	TP ICAP Ltd. 5,250 % fällig am 26.01.2024	€ 700	1.063	0,03	BMW U.S. Capital LLC 1,850 % fällig am 15.09.2021	\$ 1.300	1.303	0,04
4,302 % fällig am 08.03.2029	2.000	2.261	0,07	5,250 % fällig am 29.05.2026	1.400	2.213	0,07	3,400 % fällig am 13.08.2021	1.000	1.004	0,03
NatWest Group PLC 1,626 % fällig am 15.05.2023	200	202	0,01	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)	\$ 100	110	0,00	Boeing Co. 2,196 % fällig am 04.02.2026	8.600	8.684	0,27
Natwest Group PLC 1,751 % fällig am 25.06.2024	400	409	0,01	7,625 % fällig am 17.08.2022 (h)	5.000	5.380	0,17	2,750 % fällig am 01.02.2026	4.100	4.286	0,13
2,000 % fällig am 04.03.2025	€ 4.300	5.364	0,17	UBS Group AG 2,859 % fällig am 15.08.2023	2.800	2.874	0,09	Boston Scientific Corp. 2,650 % fällig am 01.06.2030	6.700	6.936	0,22
4,519 % fällig am 25.06.2024	\$ 200	215	0,01	Unicredit SpA 4,086 % fällig am 14.01.2022	2.200	2.240	0,07	3,450 % fällig am 01.03.2024	1.200	1.282	0,04
4,800 % fällig am 05.04.2026	700	802	0,02	5,459 % fällig am 30.06.2035	1.800	1.965	0,06	British Airways Pass-Through Trust 4,250 % fällig am 15.05.2034	178	192	0,01
4,892 % fällig am 18.05.2029	700	821	0,03	6,625 % fällig am 03.06.2023 (f)(h)	€ 700	895	0,03	Caesars Resort Collection LLC 5,750 % fällig am 01.07.2025	700	738	0,02
8,000 % fällig am 10.08.2025 (f)(h)	300	356	0,01	7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h)	1.800	2.537	0,08	Cargo Aircraft Management, Inc. 4,750 % fällig am 01.02.2028	600	614	0,02
8,625 % fällig am 15.08.2021 (f)(h)	3.100	3.130	0,10	7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 3.150	3.652	0,11	Central Japan Railway Co. 3,400 % fällig am 06.09.2023	400	423	0,01
NatWest Markets PLC 0,625 % fällig am 02.03.2022	€ 300	358	0,01	9,250 % fällig am 03.06.2022 (f)(h)	€ 1.400	1.781	0,06	Central Nippon Expressway Co. Ltd. 2,849 % fällig am 03.03.2022	600	609	0,02
1,000 % fällig am 28.05.2024	3.300	4.040	0,13	Unipol Gruppo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2030	2.400	3.210	0,10	Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 1.300	1.556	0,05
NE Property BV 1,875 % fällig am 09.10.2026	3.100	3.785	0,12	VEREIT Operating Partnership LP 3,950 % fällig am 15.08.2027	\$ 3.000	3.382	0,10	1,000 % fällig am 31.07.2031	2.100	2.504	0,08
Nexi SpA 1,750 % fällig am 31.10.2024	800	969	0,03	VICI Properties LP 3,500 % fällig am 15.02.2025	1.200	1.228	0,04	Charter Communications Operating LLC 3,900 % fällig am 01.06.2052	\$ 2.200	2.246	0,07
Nissan Motor Acceptance Corp. 0,817 % fällig am 21.09.2021	\$ 700	700	0,02	Virgin Money UK PLC 4,000 % fällig am 25.09.2026	€ 300	454	0,01	4,400 % fällig am 01.12.2061	8.200	8.828	0,27
1,900 % fällig am 14.09.2021	300	301	0,01	Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	3.100	4.319	0,13	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5,875 % fällig am 31.03.2025	20	23	0,00
2,600 % fällig am 28.09.2022	800	817	0,03	1,625 % fällig am 30.11.2022	1.200	1.680	0,05				
2,650 % fällig am 13.07.2022	1.200	1.220	0,04	1,625 % fällig am 10.02.2024	1.100	1.550	0,05				
Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 2.400	2.782	0,09	1,875 % fällig am 03.12.2024	2.000	2.850	0,09				
3,650 % fällig am 19.11.2029	1.400	1.619	0,05	Wells Fargo & Co. 1,416 % fällig am 31.10.2023	\$ 2.600	2.637	0,08				
OneMain Finance Corp. 5,625 % fällig am 15.03.2023	\$ 50	53	0,00								
6,125 % fällig am 15.03.2024	1.150	1.239	0,04								
Oxford Finance LLC 6,375 % fällig am 15.12.2022	400	404	0,01								
Park Aerospace Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 15.08.2022	151	158	0,00								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Cigna Corp. 1,074 % fällig am 15.07.2023	\$ 300	\$ 304	0,01	InterContinental Hotels Group PLC 1,625 % fällig am 08.10.2024	€ 2.300	\$ 2.844	0,09	Syngenta Finance NV 3,125 % fällig am 28.03.2022	\$ 200	\$ 203	0,01
Constellation Brands, Inc. 2,650 % fällig am 07.11.2022	1.000	1.028	0,03	2,125 % fällig am 24.08.2026	€ 200	282	0,01	3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 1.800	2.380	0,07
Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK) 10,000 % fällig am 09.11.2024 ^(b)	1.393	355	0,01	2,125 % fällig am 15.05.2027	€ 700	895	0,03	T-Mobile USA, Inc. 2,250 % fällig am 15.11.2031	\$ 2.500	2.476	0,08
Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 3.500	4.176	0,13	3,375 % fällig am 08.10.2028	€ 1.300	1.945	0,06	3,875 % fällig am 15.04.2030	2.100	2.355	0,07
5,000 % fällig am 15.04.2026	\$ 5.600	5.694	0,18	John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034	1.300	1.887	0,06	Teleperformance 1,500 % fällig am 03.04.2024	€ 1.000	1.230	0,04
D.R. Horton, Inc. 4,375 % fällig am 15.09.2022	300	311	0,01	6,125 % fällig am 21.01.2025	350	547	0,02	Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,375 % fällig am 27.07.2029	900	1.043	0,03
DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024	1.500	1.524	0,05	Kansas City Southern 3,125 % fällig am 01.06.2026	\$ 200	217	0,01	0,875 % fällig am 29.05.2026	2.000	2.441	0,08
3,375 % fällig am 20.03.2028	7.600	7.793	0,24	Komatsu Finance America, Inc. 2,437 % fällig am 11.09.2022	1.000	1.022	0,03	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 3,650 % fällig am 10.11.2021	\$ 100	100	0,00
5,000 % fällig am 01.08.2024	650	669	0,02	Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	€ 2.000	2.878	0,09	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 2,200 % fällig am 21.07.2021	208	208	0,01
Danone S.A. 2,077 % fällig am 02.11.2021	3.800	3.818	0,12	4,250 % fällig am 08.12.2023	100	147	0,00	Time Warner Cable LLC 4,000 % fällig am 01.09.2021	300	300	0,01
DeL International LLC 5,450 % fällig am 15.06.2023	2.300	2.496	0,08	Marriott International, Inc. 2,850 % fällig am 15.04.2031	\$ 1.000	1.016	0,03	Toyota Industries Corp. 3,110 % fällig am 12.03.2022	2.200	2.239	0,07
5,850 % fällig am 15.07.2025	700	822	0,03	3,500 % fällig am 15.10.2032	1.100	1.170	0,04	Toyota Tsusho Corp. 3,625 % fällig am 13.09.2023	1.000	1.065	0,03
Discovery Communications LLC 2,500 % fällig am 20.09.2024	€ 100	144	0,00	Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % fällig am 20.06.2027	1.000	1.102	0,03	Transocean, Inc. 7,250 % fällig am 01.11.2025	700	612	0,02
eBay, Inc. 2,750 % fällig am 30.01.2023	\$ 600	621	0,02	Mitchells & Butlers Finance PLC 0,634 % fällig am 15.12.2030	153	145	0,00	Travis Perkins PLC 3,750 % fällig am 17.02.2026	€ 400	588	0,02
ELO SACA 3,250 % fällig am 23.07.2027	€ 200	275	0,01	6,013 % fällig am 15.12.2030	€ 1.561	2.381	0,07	Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	€ 1.000	1.181	0,04
Enbridge, Inc. 0,655 % fällig am 18.02.2022	\$ 6.000	6.015	0,19	6,469 % fällig am 15.09.2032	400	632	0,02	National Express Group PLC 2,375 % fällig am 20.11.2028	1.000	1.428	0,04
Energean Israel Finance Ltd. 4,500 % fällig am 30.03.2024	1.200	1.229	0,04	Nidec Corp. 0,046 % fällig am 30.03.2026	€ 1.500	1.779	0,06	Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	600	741	0,02
Energy Transfer LP 5,300 % fällig am 01.04.2044	500	578	0,02	Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % fällig am 17.03.2026	400	517	0,02	2,652 % fällig am 17.03.2026	\$ 4.700	5.171	0,16
Energy Transfer Partners LP 5,000 % fällig am 01.10.2022	200	209	0,01	4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 4.700	5.171	0,16	4,810 % fällig am 17.09.2030	5.400	6.102	0,19
5,875 % fällig am 01.03.2022	60	61	0,00	Organon Finance LLC 4,125 % fällig am 30.04.2028	3.400	3.472	0,11	Penske Truck Leasing Co. LP 3,375 % fällig am 01.02.2022	1.400	1.417	0,04
EQT Corp. 7,625 % fällig am 01.02.2025	1.800	2.102	0,07	3,950 % fällig am 10.03.2025	800	876	0,03	Petroleros Mexicanos 5,950 % fällig am 28.01.2031	200	195	0,01
Equifax, Inc. 1,026 % fällig am 15.08.2021	700	701	0,02	Petrobras Capital Ltd. 3,500 % fällig am 21.04.2030	2.400	2.633	0,08	6,840 % fällig am 23.01.2030	1.700	1.754	0,05
ERAC USA Finance LLC 2,600 % fällig am 01.12.2021	100	101	0,00	RAC Bond Co. PLC 4,565 % fällig am 06.05.2046	€ 100	144	0,00	RCS & RDS S.A. 2,500 % fällig am 05.02.2025	€ 700	832	0,03
4,500 % fällig am 16.08.2021	200	201	0,01	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 0,751 % fällig am 24.06.2022	\$ 800	804	0,02	5,750 % fällig am 15.10.2027	€ 700	1.061	0,03
Exela Intermediate LLC 10,000 % fällig am 15.07.2023	300	198	0,01	Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 1.000	1.296	0,04	Ryder System, Inc. 2,500 % fällig am 01.09.2022	\$ 500	511	0,02
Expedia Group, Inc. 2,950 % fällig am 15.03.2031	2.000	2.031	0,06	5,750 % fällig am 15.10.2027	€ 700	1.061	0,03	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,000 % fällig am 15.03.2027	500	578	0,02
6,250 % fällig am 01.05.2025	527	613	0,02	Rylands-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 1.000	1.296	0,04	5,750 % fällig am 15.10.2027	€ 700	1.061	0,03
Gap, Inc. 8,625 % fällig am 15.05.2025	1.200	1.318	0,04	Scripps Escrow, Inc. 3,875 % fällig am 15.01.2029	\$ 1.000	994	0,03	Southern Co. 3,700 % fällig am 30.04.2030	\$ 800	883	0,03
8,875 % fällig am 15.05.2027	1.000	1.160	0,04	Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	€ 1.300	1.593	0,05	Southern Co. 3,700 % fällig am 30.04.2030	\$ 800	883	0,03
GATX Corp. 0,896 % fällig am 05.11.2021	3.000	3.006	0,09	Southern Co. 3,700 % fällig am 30.04.2030	\$ 800	883	0,03	Southwest Airlines Co. 5,250 % fällig am 04.05.2025	1.200	1.370	0,04
General Electric Co. 5,625 % fällig am 16.09.2031	€ 200	362	0,01	Sprint AeroSystems, Inc. 4,600 % fällig am 15.06.2028	1.100	1.081	0,03	Spirit AeroSystems, Inc. 4,600 % fällig am 15.06.2028	1.100	1.081	0,03
Greene King Finance PLC 1,880 % fällig am 15.12.2034	100	117	0,00	Sprint Spectrum Co. LLC 3,360 % fällig am 20.03.2023	44	44	0,00	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 2.200	2.602	0,08
5,318 % fällig am 15.09.2031	374	598	0,02	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 2.200	2.602	0,08				
Hasbro, Inc. 2,600 % fällig am 19.11.2022	\$ 2.800	2.882	0,09								
HCA, Inc. 4,125 % fällig am 15.06.2029	2.700	3.043	0,09								
Hewlett Packard Enterprise Co. 0,914 % fällig am 05.10.2021	700	700	0,02								
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2032	2.400	2.373	0,07								
3,750 % fällig am 01.05.2029	6.500	6.574	0,20								
Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % fällig am 18.03.2033	€ 2.100	2.515	0,08								
Imperial Brands Finance PLC 3,750 % fällig am 21.07.2022	\$ 2.800	2.873	0,09								
4,250 % fällig am 21.07.2025	200	220	0,01								
5,500 % fällig am 28.09.2026	€ 600	982	0,03								
INEOS Styrolution Group GmbH 2,250 % fällig am 16.01.2027	€ 4.500	5.281	0,16								
Informa PLC 1,250 % fällig am 22.04.2028	3.000	3.626	0,11								
1,500 % fällig am 05.07.2023	400	489	0,01								

VERSORGUNGSUNTERNEHMEN

AES Corp. 2,450 % fällig am 15.01.2031	4.600	4.559	0,14
AT&T, Inc. 2,875 % fällig am 02.03.2025 (f)	€ 1.600	1.936	0,06
3,650 % fällig am 15.09.2059	\$ 185	188	0,01
Baltimore Gas & Electric Co. 3,500 % fällig am 15.11.2021	200	201	0,01
BG Energy Capital PLC 4,000 % fällig am 15.10.2021	300	303	0,01
British Telecommunications PLC 4,500 % fällig am 04.12.2023	200	218	0,01
British Transco International Finance BV 0,000 % fällig am 04.11.2021 (c)	300	300	0,01
DTE Electric Co. 2,625 % fällig am 01.03.2031	1.200	1.266	0,04
Electricite de France S.A. 3,000 % fällig am 03.09.2027 (f)	€ 800	983	0,03
Enel Finance International NV 3,625 % fällig am 25.05.2027	\$ 200	220	0,01
London Power Networks PLC 2,625 % fällig am 01.03.2029	€ 1.500	2.240	0,07
Lumen Technologies, Inc. 4,000 % fällig am 15.02.2027	\$ 300	306	0,01
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 0,867 % fällig am 25.02.2022	400	402	0,01
1,950 % fällig am 01.09.2022	400	408	0,01
		269.774	8,38

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Libor Plus Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
2,750 % fällig am 01.11.2029	\$ 800	\$ 846	0,03	2,125 % fällig am 31.03.2024	\$ 610	\$ 639	0,02	Dutch Property Finance BV			
3,625 % fällig am 15.06.2023	1.300	1.368	0,04	2,125 % fällig am 30.09.2024	87.000	91.523	2,84	0,111 % fällig am 28.07.2054	€ 525	\$ 624	0,02
Pacific Gas & Electric Co.				2,125 % fällig am 30.11.2024	520	548	0,02	EMF-UK PLC			
1,367 % fällig am 10.03.2023	2.200	2.200	0,07	2,125 % fällig am 31.05.2026	23.200	24.610	0,77	1,060 % fällig am 13.03.2046	£ 57	78	0,00
3,150 % fällig am 01.01.2026	1.300	1.342	0,04	2,250 % fällig am 15.11.2024	3.340	3.532	0,11	Eurohome UK Mortgages PLC			
3,450 % fällig am 01.07.2025	200	210	0,01	2,375 % fällig am 31.01.2023	65.900	68.187	2,12	0,230 % fällig am 15.06.2044	153	208	0,01
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	600	630	0,02	2,375 % fällig am 15.08.2024	550	582	0,02	European Loan Conduit			
3,950 % fällig am 01.12.2047	200	186	0,01	2,500 % fällig am 31.01.2024	870	918	0,03	1,000 % fällig am 17.02.2030	€ 3.596	4.284	0,13
4,000 % fällig am 01.12.2046 ^	300	281	0,01	2,875 % fällig am 30.11.2023	750	796	0,02	Eurosail PLC			
4,550 % fällig am 01.07.2030	8.300	8.885	0,27					1,030 % fällig am 13.06.2045	£ 328	456	0,01
PECO Energy Co.								Finsbury Square PLC			
1,700 % fällig am 15.09.2021	900	902	0,03	NON-AGENCY-MBS				0,849 % fällig am 16.03.2070	1.841	2.554	0,08
Petrobras Global Finance BV				Adjustable Rate Mortgage Trust				1,048 % fällig am 16.06.2069	731	1.014	0,03
5,375 % fällig am 01.10.2029	£ 3.300	5.023	0,15	2,886 % fällig am 25.11.2035 ^	371	328	0,01	1,059 % fällig am 16.12.2069	3.185	4.429	0,14
6,250 % fällig am 14.12.2026	1.323	2.101	0,06	American Home Mortgage Investment Trust				1,079 % fällig am 16.09.2069	2.441	3.393	0,11
6,850 % fällig am 05.06.2115	\$ 300	343	0,01	0,672 % fällig am 25.11.2045	1.883	1.839	0,06	Friary No. 6 PLC			
Public Service Enterprise Group, Inc.				Atlas Funding PLC				0,769 % fällig am 21.11.2067	3.729	5.200	0,16
2,650 % fällig am 15.11.2022	800	824	0,02	0,949 % fällig am 25.07.2058	£ 1.000	1.390	0,04	Great Hall Mortgages PLC			
Rio Oil Finance Trust				BAMS CMBS DAC				0,221 % fällig am 18.06.2039	155	211	0,01
8,200 % fällig am 06.04.2028	480	556	0,02	1,086 % fällig am 17.05.2028	300	416	0,01	0,231 % fällig am 18.06.2038	96	131	0,00
9,250 % fällig am 06.07.2024	416	461	0,01	Banc of America Funding Trust				GSMPs Mortgage Loan Trust			
9,750 % fällig am 06.01.2027	146	173	0,01	0,419 % fällig am 20.02.2047	\$ 967	1.142	0,04	0,442 % fällig am 25.03.2035	\$ 120	112	0,00
Sempra Energy				0,479 % fällig am 20.07.2036	1.962	1.967	0,06	GSR Mortgage Loan Trust			
2,900 % fällig am 01.02.2023	700	725	0,02	6,412 % fällig am 25.10.2036 ^	11	11	0,00	6,000 % fällig am 25.01.2037	1.593	1.376	0,04
Sprint Corp.				BCAP LLC Trust				HarborView Mortgage Loan Trust			
7,250 % fällig am 15.09.2021	200	203	0,01	0,186 % fällig am 26.11.2036	436	439	0,01	0,288 % fällig am 19.01.2038	51	50	0,00
7,625 % fällig am 01.03.2026	800	978	0,03	0,272 % fällig am 25.03.2037	77	75	0,00	0,303 % fällig am 19.12.2036	4.724	4.442	0,14
Systems Energy Resources, Inc.				Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				2,127 % fällig am 19.10.2035	563	399	0,01
2,140 % fällig am 09.12.2025	700	708	0,02	2,370 % fällig am 25.02.2036	18	18	0,00	Hawksmoor Mortgages PLC			
Telstra Corp. Ltd.				2,636 % fällig am 25.01.2035	24	24	0,00	1,099 % fällig am 25.05.2053	£ 2.830	3.930	0,12
4,800 % fällig am 12.10.2021	100	101	0,00	Bear Stearns ALT-A Trust				IndyMac Mortgage Loan Trust			
Verizon Communications, Inc.				3,038 % fällig am 25.09.2035 ^	101	57	0,00	0,512 % fällig am 25.07.2036	\$ 2.539	2.435	0,08
1,500 % fällig am 18.09.2030	4.600	4.401	0,14	Brass PLC				JPMorgan Alternative Loan Trust			
		46.977	1,46	0,679 % fällig am 16.10.2059	£ 161	223	0,01	0,272 % fällig am 25.06.2037	5.176	3.662	0,11
		832.456	25,87	0,769 % fällig am 16.11.2066	2.148	2.995	0,09	Jubilee Place BV			
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel				0,856 % fällig am 16.11.2066	\$ 1.454	1.461	0,05	0,463 % fällig am 17.10.2057	€ 3.209	3.851	0,12
				Business Mortgage Finance PLC				Lanark Master Issuer PLC			
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				0,276 % fällig am 15.08.2040	£ 15	21	0,00	0,902 % fällig am 22.12.2069	£ 350	484	0,02
Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue				Canada Square Funding PLC				Landmark Mortgage Securities PLC			
Bonds, Series 2007				1,149 % fällig am 17.10.2051	5.109	7.096	0,22	0,364 % fällig am 17.04.2044	204	272	0,01
0,000 % fällig am 01.06.2047 (c)	4.700	527	0,02	Canterbury Finance PLC				Lehman XS Trust			
Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue				1,219 % fällig am 16.05.2056	4	6	0,00	0,317 % fällig am 25.08.2046	\$ 539	538	0,02
Bonds, Series 2020				Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				0,492 % fällig am 25.08.2046	280	277	0,01
3,151 % fällig am 01.06.2032	200	208	0,01	0,649 % fällig am 16.01.2057	298	412	0,01	London Wall Mortgage Capital PLC			
3,401 % fällig am 01.06.2034	1.150	1.195	0,04	Ciel No. 1 PLC				0,936 % fällig am 15.11.2049	£ 278	385	0,01
3,501 % fällig am 01.06.2035	1.700	1.772	0,05	1,130 % fällig am 12.06.2046	2.166	3.006	0,09	Ludgate Funding PLC			
Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				0,000 % fällig am 01.12.2060	€ 26	30	0,00
Notes, Series 2020				2,210 % fällig am 25.09.2035	\$ 9	9	0,00	0,260 % fällig am 01.12.2060	£ 182	245	0,01
0,947 % fällig am 01.06.2022	300	301	0,01	Clavis Securities PLC				Mansard Mortgages PLC			
		4.003	0,13	0,250 % fällig am 15.12.2032	£ 291	393	0,01	0,263 % fällig am 15.04.2047	50	68	0,00
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				Countrywide Alternative Loan Trust				0,730 % fällig am 15.12.2049	224	308	0,01
Ginnie Mae				0,232 % fällig am 25.04.2047	\$ 447	406	0,01	Mars SRL			
3,500 % fällig am 15.07.2045	20.564	22.678	0,70	0,252 % fällig am 25.09.2047	49	48	0,00	0,761 % fällig am 25.10.2050	€ 12	14	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security				0,302 % fällig am 25.07.2046	16	15	0,00	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
3,500 % fällig am 01.12.2047 -				0,419 % fällig am 20.12.2035	1.274	1.218	0,04	2,342 % fällig am 25.11.2034	\$ 1.200	1.207	0,04
01.07.2048	17.098	18.515	0,58	1,127 % fällig am 25.12.2035	65	60	0,00	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
		41.193	1,28	5,500 % fällig am 25.04.2035	1.338	1.154	0,04	2,500 % fällig am 25.12.2037	1.312	1.030	0,03
US-SCHATZOBBLIGATIONEN				5,750 % fällig am 25.05.2036	84	53	0,00	6,354 % fällig am 25.08.2036 ^	11.413	3.455	0,11
U.S. Treasury Bonds				6,000 % fällig am 25.11.2036 ^	159	128	0,00	Mortgage Equity Conversion Asset Trust			
1,875 % fällig am 15.02.2041	15.600	15.276	0,47	6,000 % fällig am 25.07.2037	480	328	0,01	0,540 % fällig am 25.05.2042	526	504	0,02
2,750 % fällig am 15.08.2047	200	228	0,01	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Mortimer BTL PLC			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)				5,750 % fällig am 25.12.2035 ^	14	10	0,00	1,349 % fällig am 20.06.2051	£ 2.588	3.602	0,11
2,500 % fällig am 15.01.2029	37	48	0,00	5,750 % fällig am 25.02.2037 ^	648	464	0,01	Mulcair Securities DAC			
U.S. Treasury Notes				5,750 % fällig am 25.08.2037	834	665	0,02	0,461 % fällig am 24.04.2071	€ 1.638	1.949	0,06
0,250 % fällig am 30.09.2025	24.400	23.891	0,74	6,000 % fällig am 25.07.2036	340	258	0,01	NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates			
0,375 % fällig am 30.11.2025	15.600	15.322	0,48	6,500 % fällig am 25.11.2036 ^	9	6	0,00	6,500 % fällig am 25.02.2035 ^	\$ 659	662	0,02
0,750 % fällig am 31.03.2026	50.600	50.381	1,57	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				New Century Alternative Mortgage Loan Trust			
1,250 % fällig am 31.08.2024	37.300	38.187	1,19	0,609 % fällig am 30.11.2037	125	125	0,00	4,960 % fällig am 25.10.2036	555	197	0,01
1,500 % fällig am 15.02.2030	17.800	17.979	0,56	Darrowby No. 5 PLC				Newgate Funding PLC			
1,750 % fällig am 30.06.2022	1.100	1.118	0,03	0,579 % fällig am 20.12.2057	£ 1.067	1.484	0,05	0,058 % fällig am 15.12.2050	€ 104	123	0,00
1,750 % fällig am 30.06.2024	21.600	22.436	0,70	Domi BV				0,240 % fällig am 15.12.2050	£ 289	385	0,01
1,875 % fällig am 31.08.2022	34.500	35.205	1,09	0,308 % fällig am 15.06.2051	€ 1.455	1.736	0,05	NovaStar Mortgage Funding Trust			
1,875 % fällig am 31.08.2024	650	678	0,02	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				0,502 % fällig am 25.09.2046	\$ 2.379	1.019	0,03
1,875 % fällig am 31.07.2026	17.700	18.573	0,58	0,288 % fällig am 19.10.2036	\$ 508	454	0,01	OBX Trust			
2,000 % fällig am 31.10.2022	3.200	3.279	0,10	Durham Mortgages B PLC				0,742 % fällig am 25.06.2057	255	256	0,01
2,000 % fällig am 30.11.2022	28.940	27.642	0,86	0,688 % fällig am 31.03.2054	£ 2.221	3.066	0,10				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Paragon Mortgages PLC 1,099 % fällig am 15.05.2045	£ 1.659	\$ 2.312	0,07	Aqueduct European CLO DAC 0,640 % fällig am 20.07.2030	€ 9.800	\$ 11.641	0,36	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 1,007 % fällig am 25.01.2034	\$ 636	\$ 624	0,02
Pepper Residential Securities Trust 1,205 % fällig am 16.09.2059	AUD 511	386	0,01	Arbour CLO DAC 0,580 % fällig am 15.03.2029	52	61	0,00	3,123 % fällig am 25.12.2036 ^	184	183	0,01
Precise Mortgage Funding PLC 0,730 % fällig am 12.12.2054	£ 46	64	0,00	Ares European CLO DAC 1,120 % fällig am 21.10.2033	8.000	9.501	0,30	CVC Cordatus Loan Fund DAC 0,650 % fällig am 21.07.2030	€ 4.300	5.102	0,16
Residential Accredited Loans, Inc. Trust 5,750 % fällig am 25.06.2036 ^	\$ 28	27	0,00	Argent Mortgage Loan Trust 0,572 % fällig am 25.05.2035	\$ 94	88	0,00	Dryden Euro CLO BV 0,660 % fällig am 15.04.2033	4.500	5.318	0,17
6,000 % fällig am 25.04.2036	1.302	1.260	0,04	Argent Securities Trust 0,312 % fällig am 25.05.2036	179	65	0,00	0,860 % fällig am 15.05.2034 (a)	11.700	13.875	0,43
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	204	194	0,01	0,392 % fällig am 25.07.2036	134	122	0,00	Dryden Senior Loan Fund 1,084 % fällig am 15.10.2027	\$ 588	588	0,02
Residential Asset Securitization Trust 6,500 % fällig am 25.06.2037	2.888	1.170	0,04	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,967 % fällig am 25.04.2034	458	461	0,01	Ellington Loan Acquisition Trust 1,192 % fällig am 25.05.2037	4.322	4.333	0,14
Residential Mortgage Securities PLC 0,884 % fällig am 20.03.2050	£ 411	569	0,02	Atrium Corp. 1,014 % fällig am 22.04.2027	906	906	0,03	Fieldstone Mortgage Investment Trust 0,432 % fällig am 25.04.2047	2.447	2.037	0,06
1,034 % fällig am 20.12.2046	227	314	0,01	Aurium CLO DAC 0,680 % fällig am 13.10.2029	€ 1.187	1.408	0,04	Fremont Home Loan Trust 0,192 % fällig am 25.08.2036	237	101	0,00
1,284 % fällig am 20.09.2065	1.037	1.436	0,05	Babson Euro CLO BV 0,281 % fällig am 25.10.2029	1.484	1.759	0,06	0,227 % fällig am 25.10.2036	187	172	0,01
RESIMAC Bastille Trust 0,957 % fällig am 05.12.2059	\$ 240	240	0,01	Barings Euro CLO BV 0,680 % fällig am 27.07.2030	379	450	0,01	0,962 % fällig am 25.05.2034	2.033	1.999	0,06
Ribbon Finance PLC 0,866 % fällig am 20.04.2028	£ 200	275	0,01	Bayview Financial Acquisition Trust 6,096 % fällig am 28.12.2036	\$ 1.732	1.845	0,06	GE-WMC Mortgage Securities Trust 0,392 % fällig am 25.08.2036	5.778	3.485	0,11
Ripon Mortgages PLC 0,881 % fällig am 20.08.2056	2.013	2.787	0,09	BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	€ 2.133	2.537	0,08	Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd. 1,281 % fällig am 15.09.2037	5.000	5.002	0,16
RMAC PLC 0,780 % fällig am 12.06.2046	204	282	0,01	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 0,322 % fällig am 25.02.2037	\$ 3.000	2.834	0,09	GSAA Home Equity Trust 5,772 % fällig am 25.11.2036 ^	528	236	0,01
1,050 % fällig am 12.06.2046	281	390	0,01	0,722 % fällig am 25.02.2036	2.068	2.060	0,06	5,985 % fällig am 25.06.2036	1.482	626	0,02
RMAC Securities PLC 0,230 % fällig am 12.06.2044	56	76	0,00	0,737 % fällig am 25.12.2035	315	315	0,01	GSAMP Trust 0,232 % fällig am 25.11.2036	2.230	1.373	0,04
Shamrock Residential DAC 0,288 % fällig am 24.12.2059	€ 2.868	3.405	0,11	0,947 % fällig am 25.07.2034	1.885	1.869	0,06	0,352 % fällig am 25.02.2046	748	725	0,02
Silverstone Master Issuer PLC 0,756 % fällig am 21.01.2070	\$ 508	509	0,02	1,112 % fällig am 25.10.2035	624	618	0,02	Halcyon Loan Advisors Funding Ltd. 1,108 % fällig am 20.04.2027	94	94	0,00
0,799 % fällig am 21.01.2070	£ 2.046	2.853	0,09	1,142 % fällig am 25.08.2037	1.048	997	0,03	Harvest CLO DAC 0,640 % fällig am 15.10.2031	€ 9.600	11.376	0,35
Stanlington PLC 1,080 % fällig am 12.06.2046	214	297	0,01	Black Diamond CLO DAC 0,650 % fällig am 03.10.2029	€ 1.234	1.463	0,05	HSI Asset Securitization Corp. Trust 0,872 % fällig am 25.01.2036	\$ 2.200	2.128	0,07
Stratton Mortgage Funding PLC 0,901 % fällig am 25.09.2051	11.636	16.119	0,50	Blackrock European CLO DAC 0,620 % fällig am 15.10.2031	5.400	6.376	0,20	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,232 % fällig am 25.07.2036	7	7	0,00
0,948 % fällig am 20.07.2060	5.300	7.351	0,23	Brookside Mill CLO Ltd. 1,010 % fällig am 17.01.2028	\$ 651	651	0,02	Jubilee CLO BV 0,258 % fällig am 15.12.2029	€ 3.255	3.848	0,12
Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,312 % fällig am 25.09.2047	\$ 951	866	0,03	Cairn CLO BV 0,600 % fällig am 30.04.2031	€ 8.200	9.701	0,30	0,295 % fällig am 12.07.2028	4.625	5.479	0,17
Towd Point Mortgage Funding PLC 0,881 % fällig am 20.02.2045	£ 408	566	0,02	0,650 % fällig am 20.10.2028	245	291	0,01	LCM LP 1,228 % fällig am 20.10.2027	\$ 691	691	0,02
0,949 % fällig am 20.07.2045	1.812	2.511	0,08	0,670 % fällig am 31.01.2030	700	831	0,03	Lehman XS Trust 0,706 % fällig am 25.03.2037	3.160	3.232	0,10
1,111 % fällig am 20.10.2051	6.592	9.155	0,29	0,790 % fällig am 25.07.2029	208	247	0,01	Long Beach Mortgage Loan Trust 0,532 % fällig am 25.02.2036	594	584	0,02
1,249 % fällig am 20.02.2054	1.244	1.729	0,05	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,750 % fällig am 15.11.2031	800	945	0,03	1,007 % fällig am 25.08.2035	4.270	4.161	0,13
Trinidad Mortgage Securities PLC 0,888 % fällig am 24.01.2059	97	134	0,00	Catamaran CLO Ltd. 1,031 % fällig am 27.01.2028	\$ 884	884	0,03	Man GLG Euro CLO DAC 0,680 % fällig am 15.10.2030	€ 3.000	3.564	0,11
Twin Bridges PLC 0,860 % fällig am 12.09.2044	105	145	0,01	CIT Mortgage Loan Trust 1,592 % fällig am 25.10.2037	5.500	5.595	0,17	0,870 % fällig am 15.01.2030	999	1.185	0,04
0,899 % fällig am 12.03.2055	10.200	14.189	0,44	Citigroup Mortgage Loan Trust 0,152 % fällig am 25.07.2045	484	416	0,01	Marathon CLO Ltd. 1,019 % fällig am 21.11.2027	\$ 403	403	0,01
0,960 % fällig am 12.09.2050	330	459	0,01	0,242 % fällig am 25.12.2036	113	59	0,00	Monroe Capital BSL CLO Ltd. 1,270 % fällig am 22.05.2027	24	24	0,00
1,030 % fällig am 12.12.2052	1.590	2.208	0,07	0,262 % fällig am 25.07.2045	9.019	7.855	0,24	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,162 % fällig am 25.10.2036	1.643	972	0,03
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,176 % fällig am 25.02.2037 ^	\$ 122	122	0,00	7,250 % fällig am 25.05.2036	1.040	738	0,02	0,222 % fällig am 25.11.2036	1.864	1.056	0,03
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,692 % fällig am 25.07.2036 ^	122	70	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,037 % fällig am 25.10.2034	84	83	0,00	0,232 % fällig am 25.05.2037	1.813	1.660	0,05
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 2,990 % fällig am 25.07.2034	16	16	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 0,352 % fällig am 25.03.2037	3.833	3.633	0,11	0,242 % fällig am 25.09.2036	16.482	7.928	0,25
		169.341	5,26	Columbia Cent CLO Ltd. 1,326 % fällig am 25.10.2028	3.649	3.654	0,11	0,322 % fällig am 25.10.2036	1.315	873	0,03
				Contego CLO BV 0,369 % fällig am 15.11.2026	€ 61	73	0,00	0,322 % fällig am 25.11.2036	6.118	4.536	0,14
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Contego CLO DAC 0,640 % fällig am 23.01.2030	4.000	4.734	0,15	0,342 % fällig am 25.07.2036	565	504	0,02
Accredited Mortgage Loan Trust 0,352 % fällig am 25.09.2036	1.206	1.189	0,04	Countrywide Asset-Backed Certificates 0,232 % fällig am 25.06.2035	\$ 4.352	4.112	0,13	0,592 % fällig am 25.04.2036	132	123	0,00
0,722 % fällig am 25.09.2035	1.500	1.425	0,04	0,252 % fällig am 25.09.2046 ^	3	3	0,00	0,632 % fällig am 25.12.2034	1.362	1.334	0,04
Accunia European CLO DAC 0,950 % fällig am 15.07.2030	€ 2.900	3.441	0,11	0,272 % fällig am 25.11.2047 ^	2.201	2.244	0,07	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 0,602 % fällig am 25.02.2036	1.800	1.720	0,05
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,242 % fällig am 25.07.2036	\$ 1.105	528	0,02	0,292 % fällig am 25.06.2047 ^	3.432	3.214	0,10	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 6,226 % fällig am 25.10.2036 ^	307	135	0,00
0,372 % fällig am 25.07.2036	119	98	0,00	0,302 % fällig am 25.05.2047 ^	97	93	0,00	Mountain View CLO Ltd. 1,008 % fällig am 13.10.2027	1.086	1.087	0,03
0,707 % fällig am 25.12.2035	2.800	2.729	0,09	0,312 % fällig am 25.09.2037 ^	591	593	0,02	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 0,492 % fällig am 25.02.2037 ^	3.463	1.303	0,04
ALME Loan Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2031	€ 1.785	2.114	0,07	1,142 % fällig am 25.08.2035	43	43	0,00	NovaStar Mortgage Funding Trust 0,252 % fällig am 25.09.2037	50	50	0,00
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 0,797 % fällig am 25.11.2035	\$ 2.464	2.467	0,08	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 0,282 % fällig am 25.06.2047	9	9	0,00	0,412 % fällig am 25.05.2036	83	82	0,00
0,962 % fällig am 25.01.2036	3.400	3.346	0,10	0,572 % fällig am 25.05.2036	4.700	4.677	0,15	OAK Hill European Credit Partners DAC 0,720 % fällig am 21.02.2030	€ 2.217	2.633	0,08
1,112 % fällig am 25.09.2034	2.479	2.483	0,08	0,752 % fällig am 25.08.2035	563	558	0,02				

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Libor Plus Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
OCP CLO Ltd.				STAATSEMISSIONEN				ARGENTINA TREASURY BILLS			
0,984 % fällig am 15.07.2027	\$ 233	\$ 233	0,01	Argentina Government International Bond				(3,480) % fällig am			
0,996 % fällig am 26.10.2027	422	422	0,01	0,125 % fällig am 09.07.2030	\$ 1.422	\$ 511	0,02	13.09.2021 (c)(d)	ARS 106.930	\$ 632	0,02
Option One Mortgage Loan Trust				0,125 % fällig am 09.07.2035	2.504	798	0,02	ISRAEL TREASURY BILLS			
0,232 % fällig am 25.01.2037	61	43	0,00	1,000 % fällig am 09.07.2029	150	57	0,00	(0,028) % fällig am			
0,232 % fällig am 25.02.2037	759	582	0,02	36,106 % fällig am 03.04.2022	ARS 7.790	45	0,00	30.11.2021 (c)(d)	ILS 51.300	15.745	0,49
0,232 % fällig am 25.03.2037	980	917	0,03	Australia Government International Bond				(0,020) % fällig am			
0,312 % fällig am 25.04.2037	725	582	0,02	2,500 % fällig am 21.05.2030	AUD 46.700	38.376	1,19	02.02.2022 (c)(d)	80.100	24.580	0,76
0,312 % fällig am 25.05.2037	785	583	0,02	Autonomous Community of Catalonia						40.325	1,25
OZLM Ltd.				4,900 % fällig am 15.09.2021	€ 1.350	1.618	0,05	JAPAN TREASURY BILLS			
1,266 % fällig am 30.07.2027	850	850	0,03	China Development Bank				(0,099) % fällig am			
Palmer Square Loan Funding Ltd.				3,230 % fällig am 10.01.2025	CNY 206.600	32.079	1,00	05.07.2021 (c)(d)	¥ 15.000.000	135.149	4,20
1,056 % fällig am 15.11.2026	838	838	0,03	3,340 % fällig am 14.07.2025	184.300	28.673	0,89	U.S. TREASURY BILLS			
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				Emirate of Abu Dhabi Government International Bond				0,005 % fällig am			
0,422 % fällig am 25.07.2036	941	919	0,03	2,500 % fällig am 11.10.2022	\$ 700	720	0,02	01.07.2021 (c)(d)(k)	\$ 32.500	32.500	1,01
RAAC Trust				Israel Government International Bond				0,005 % fällig am 20.07.2021			
0,472 % fällig am 25.10.2046	130	128	0,00	0,000 % fällig am 30.11.2021	ILS 20.000	6.138	0,19	(c)(d)	84.200	84.198	2,62
Residential Asset Securities Corp. Trust				2,750 % fällig am 03.07.2030	\$ 1.900	2.031	0,06	0,015 % fällig am 29.07.2021			
0,342 % fällig am 25.04.2037	11	11	0,00	3,800 % fällig am 13.05.2060	4.100	4.679	0,15	(c)(d)	200.000	199.993	6,21
0,432 % fällig am 25.11.2036	68	65	0,00	5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS 102.600	32.510	1,01	0,015 % fällig am			
0,677 % fällig am 25.03.2036	2.342	2.335	0,07	Japan Finance Organization for Municipalities				05.08.2021 (c)(d)(k)	31.200	31.199	0,97
0,707 % fällig am 25.01.2036	8	8	0,00	0,050 % fällig am 12.02.2027	€ 1.500	1.790	0,06	0,025 % fällig am			
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				Peru Government International Bond				09.09.2021 (c)(d)(k)	43.700	43.697	1,36
0,752 % fällig am 25.08.2035 ^	73	60	0,00	5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 56.532	16.161	0,50	0,041 % fällig am 23.09.2021	82.300	82.291	2,56
Segovia European CLO DAC				6,150 % fällig am 12.08.2032	11.700	3.122	0,10	(c)(d)	32.500	32.496	1,01
0,880 % fällig am 20.07.2032 (a)	€ 4.200	4.981	0,16	6,350 % fällig am 12.08.2028	32.446	9.483	0,29	0,051 % fällig am			
SG Mortgage Securities Trust				Qatar Government International Bond				30.09.2021 (a)(c)(d)		506.374	15,74
0,302 % fällig am 25.10.2036	\$ 3.600	2.924	0,09	3,875 % fällig am 23.04.2023	\$ 1.000	1.063	0,03	Summe kurzfristige Instrumente		692.694	21,53
Sierra Madre Funding Ltd.				4,500 % fällig am 23.04.2028	1.600	1.891	0,06	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 2.721.691	84,59
0,486 % fällig am 07.09.2039	3.011	2.681	0,08	Saudi Government International Bond							
Soundview Home Loan Trust				2,375 % fällig am 26.10.2021	4.900	4.932	0,15	AKTIEN			
0,292 % fällig am 25.06.2037	2.784	2.306	0,07	2,875 % fällig am 04.03.2023	600	623	0,02	INVESTMENTFONDS			
0,342 % fällig am 25.10.2036	1.770	1.726	0,05	3,625 % fällig am 04.03.2028	1.600	1.771	0,06	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
0,352 % fällig am 25.02.2037	1.098	421	0,01	South Africa Government International Bond				PIMCO Funds: Global Investors Series plc – Asia Strategic Interest Bond Fund (g)	1.197.507	12.179	0,38
Structured Asset Investment Loan Trust				4,850 % fällig am 30.09.2029	4.500	4.785	0,15	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)	385.356	4.566	0,14
1,067 % fällig am 25.01.2035	1.685	1.640	0,05	Turkey Government International Bond				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	24.519.040	244.234	7,59
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				5,750 % fällig am 22.03.2024	1.000	1.040	0,03	Summe Investmentfonds		\$ 323.381	10,05
0,247 % fällig am 25.09.2036	5.735	4.497	0,14	6,350 % fällig am 10.08.2024	4.500	4.731	0,15			260.979	8,11
1,610 % fällig am 25.04.2035	63	64	0,00	VORZUGSWERTPAPIERE				BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
TICP CLO Ltd.				Nationwide Building Society	2.850	740	0,02	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	614.500	62.402	1,94
1,028 % fällig am 20.04.2028	213	213	0,01	10,250 % (f)				Summe			
Takehau CLO BV				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE							
0,880 % fällig am 07.12.2029	€ 2.615	3.104	0,10	COMMERCIAL PAPER							
Toro European CLO DAC				Sunac China Holdings Ltd.	\$ 5.300	5.304	0,17				
0,900 % fällig am 15.10.2030	392	465	0,01	5,950 % fällig am 30.12.2021 (i)							
Tralee CLO Ltd.				KURZFRISTIGE SCHULDITITEL							
1,298 % fällig am 20.10.2028	\$ 2.365	2.366	0,07	Pacific Gas and Electric Co.	4.900	4.910	0,15				
Venture CLO Ltd.				1,531 % fällig am 15.11.2021							
1,004 % fällig am 15.04.2027	384	384	0,01								
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust											
0,317 % fällig am 25.05.2037	662	625	0,02								
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust											
0,392 % fällig am 25.04.2037	5.701	4.787	0,15								
1,817 % fällig am 25.11.2035	100	101	0,00								
Wind River CLO Ltd.											
1,054 % fällig am 15.10.2027	166	166	0,01								
Z Capital Credit Partners CLO Ltd.											
1,134 % fällig am 16.07.2027	506	507	0,02								
		274.217	8,52								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	0,030	30.06.2021	01.07.2021	\$ 88.200	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	\$ (90.073)	\$ 88.200	\$ 88.200	2,74
TDM	0,030	30.06.2021	01.07.2021	139.300	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	(142.249)	139.300	139.300	4,33
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (232.322)	\$ 227.500	\$ 227.500	7,07

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend¹, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2021	105	\$ (10)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	597	949	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	66	125	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	20	85	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	4.309	(1.008)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	378	(44)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	741	(1.489)	(0,05)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	29	135	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	288	(2.655)	(0,08)
				\$ (3.912)	(0,12)
				\$ (3.912)	(0,12)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ (3.912) (0,12)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend¹)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 4.300	\$ 80	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	800	1	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	€ 4.000	66	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	\$ 1.700	12	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	€ 2.500	(92)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	700	(27)	0,00
				\$ 40	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.HY-34 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2025	\$ 35.972	\$ (5.924)	(0,18)
iTraxx Europe Main 32 5-Year Index	(1,000)	20.12.2024	€ 200	0	0,00
iTraxx Europe Senior 27 5-Year Index	(1,000)	20.06.2022	100	2	0,00
iTraxx Europe Subordinated 27 5-Year Index	(1,000)	20.06.2022	2.300	(6)	0,00
				\$ (5.928)	(0,18)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000 %	20.06.2026	\$ 2.000	\$ 30	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	15.09.2026	£ 74.400	\$ (236)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	59.100	955	0,03
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	35.600	(1.188)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,350	03.01.2022	BRL 223.700	(365)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	32.900	(13)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,364	03.01.2022	515.700	(560)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,700	03.01.2022	716.200	(22)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,978	03.01.2022	28.800	(31)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,040	03.01.2022	12.200	(12)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,115	02.01.2023	441.000	143	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,790	02.01.2024	297.000	205	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 108.800	17	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	4.900	7	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	7.200	5	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,270	03.03.2022	6.400	42	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,273	03.03.2022	3.800	25	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025	4.500	15	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	2.700	9	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Libor Plus Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,290 %	03.03.2025	CAD 1.300	\$ 5	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2022	6.300	23	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,755	16.12.2025	CNY 35.900	6	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	\$ 83.700	270	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,622	20.03.2025	15.300	(34)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,640	18.02.2026	26.930	(233)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	5.000	(88)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	9.320	(389)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	12.210	(545)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	16.01.2050	5.000	164	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	03.02.2050	500	10	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	18.12.2049	12.000	(673)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	22.01.2050	4.200	28	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.12.2029	5.100	(267)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.02.2030	9.900	(423)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.03.2030	4.900	(285)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.01.2050	2.200	(112)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.12.2051	40.200	276	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	39.540	(5.183)	(0,16)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	2.195	(492)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	11.12.2049	4.300	(463)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	11.400	(20)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	€ 46.900	76	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	28-Day MXN-TIIE	5,660	24.03.2023	MXN 2.900.000	(1.159)	(0,04)
Zahlung	UKRP1	3,579	15.10.2033	£ 4.900	284	0,01
Zahlung	UKRP1	3,596	15.05.2034	6.500	252	0,01
					\$ (9.976)	(0,31)
					\$ (15.834)	(0,49)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.
- (2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,023 %	29.06.2023	14.900	\$ 794	\$ 729	0,02
MYC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	29.09.2021	59.700	1.313	267	0,01
							\$ 2.107	\$ 996	0,03

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,641	07.07.2021	6.100	\$ 34	\$ 1	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	21.07.2021	14.100	\$ (15)	\$ (1)	0,00
BPS	Put – OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	4.700	(29)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	10.600	(12)	(2)	0,00
BRC	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	7.000	(4)	(5)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	7.000	(9)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	6.000	(6)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	4.700	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	6.000	(7)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	16.600	(17)	(10)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	21.07.2021	12.700	\$ (12)	\$ (1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	18.000	(23)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	2.700	(3)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	12.800	(14)	(8)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	26.300	(28)	(15)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	5.500	(7)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	5.900	(6)	0	0,00
							\$ (197)	\$ (47)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021 %	29.06.2023	73.000	\$ (792)	\$ (745)	(0,02)
MYC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	6.100	(46)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	59.700	(475)	(38)	0,00
							\$ (1.313)	\$ (783)	(0,02)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens	
FAR	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	6.900	\$ (30)	\$ (6)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	05.08.2021	3.300	(12)	(5)	0,00	
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,797	05.08.2021	3.300	(10)	(4)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,547	07.07.2021	2.400	(9)	0	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,672	07.07.2021	9.000	(39)	(1)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	100,219	07.07.2021	7.000	(43)	(3)	0,00	
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,219	07.07.2021	7.000	(35)	(11)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,188	05.08.2021	1.700	(6)	(3)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,406	05.08.2021	17.600	(76)	(33)	0,00	
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,188	05.08.2021	1.700	(3)	(6)	0,00	
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,406	05.08.2021	17.600	(40)	(47)	(0,01)	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,281	07.09.2021	3.300	(16)	(13)	0,00	
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,281	07.09.2021	6.600	(18)	(28)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,211	07.07.2021	7.300	(28)	0	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,703	05.08.2021	1.600	(3)	(1)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,078	05.08.2021	2.100	(9)	(3)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	101,844	07.09.2021	3.100	(9)	(8)	0,00	
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	103,844	07.09.2021	3.100	(4)	(5)	0,00	
						\$ (390)	\$ (177)	(0,01)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	UBS AG	(1,000) %	20.06.2024	\$ 200	\$ 13	\$ (16)	\$ (3)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.12.2022	\$ 200	\$ (1)	\$ 2	\$ 1	0,00
BRC	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	200	(26)	11	(15)	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	0	0	0	0,00
GLM	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2023	1.200	(88)	87	(1)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(3)	2	(1)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(3)	4	1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	2.300	(102)	89	(13)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	(12)	12	0	0,00
MYC	Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2021	€ 5.200	36	(8)	28	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	\$ 500	(16)	18	2	0,00
					\$ (215)	\$ 217	\$ 2	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽³⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 2.200	\$ (9)	\$ 32	\$ 23	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	100	(4)	5	1	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.500	(3)	19	16	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	300	(9)	12	3	0,00
					\$ (25)	\$ 68	\$ 43	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Libor Plus Bond Fund (Forts.)

- (1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.
- (2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	MXN	\$	15.113	765	\$ 7	0,00
	07.2021	\$	AUD	7.269	9.654	0	0,00
	07.2021		BRL	19.893	105.607	1.154	0,04
	08.2021	AUD	\$	9.654	7.270	22	0,00
	08.2021	\$	RUB	649	48.819	15	0,00
	09.2021		PLN	8	31	0	0,00
	09.2021		RUB	1.286	93.806	0	0,00
	07.2021	AUD	\$	38.203	29.689	1.008	0,03
	07.2021	€		2.559	3.103	69	0,00
BPS	07.2021	¥		55.438	507	7	0,00
	07.2021	\$	CAD	1.148	1.389	0	0,00
	07.2021		€	1.194	1.000	0	0,00
	07.2021		£	1.096	785	0	0,00
	08.2021	PEN	\$	1.259	341	11	0,00
	11.2021	MXN		13.076	648	2	0,00
	07.2021	€		8.619	10.499	277	0,01
	07.2021	\$	€	5.801	4.855	0	0,00
	BRC	07.2021	BRL	\$	8.565	1.700	0
07.2021		MXN		14.279	691	0	0,00
07.2021		PEN		75.432	20.079	638	0,01
07.2021		\$	PEN	7.498	29.605	256	0,01
07.2021			RUB	589	45.476	32	0,00
08.2021		PEN	\$	33.416	8.992	246	0,01
08.2021		\$	PEN	952	3.680	12	0,00
08.2021			RUB	803	60.357	18	0,00
09.2021		PEN	\$	12.759	3.401	60	0,00
CBK	09.2021	\$	CLP	7.903	5.685.538	0	0,00
	09.2021		ZAR	7.680	105.235	0	0,00
	11.2021	ILS	\$	71.312	21.877	0	0,00
	01.2022			7.810	2.384	0	0,00
	01.2022	PEN		10.289	2.831	141	0,01
	02.2022	ILS		80.116	24.430	0	0,00
	03.2022	PEN		12.459	3.383	129	0,00
	07.2021	BRL		97.042	19.268	0	0,00
	07.2021	£		155.807	220.269	5.029	0,16
GLM	07.2021	¥		15.000.000	137.471	2.320	0,07
	07.2021	\$	PEN	3.627	14.425	143	0,00
	07.2021		RUB	1.181	91.159	63	0,00
	08.2021	PEN	\$	14.425	3.630	0	0,00
	08.2021	\$	BRL	19.206	97.042	70	0,00
	08.2021		COP	12.906	49.173.619	237	0,01
	08.2021		RUB	1.125	84.314	21	0,00
	09.2021	TWD	\$	3.483	127	2	0,00
	09.2021	\$	PLN	3	11	0	0,00
HUS	09.2021		RUB	1.634	119.749	0	0,00
	09.2021		ZAR	6.548	90.497	0	0,00
	11.2021	PEN	\$	9.780	2.609	50	0,00
	01.2022	ILS		100.474	30.873	39	0,00
	07.2021	€		5.070	6.039	26	0,00
	07.2021	\$	£	216.250	156.222	0	0,00
	08.2021	£	\$	155.409	215.114	406	0,01
	08.2021	\$	RUB	1.570	118.252	38	0,00
	09.2021	CNH	\$	388.121	60.393	619	0,02
MYI	09.2021	\$	PLN	5	19	0	0,00
	09.2021		RUB	674	49.391	0	0,00
	10.2021		MXN	178	3.757	8	0,00
	12.2021	PEN	\$	234	63	2	0,00
	07.2021	CAD		967	786	5	0,00
	07.2021	£		3.314	4.608	30	0,00
	07.2021	\$	AUD	5.405	7.146	0	0,00
	07.2021		€	4	3	0	0,00
	07.2021		£	2.063	1.491	0	0,00
SCX	07.2021		RUB	479	36.667	22	0,00
	08.2021	AUD	\$	7.146	5.406	40	0,00
	11.2021	CLP		5.695.075	7.879	89	0,00
	07.2021	€		338.336	413.904	12.670	0,39
	07.2021	PEN		4.477	1.190	21	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2021	\$ 2.046	PEN 8.142	\$ 81	\$ 0	\$ 81	0,00
	09.2021	PEN 8.142	\$ 2.047	0	(84)	(84)	0,00
	12.2021	1.863	502	15	0	15	0,00
TOR	07.2021	CAD 13.060	10.810	263	0	263	0,01
UAG	07.2021	AUD 13.237	10.261	323	0	323	0,01
	07.2021	\$ 26.276	AUD 34.640	0	(270)	(270)	(0,01)
	07.2021	1.805	RUB 138.440	85	0	85	0,00
	08.2021	AUD 34.640	\$ 26.280	270	0	270	0,01
	09.2021	\$ 665	RUB 48.796	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 27.091	\$ (2.697)	\$ 24.394	0,76

ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 104	€ 86	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
BPS	07.2021	€ 2.468	\$ 2.935	8	0	8	0,00
	07.2021	\$ 35.305	€ 28.865	0	(1.075)	(1.075)	(0,04)
BRC	07.2021	3	2	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	€ 215	\$ 257	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 1.261	€ 1.045	0	(22)	(22)	0,00
MYI	07.2021	€ 3	\$ 4	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	\$ 40.904	€ 33.436	0	(1.253)	(1.253)	(0,04)
TOR	07.2021	40.871	33.408	0	(1.252)	(1.252)	(0,04)
UAG	07.2021	€ 53	\$ 64	2	0	2	0,00
				\$ 12	\$ (3.604)	\$ (3.592)	(0,12)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 28.740	\$ 39.971	\$ 269	\$ 0	\$ 269	0,01
	07.2021	\$ 1.397	£ 999	0	(17)	(17)	0,00
BRC	07.2021	£ 5.595	\$ 7.883	153	0	153	0,00
GLM	07.2021	\$ 1.013.569	£ 716.949	0	(23.141)	(23.141)	(0,72)
HUS	07.2021	£ 748.075	\$ 1.035.405	1.977	0	1.977	0,06
	08.2021	\$ 1.034.831	£ 747.610	0	(1.953)	(1.953)	(0,06)
MYI	07.2021	£ 82	\$ 116	3	0	3	0,00
	07.2021	\$ 15.407	£ 11.058	0	(131)	(131)	0,00
SCX	07.2021	10.831	7.623	0	(301)	(301)	(0,01)
SSB	07.2021	£ 747.610	\$ 1.033.142	355	0	355	0,01
	07.2021	\$ 1.007.209	£ 710.844	0	(25.214)	(25.214)	(0,78)
	08.2021	1.033.224	747.610	0	(346)	(346)	(0,01)
UAG	07.2021	1.015.822	716.949	0	(25.394)	(25.394)	(0,79)
				\$ 2.757	\$ (76.497)	\$ (73.740)	(2,29)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (52.906)	(1,65)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG

US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

Uniform Mortgage-Backed Security, TBA
2,000 % fällig am 01.07.2051
2,000 % fällig am 01.08.2051

	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
	\$ 5.700	\$ (5.755)	(0,18)
	23.400	(23.583)	(0,73)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (29.338)	(0,91)
Summe Anlagen		\$ 3.170.582	98,54
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 47.034	1,46
Nettovermögen		\$ 3.217.616	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Libor Plus Bond Fund (Forts.)

- (c) Nullkuponwertpapier.
 (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
 (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
 (g) Mit dem Fonds verbunden.
 (h) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (i) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	3,729 %	14.01.2032	11.01.2021 - 24.02.2021	\$ 2.203	\$ 2.241	0,07
Sunac China Holdings Ltd.	5,950	30.12.2021	11.01.2021	5.299	5.304	0,17
				\$ 7.502	\$ 7.545	0,24

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.142 als Sicherheiten verpfändet.

(k) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 74.520 und Barmittel in Höhe von USD 1.071 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 29.024 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.717.434	\$ 4.257	\$ 2.721.691
Investmentfonds	260.979	62.402	0	323.381
Pensionsgeschäfte	0	227.500	0	227.500
Finanzderivate ⁽³⁾	1.149	(73.801)	0	(72.652)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(29.338)	0	(29.338)
Summen	\$ 262.128	\$ 2.904.197	\$ 4.257	\$ 3.170.582

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.928.756	\$ 7.453	\$ 2.936.209
Investmentfonds	50.855	62.486	0	113.341
Pensionsgeschäfte	0	20.967	0	20.967
Finanzderivate ⁽³⁾	2.057	19.329	0	21.386
Summen	\$ 52.912	\$ 3.031.538	\$ 7.453	\$ 3.091.903

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	(1,250) %	05.05.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (965)	\$ (1.142)	(0,04)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (1.142)	(0,04)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 1.139	\$ (1.600)	\$ (461)
BPS	232	0	232
BRC	354	(370)	(16)
CBK	410	(860)	(450)
FAR	(15)	40	25
GLM	(15.771)	17.204	1.433
GST	(15)	0	(15)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
HUS	\$ 660	\$ (852)	\$ (192)
MYC	260	(500)	(240)
MYI	15	(260)	(245)
SAL	(145)	301	156
SCX	11.149	(9.780)	1.369
SSB	(25.205)	22.771	(2.434)
TOR	(989)	730	(259)
UAG	(24.985)	34.545	9.560

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	54,23	45,13
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	27,28	62,55
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,08	3,34
Investmentfonds	10,05	4,29
Pensionsgeschäfte	7,07	0,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,12)	0,08
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,49)	(0,97)
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,65)	1,70
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,91)	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,04)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,43	1,49
Unternehmensanleihen und Wechsel	25,87	24,27
Kommunalanleihen und Wechsel	0,13	0,15
US-Regierungsbehörden	1,28	18,44
US-Schatzobligationen	14,35	23,79
Non-Agency-MBS	5,26	5,67
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,52	8,63
Staatsemissionen	6,20	4,58
Vorzugswertpapiere	0,02	0,02
Kurzfristige Instrumente	21,53	23,98
Investmentfonds	10,05	4,29
Pensionsgeschäfte	7,07	0,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,12)	0,08
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,18)	(0,29)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,31)	(0,67)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswaptionen	0,03	0,03
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Zinsswaptionen	(0,02)	(0,01)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,76	(0,41)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,41)	2,09
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,91)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	1,46	(16,91)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Low Duration Real Return Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
AUSTRALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,900 % fällig am 22.03.2023	\$ 1.100	\$ 1.158	0,11
STAATSEMISSIONEN			
Australia Government International Bond 0,750 % fällig am 21.11.2027 (c)	AUD 4.053	3.372	0,32
1,250 % fällig am 21.02.2022 (c)	3.544	2.710	0,26
3,000 % fällig am 20.09.2025 (c)	5.624	4.981	0,47
		11.063	1,05
Summe Australien		12.221	1,16
KANADA			
STAATSEMISSIONEN			
Canadian Government Real Return Bond 4,250 % fällig am 01.12.2026 (c)	CAD 2.396	2.495	0,24
CAYMAN INSELN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Atlas Senior Loan Fund Ltd. 1,530 % fällig am 16.01.2030	\$ 2.300	2.301	0,22
OCP CLO Ltd. 0,984 % fällig am 15.07.2027	99	100	0,01
		2.401	0,23
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Park Aerospace Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 15.08.2022	14	15	0,00
Summe Cayman Inseln		2.416	0,23
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 10.905	1.676	0,16
1,000 % fällig am 01.10.2053	11.077	1.667	0,16
1,500 % fällig am 01.10.2050	537	85	0,01
1,500 % fällig am 01.10.2053	15.300	2.402	0,23
2,500 % fällig am 01.10.2047	5	1	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,500 % fällig am 01.10.2043	11.801	1.793	0,17
1,000 % fällig am 01.10.2050	28.949	4.453	0,42
2,500 % fällig am 01.10.2047	18	3	0,00
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	174.032	26.501	2,51
1,000 % fällig am 01.10.2053	50.445	7.562	0,72
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	83.500	13.129	1,25
2,500 % fällig am 01.10.2047	2	0	0,00
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.04.2022	24.500	3.950	0,37
1,000 % fällig am 01.10.2053	9.076	1.365	0,13
1,500 % fällig am 01.10.2050	17.400	2.765	0,26
1,500 % fällig am 01.10.2053	41.000	6.436	0,61
2,500 % fällig am 01.04.2047	12	2	0,00
		73.790	7,00
STAATSEMISSIONEN			
Denmark Government International Bond 0,100 % fällig am 15.11.2023 (c)	11.872	1.971	0,19
Summe Dänemark		75.761	7,19
FRANKREICH			
STAATSEMISSIONEN			
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2025 (c)	€ 9.146	11.545	1,09
0,100 % fällig am 01.03.2026 (c)	6.291	8.117	0,77
0,100 % fällig am 01.03.2028 (c)	12.909	17.004	1,61
0,100 % fällig am 01.03.2029 (c)	1.844	2.471	0,23
0,100 % fällig am 25.07.2036 (c)	209	297	0,03
0,250 % fällig am 25.07.2024 (c)	24.118	30.569	2,90
1,100 % fällig am 25.07.2022 (c)	18.345	22.549	2,14
2,100 % fällig am 25.07.2023 (c)	10.496	13.450	1,28
Summe Frankreich		106.002	10,05

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Deutsche Bank AG 4,250 % fällig am 14.10.2021	\$ 3.100	\$ 3.134	0,30
GUERNSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,800 % fällig am 15.09.2022	600	624	0,06
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Arbour CLO DAC 0,580 % fällig am 15.03.2029	€ 1.707	2.025	0,19
Ares European CLO DAC 0,780 % fällig am 15.10.2031	4.200	4.981	0,47
Carlyle Euro CLO DAC 0,700 % fällig am 15.01.2031	800	949	0,09
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,730 % fällig am 21.09.2029	417	495	0,05
Cork Street CLO DAC 0,590 % fällig am 27.11.2028	651	772	0,07
Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029	2.409	2.861	0,27
Tymon Park CLO DAC 0,590 % fällig am 21.01.2029	600	712	0,07
		12.795	1,21
NON-AGENCY-MBS			
European Loan Conduit 1,000 % fällig am 17.02.2030	1.299	1.547	0,15
Summe Irland		14.342	1,36
ITALIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030 (c)	18.341	23.501	2,23
0,650 % fällig am 15.05.2026 (c)	3.250	4.158	0,39
1,400 % fällig am 26.05.2025 (c)	21.040	26.965	2,56
2,350 % fällig am 15.09.2024 (c)	29.594	39.327	3,73
2,600 % fällig am 15.09.2023 (c)	9.724	12.592	1,20
Summe Italien		106.543	10,11
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Central Nippon Expressway Co. Ltd. 2,567 % fällig am 02.11.2021	\$ 4.900	4.933	0,46
Mitsubishi HC Capital, Inc. 2,652 % fällig am 19.09.2022	200	205	0,02
3,406 % fällig am 28.02.2022	400	407	0,04
Toyota Tsusho Corp. 3,625 % fällig am 13.09.2023	900	959	0,09
		6.504	0,61
STAATSEMISSIONEN			
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 10.03.2031 (c)	¥ 482.376	4.446	0,42
0,100 % fällig am 10.03.2026 (c)	1.207.945	11.117	1,06
0,100 % fällig am 10.03.2028 (c)	1.230.907	11.379	1,08
0,100 % fällig am 10.03.2029 (c)	1.955.845	18.124	1,72
0,200 % fällig am 10.03.2030 (c)	69.589	656	0,06
		45.722	4,34
Summe Japan		52.226	4,95
LUXEMBURG			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Delos Finance SARL 1,997 % fällig am 06.10.2023	\$ 70	70	0,01
NIEDERLANDE			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Barings Euro CLO BV 0,680 % fällig am 27.07.2030	€ 442	525	0,05

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Cairn CLO BV 0,650 % fällig am 20.10.2028	€ 1.970	\$ 2.341	0,22
0,780 % fällig am 15.10.2031	1.700	2.016	0,19
Grosvenor Place CLO BV 0,720 % fällig am 30.10.2029	3.758	4.461	0,42
Jubilee CLO BV 0,252 % fällig am 15.12.2029	700	828	0,08
Penta CLO BV 0,790 % fällig am 04.08.2028	840	996	0,10
Tikehau CLO BV 0,600 % fällig am 04.08.2028	1.776	2.107	0,20
		13.274	1,26
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ING Bank NV 2,625 % fällig am 05.12.2022	\$ 700	723	0,07
JT International Financial Services BV 3,500 % fällig am 28.09.2023	200	213	0,02
		936	0,09
Summe Niederlande		14.210	1,35
NEUSEELAND			
STAATSEMISSIONEN			
New Zealand Government International Bond 2,000 % fällig am 20.09.2025 (c)	NZD 8.958	6.946	0,66
3,000 % fällig am 20.09.2030 (c)	1.113	979	0,09
Summe Neuseeland		7.925	0,75
PERU			
STAATSEMISSIONEN			
Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 4.900	1.401	0,13
6,150 % fällig am 12.08.2032	8.300	2.215	0,21
Summe Peru		3.616	0,34
SLOWENIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 600	696	0,06
SPANIEN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	1.179	1.402	0,13
STAATSEMISSIONEN			
Autonomous Community of Catalonia 4,900 % fällig am 15.09.2021	1.100	1.318	0,13
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 31.10.2031	3.500	4.159	0,40
0,700 % fällig am 30.11.2033 (c)	3.868	5.455	0,52
1,400 % fällig am 30.07.2028	6.200	8.049	0,76
1,450 % fällig am 30.04.2029	2.700	3.525	0,33
		22.506	2,14
Summe Spanien		23.908	2,27
SCHWEDEN			
STAATSEMISSIONEN			
Sweden Government International Bond 0,125 % fällig am 01.06.2026 (c)	SEK 42.121	5.364	0,51
1,000 % fällig am 01.06.2025 (c)	18.956	2.451	0,23
Summe Schweden		7.815	0,74
GROSSBRITANNIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
FCE Bank PLC 0,869 % fällig am 13.09.2021	€ 1.300	1.544	0,15
Natwest Group PLC 1,697 % fällig am 25.06.2024	\$ 1.600	1.637	0,15
4,519 % fällig am 25.06.2024	1.000	1.074	0,10
		4.255	0,40

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
NON-AGENCY-MBS				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				US-SCHATZ OblIGATIONEN			
Canada Square Funding PLC 1,149 % fällig am 17.10.2051	£ 2.909	\$ 4.041	0,38	Structured Asset Investment Loan Trust 1,042 % fällig am 25.10.2033	\$ 963	\$ 959	0,09	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c) 0,125 % fällig am			
Canterbury Finance PLC 1,219 % fällig am 16.05.2056	40	55	0,01	Structured Asset Securities Corp. 0,797 % fällig am 25.02.2035	1.487	1.483	0,14	15.04.2022	\$ 40.316	\$ 41.358	3,92
Finsbury Square PLC 1,079 % fällig am 16.09.2069	2.441	3.393	0,32	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 0,512 % fällig am 25.01.2037	1.138	1.141	0,11	0,125 % fällig am 15.07.2022	7.488	7.761	0,74
Great Hall Mortgages PLC 0,210 % fällig am 18.03.2039	55	75	0,01					0,125 % fällig am			
0,230 % fällig am 18.06.2038	225	307	0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				15.01.2023 (e)	80.333	83.943	7,96
Hawksmoor Mortgages PLC 1,099 % fällig am 25.05.2053	3.616	5.021	0,48	Charter Communications Operating LLC 4,464 % fällig am 23.07.2022	100	104	0,01	0,125 % fällig am 15.10.2024	51.718	55.752	5,29
Precise Mortgage Funding PLC 0,980 % fällig am 16.10.2056	564	784	0,07	Duke Energy Corp. 2,400 % fällig am 15.08.2022	100	102	0,01	0,125 % fällig am 15.04.2025	51.649	55.764	5,29
1,249 % fällig am 12.12.2055	900	1.260	0,12	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 01.12.2021	€ 700	830	0,08	0,125 % fällig am 15.10.2025	31.795	34.613	3,28
Towd Point Mortgage Funding PLC 0,949 % fällig am 20.07.2045	1.898	2.631	0,25	GATX Corp. 0,896 % fällig am 05.11.2021	\$ 5.500	5.511	0,52	0,125 % fällig am 15.04.2026	27.212	29.615	2,81
1,249 % fällig am 20.02.2054	829	1.153	0,11	Nissan Motor Acceptance Corp. 2,800 % fällig am 13.01.2022	2.200	2.225	0,21	0,375 % fällig am 15.07.2025	22.945	24.413	2,32
		18.720	1,78	3,450 % fällig am 15.03.2023	100	104	0,01	0,375 % fällig am 15.07.2025	14.861	16.323	1,55
STAATSEMISSIONEN				Oncor Electric Delivery Co. LLC 4,100 % fällig am 01.06.2022	100	102	0,01	0,500 % fällig am 15.04.2024	43.168	46.542	4,42
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026 (c)	27.038	43.184	4,10	Penske Truck Leasing Co. LP 3,375 % fällig am 01.02.2022	600	607	0,06	0,625 % fällig am 15.01.2030	41.093	45.143	4,28
0,125 % fällig am 22.11.2036 (c)	1.736	3.530	0,34	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,750 % fällig am 15.05.2024	200	225	0,02	15.01.2031 (e)	30.255	33.325	3,16
0,125 % fällig am 22.03.2039 (c)	1.014	2.141	0,20					0,375 % fällig am 15.07.2023	22.945	24.413	2,32
0,125 % fällig am 22.11.2056 (c)	39	113	0,01	NON-AGENCY-MBS				0,500 % fällig am 15.04.2024	43.168	46.542	4,42
1,250 % fällig am 22.11.2027 (c)	4.497	8.030	0,76	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 0,732 % fällig am 25.10.2028	12	12	0,00	0,625 % fällig am 15.01.2024	23.026	24.804	2,35
1,875 % fällig am 22.11.2022 (c)	16.975	25.320	2,40	Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,573 % fällig am 19.04.2035	436	428	0,04	0,625 % fällig am 15.01.2026	24.034	26.700	2,53
		82.318	7,81	0,593 % fällig am 19.07.2035	70	68	0,01	0,750 % fällig am 15.02.2045	1.134	1.401	0,13
USA				0,672 % fällig am 25.07.2045	528	521	0,05	1,375 % fällig am 15.02.2044	1.031	1.425	0,14
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				0,732 % fällig am 25.07.2045	110	110	0,01	2,125 % fällig am 15.02.2041	731	1.104	0,11
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.12.2024	30	31	0,00
0,992 % fällig am 25.10.2034	\$ 1.121	1.117	0,11	Ginnie Mae 0,599 % fällig am 20.08.2068	1.566	1.554	0,15				
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,257 % fällig am 25.03.2036	241	240	0,02	0,807 % fällig am 20.08.2066	455	458	0,04				
First Franklin Mortgage Loan Trust 0,752 % fällig am 25.01.2036	4.906	4.869	0,46	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2051	4.912	5.174	0,49				
Fremont Home Loan Trust 0,827 % fällig am 25.07.2035	51	51	0,01	4,000 % fällig am 01.08.2051	40.116	42.755	4,06				
Renaissance Home Equity Loan Trust 1,032 % fällig am 25.05.2034	2.377	2.348	0,22								
Residential Asset Mortgage Products Trust 0,872 % fällig am 25.11.2035	1.290	1.289	0,12								
						49.941	4,74				
USA				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				ARGENTINA TREASURY BILLS			
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				Ginnie Mae 0,599 % fällig am 20.08.2068	1.566	1.554	0,15	38,001 % fällig am			
0,992 % fällig am 25.10.2034	\$ 1.121	1.117	0,11	0,807 % fällig am 20.08.2066	455	458	0,04	30.07.2021 (a)(b)	ARS 8.197	47	0,01
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,257 % fällig am 25.03.2036	241	240	0,02	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2051	4.912	5.174	0,49	Summe kurzfristige Instrumente		47	0,01
First Franklin Mortgage Loan Trust 0,752 % fällig am 25.01.2036	4.906	4.869	0,46	4,000 % fällig am 01.08.2051	40.116	42.755	4,06	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.246.640	118,27	
Fremont Home Loan Trust 0,827 % fällig am 25.07.2035	51	51	0,01								
Renaissance Home Equity Loan Trust 1,032 % fällig am 25.05.2034	2.377	2.348	0,22								
Residential Asset Mortgage Products Trust 0,872 % fällig am 25.11.2035	1.290	1.289	0,12								
USA				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				AKTIEN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				INVESTMENTFONDS			
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				Ginnie Mae 0,599 % fällig am 20.08.2068	1.566	1.554	0,15	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
0,992 % fällig am 25.10.2034	\$ 1.121	1.117	0,11	0,807 % fällig am 20.08.2066	455	458	0,04	PIMCO Select Funds plc –			
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,257 % fällig am 25.03.2036	241	240	0,02	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2051	4.912	5.174	0,49	PIMCO US Dollar			
First Franklin Mortgage Loan Trust 0,752 % fällig am 25.01.2036	4.906	4.869	0,46	4,000 % fällig am 01.08.2051	40.116	42.755	4,06	Short-Term Floating			
Fremont Home Loan Trust 0,827 % fällig am 25.07.2035	51	51	0,01					NAV Fund (d)			
Renaissance Home Equity Loan Trust 1,032 % fällig am 25.05.2034	2.377	2.348	0,22					2.014.047	20.062	1,90	
Residential Asset Mortgage Products Trust 0,872 % fällig am 25.11.2035	1.290	1.289	0,12					Summe Investmentfonds	\$ 20.062	1,90	

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	16	\$ (3)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	56	1	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 171,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	08.2021	54	4	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2021	83	(16)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2021	187	87	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	6	(1)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	153	(149)	(0,01)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	2	0	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	876	36	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	15	11	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	56	6	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 171,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	08.2021	54	9	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2021	97	13	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	1.372	(38)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	355	(561)	(0,05)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	22	(60)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	123	\$ (574)	(0,06)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	12	(5)	0,00
				\$ (1.240)	(0,12)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (1.240)	(0,12)

(1) Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.06.2022	\$ 100	\$ (7)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	500	37	0,01
Simon Property Group LP	1,000	20.06.2022	4.000	28	0,00
				\$ 58	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2051	£ 2.800	\$ (15)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 23.400	(34)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,005	15.02.2025	18.100	343	0,03
Zahlung	CPTFEMU	1,355	15.02.2050	1.200	(190)	(0,02)
Zahlung	CPTFEMU	1,375	15.02.2040	1.600	(105)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	4.800	46	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	800	128	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,690	07.08.2021	\$ 18.300	(721)	(0,07)
Erhalt	CPURNSA	1,794	24.08.2027	6.700	517	0,05
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	3.400	261	0,02
Zahlung	CPURNSA	1,840	14.08.2021	9.000	(339)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA	1,883	20.11.2029	7.400	(517)	(0,05)
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	6.500	452	0,04
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	4.700	(278)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	4.300	(227)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,210	05.02.2023	17.550	261	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,220	13.04.2023	7.440	90	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,263	27.04.2023	60	1	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,263	09.05.2023	5.230	53	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,281	10.05.2023	6.064	45	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,311	24.02.2031	6.600	197	0,02
Zahlung	CPURNSA	2,335	05.02.2028	6.110	(86)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	960	(7)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	7.960	(51)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	1.900	(9)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,419	05.03.2026	400	9	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,690	01.06.2026	1.300	2	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	2.450	4	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	3.500	(2)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	1.600	(5)	0,00
Zahlung	FRCPXTOB	1,280	15.11.2034	€ 1.700	(64)	(0,01)
Zahlung	FRCPXTOB	1,410	15.11.2039	2.000	(98)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,324	15.08.2025	£ 21.100	(523)	(0,05)
Zahlung	UKRPI	3,330	15.01.2025	400	2	0,00
Zahlung	UKRPI	3,346	15.05.2030	550	(16)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,530	15.10.2031	10.760	267	0,03
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	900	(20)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,580	15.03.2036	2.600	(30)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,750	15.04.2031	1.930	(5)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,850	15.09.2024	4.700	269	0,03
					\$ (395)	(0,04)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (337)	(0,03)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,195 %	02.11.2022	2.200	\$ 2	\$ 323	0,03
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	2.590	197	380	0,04
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	1.400	157	291	0,03
BRC	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	1.410	105	207	0,02
JPM	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	1.800	198	375	0,03
MYC	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,007	24.08.2021	33.400	120	14	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	2.100	153	311	0,03
							\$ 932	\$ 1.901	0,18

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	400	\$ 2	\$ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,156	05.08.2021	300	3	1	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	300	3	1	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	550	3	2	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,641	07.07.2021	400	2	0	0,00
					\$ 13	\$ 4	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.08.2021	1.500	\$ (2)	\$ 0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.300	(1)	0	0,00
BPS	Put – OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	300	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	1.200	(1)	0	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	2.700	(4)	(1)	0,00
	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	1.600	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.600	(2)	(1)	0,00
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	1.700	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.700	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	8.400	(9)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	800	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	5.100	(7)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	6.800	(8)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.200	(1)	0	0,00
CBK	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.200	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	2.100	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.400	(2)	0	0,00
	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	1.700	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.700	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	5.100	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.300	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.300	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	7.500	(10)	(3)	0,00
	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	800	(1)	(1)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	6.900	(7)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	2.300	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	3.200	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	11.900	(15)	(1)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.500	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.200	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.200	(1)	0	0,00
MYC	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	300	(1)	0	0,00
						\$ (103)	\$ (21)	0,00

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.500	\$ (68)	\$ (1)	0,00
JPM	Cap - OTC CPURNSA	100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	100	(1)	0	0,00
	Cap - OTC CPURNSA	233,916	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	22.04.2024	1.000	(7)	0	0,00
						\$ (76)	\$ (1)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000 %	02.11.2022	6.600	\$ 0	\$ (296)	(0,03)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	7.740	(192)	(349)	(0,03)
BRC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	4.200	(154)	(286)	(0,03)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	4.160	(102)	(187)	(0,02)
DUB	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	8.530	(58)	(5)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	46.800	(73)	(22)	0,00
JPM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	5.400	(194)	(367)	(0,03)
MYC	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,006	24.08.2021	66.800	(105)	(6)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	600	(5)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	11.270	(80)	(7)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	6.400	(155)	(287)	(0,03)
							\$ (1.119)	\$ (1.812)	(0,17)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	700	\$ (3)	\$ (1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	05.08.2021	600	(2)	(1)	0,00
JPM	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,797	05.08.2021	600	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	12.08.2021	1.000	(3)	(2)	0,00
SAL	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	900	(3)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	600	(4)	(1)	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	600	(4)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,313	07.09.2021	300	(1)	(1)	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,047	07.07.2021	200	(1)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	104,047	07.07.2021	200	0	0	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	400	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	1.100	(3)	(2)	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	400	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	300	(1)	0	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,695	07.09.2021	300	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	300	(1)	(1)	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,375	07.07.2021	300	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,547	07.07.2021	500	(2)	0	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,609	07.07.2021	1.200	(5)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,672	07.07.2021	500	(2)	0	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	100,219	07.07.2021	400	(2)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,203	07.07.2021	1.300	(5)	(2)	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,219	07.07.2021	400	(2)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,375	07.07.2021	300	(1)	0	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,422	07.07.2021	400	(2)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,547	07.07.2021	200	0	0	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,641	07.07.2021	800	(2)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,645	07.07.2021	800	(3)	0	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,766	07.07.2021	400	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,172	05.08.2021	1.000	(6)	(2)	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,188	05.08.2021	500	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,406	05.08.2021	1.800	(8)	(3)	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,688	05.08.2021	800	(2)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,938	05.08.2021	300	(1)	(1)	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,188	05.08.2021	500	(1)	(2)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,406	05.08.2021	1.800	(4)	(5)	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,281	07.09.2021	800	(4)	(3)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,281	07.09.2021	1.400	(4)	(6)	(0,01)
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,297	07.09.2021	500	(2)	(2)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,328	07.09.2021	1.300	(4)	(5)	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,164	07.07.2021	450	(2)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,211	07.07.2021	450	(2)	0	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,375	07.07.2021	500	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,703	05.08.2021	500	(1)	0	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,801	05.08.2021	400	(2)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,078	05.08.2021	600	(3)	(1)	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,344	05.08.2021	500	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,586	05.08.2021	400	(1)	(1)	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,609	05.08.2021	800	(2)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	101,844	07.09.2021	400	(1)	(1)	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	103,844	07.09.2021	400	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,258	05.08.2021	400	(1)	(1)	0,00
					\$ (116)	\$ (56)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 600	\$ (40)	\$ 46	\$ 6	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.400	(3)	16	13	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	900	(80)	90	10	0,00
					\$ (123)	\$ 152	\$ 29	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	DKK 123.281	\$ 19.618	\$ 0	(42)	(42)	0,00	
	07.2021	NOK 31.975	3.730	14	0	14	0,00	
	07.2021	\$ 728	DKK 4.580	3	0	3	0,00	
	08.2021	3.730	NOK 31.975	0	(14)	(14)	0,00	
	09.2021	120	CNY 770	0	(1)	(1)	0,00	
BPS	07.2021	AUD 7.034	\$ 5.467	186	0	186	0,02	
	07.2021	DKK 24.855	4.024	60	0	60	0,01	
	07.2021	\$ 1.791	CAD 2.157	0	(49)	(49)	0,00	
	07.2021	2.360	DKK 14.760	0	(6)	(6)	0,00	
	07.2021	1.282	£ 923	0	(7)	(7)	0,00	
	07.2021	8.052	NZD 11.508	0	(10)	(10)	0,00	
	08.2021	NZD 11.508	\$ 8.051	10	0	10	0,00	
	08.2021	\$ 3.841	CNH 25.355	75	0	75	0,01	
	11.2021	123	MXN 2.493	0	0	0	0,00	
	07.2021	SEK 33.865	\$ 4.085	125	0	125	0,01	
BRC	07.2021	AUD 2.418	1.870	55	0	55	0,01	
	07.2021	DKK 95.589	15.159	0	(85)	(85)	(0,01)	
CBK	07.2021	¥ 199.200	1.817	22	0	22	0,00	
	07.2021	PEN 18.501	5.037	200	0	200	0,02	
	07.2021	\$ 1.156	DKK 7.270	4	0	4	0,00	
	07.2021	3.828	NOK 31.975	0	(112)	(112)	(0,01)	
	11.2021	PEN 3.429	\$ 905	8	0	8	0,00	
	12.2021	\$ 1.012	PEN 3.719	0	(39)	(39)	0,00	
	GLM	07.2021	DKK 15.185	\$ 2.461	40	0	40	0,00
		07.2021	£ 73.947	104.541	2.387	0	2.387	0,23
	07.2021	\$ 1	RUB 56	0	0	0	0,00	
	09.2021	1	56	0	0	0	0,00	
HUS	07.2021	€ 14.120	\$ 16.988	243	0	243	0,02	
	07.2021	\$ 1.143	€ 943	0	(25)	(25)	0,00	
	07.2021	101.067	£ 73.021	0	(192)	(192)	(0,02)	
JPM	08.2021	£ 73.021	\$ 101.075	191	0	191	0,02	
	07.2021	DKK 154.808	24.682	86	(92)	(6)	0,00	
	07.2021	NZD 11.508	8.398	357	0	357	0,03	
	07.2021	\$ 21.142	DKK 131.552	0	(162)	(162)	(0,02)	
	07.2021	1.026	€ 847	0	(22)	(22)	0,00	
MYI	09.2021	3.890	IDR 56.072.439	0	(68)	(68)	(0,01)	
	10.2021	DKK 124.107	\$ 19.956	129	0	129	0,01	
	07.2021	€ 1.465	1.745	8	0	8	0,00	
	07.2021	£ 699	971	5	0	5	0,00	
	07.2021	\$ 23.629	DKK 147.127	0	(165)	(165)	(0,02)	
SCX	07.2021	923	£ 667	0	(1)	(1)	0,00	
	10.2021	DKK 147.127	\$ 23.670	165	0	165	0,02	
	04.2022	24.500	3.951	21	0	21	0,00	
	07.2021	67.995	11.029	185	0	185	0,02	
	07.2021	€ 215.126	263.175	8.057	0	8.057	0,76	
SOG	07.2021	¥ 4.888.600	44.697	652	0	652	0,06	
	07.2021	\$ 28.121	DKK 175.106	0	(196)	(196)	(0,02)	
UAG	10.2021	DKK 175.106	\$ 28.169	195	0	195	0,02	
	07.2021	\$ 4.828	AUD 6.365	0	(50)	(50)	0,00	
	08.2021	AUD 6.365	\$ 4.829	50	0	50	0,00	
				\$ 13.533	\$ (1.338)	\$ 12.195	1,16	

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 11.835	CHF 10.617	\$ 0	\$ (350)	\$ (350)	(0,03)
BRC	07.2021	226	203	0	(6)	(6)	0,00
CBK	07.2021	CHF 10.643	\$ 11.561	47	0	47	0,00
	07.2021	\$ 11.656	CHF 10.451	0	(350)	(350)	(0,03)
	08.2021	11.570	10.643	0	(47)	(47)	(0,01)
GLM	07.2021	CHF 3	\$ 4	0	0	0	0,00
MYI	07.2021	\$ 11.357	CHF 10.233	0	(286)	(286)	(0,03)
SCX	07.2021	CHF 117	\$ 128	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 49	CHF 44	0	(1)	(1)	0,00
SSB	07.2021	CHF 2	\$ 2	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 557	CHF 510	0	(5)	(5)	0,00
				\$ 48	\$ (1.045)	\$ (997)	(0,10)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 1.785	€ 1.474	\$ 0	\$ (37)	\$ (37)	0,00
BPS	07.2021	€ 13.114	\$ 15.811	258	0	258	0,02
	07.2021	\$ 209.553	€ 171.346	0	(6.354)	(6.354)	(0,60)
BRC	07.2021	1.488	1.221	0	(39)	(39)	(0,01)
GLM	07.2021	954	787	0	(21)	(21)	0,00
HUS	07.2021	44.249	37.062	0	(297)	(297)	(0,03)
MYI	07.2021	1.288	1.082	0	(5)	(5)	0,00
SCX	07.2021	242.048	197.857	0	(7.409)	(7.409)	(0,70)
TOR	07.2021	241.357	197.289	0	(7.392)	(7.392)	(0,70)
UAG	07.2021	938	771	0	(23)	(23)	0,00
				\$ 258	\$ (21.577)	\$ (21.319)	(2,02)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 22	\$ 30	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2021	\$ 14.014	£ 10.021	0	(171)	(171)	(0,01)
BRC	07.2021	£ 53	\$ 74	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 65	£ 47	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2021	45.079	31.887	0	(1.029)	(1.029)	(0,10)
HUS	07.2021	£ 37.150	\$ 51.418	97	0	97	0,01
	07.2021	\$ 20	£ 14	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	51.422	37.150	0	(97)	(97)	(0,01)
MYI	07.2021	£ 14	\$ 19	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 403	£ 290	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2021	45.374	31.920	0	(1.279)	(1.279)	(0,12)
SSB	07.2021	£ 37.150	\$ 51.338	18	0	18	0,00
	07.2021	\$ 130	£ 93	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	51.342	37.150	0	(17)	(17)	0,00
UAG	07.2021	45.179	31.887	0	(1.129)	(1.129)	(0,11)
				\$ 118	\$ (3.728)	\$ (3.610)	(0,34)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (13.687) (1,30)

Summe Anlagen

\$ 1.251.438 118,72

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (197.360) (18,72)

Nettovermögen

\$ 1.054.078 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 180.165 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 1.433 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 8.699 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 13.830 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.246.640	\$ 0	\$ 1.246.640
Investmentfonds	20.062	0	0	20.062
Finanzderivate ⁽³⁾	(19)	(15.245)	0	(15.264)
Summen	\$ 20.043	\$ 1.231.395	\$ 0	\$ 1.251.438

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.119.289	\$ 0	\$ 1.119.289
Investmentfonds	41.757	0	0	41.757
Pensionsgeschäfte	0	1.551	0	1.551
Finanzderivate ⁽³⁾	(205)	5.492	(1)	5.286
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(1.840)	0	(1.840)
Summen	\$ 41.552	\$ 1.124.492	\$ (1)	\$ 1.166.043

⁽¹⁾ 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.

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BRC	0,040 %	18.06.2021	02.07.2021	\$ (18.664)	\$ (18.665)	(1,77)
	0,060	11.05.2021	08.07.2021	(160.096)	(160.109)	(15,19)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (178.774)	(16,96)

⁽¹⁾ In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 2 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (427)	\$ 620	\$ 193
BPS	(5.945)	5.220	(725)
BRC	92	(270)	(178)
CBK	(297)	270	(27)
DUB	(11)	(20)	(31)
FAR	(3)	0	(3)
FBF	(4)	0	(4)
GLM	1.354	(1.270)	84
GST	5	0	5
HUS	(81)	0	(81)
JPM	230	0	230
MYC	25	(170)	(145)
MYI	(261)	190	(71)
SAL	(30)	0	(30)
SCX	206	0	206
SOG	(1)	0	(1)
SSB	(5)	0	(5)
TOR	(7.392)	6.500	(892)
UAG	(1.142)	1.030	(112)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	101,11	113,29
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	15,94	27,56
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,22	1,21
Investmentfonds	1,90	5,30
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,20
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,12)	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	0,18
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,30)	0,52
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,23)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(16,96)	(35,51)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Argentinien	k. A.	0,01
Australien	1,16	1,65
Kanada	0,24	0,52
Cayman Inseln	0,23	0,03
Dänemark	7,19	5,92
Frankreich	10,05	13,08
Deutschland	0,30	0,40
Guernsey, Kanalinseln	0,06	0,08
Irland	1,36	2,75
Italien	10,11	10,92
Japan	4,95	3,50
Luxemburg	0,01	0,01
Multinational	k. A.	0,06
Niederlande	1,35	2,34
Neuseeland	0,75	0,13
Peru	0,34	0,57
Katar	k. A.	0,23
Slowenien	0,06	0,08
Spanien	2,27	3,88
Schweden	0,74	1,03
Großbritannien	9,99	10,68
USA	67,10	82,50
Kurzfristige Instrumente	0,01	1,69
Investmentfonds	1,90	5,30
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,20
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,12)	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,02)
Zinsswaps	(0,04)	0,19
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	0,18	0,13
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Inflation-Capped Options	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,17)	(0,12)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	1,16	(1,20)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,46)	1,72
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,23)
Sonstige Aktiva und Passiva	(18,72)	(48,00)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
AUSTRALIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Australia Government International Bond			
0,750 % fällig am 21.11.2027 (d) AUD	17.386	\$ 14.463	0,45
1,250 % fällig am 21.02.2022 (d)	28.602	21.871	0,68
2,000 % fällig am 21.08.2035 (d)	4.372	4.318	0,13
3,000 % fällig am 20.09.2025 (d)	26.362	23.352	0,72
Summe Australien		64.004	1,98
BRASILIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Petrobras Global Finance BV			
6,250 % fällig am 14.12.2026	£ 100	159	0,00
KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
TransCanada PipeLines Ltd.			
3,750 % fällig am 16.10.2023	\$ 100	107	0,00
STAATSEMISSIONEN			
Canadian Government Real Return Bond			
0,500 % fällig am 01.12.2050 (d) CAD	8.311	7.459	0,23
1,250 % fällig am 01.12.2047 (d)	10.559	10.989	0,34
1,500 % fällig am 01.12.2044 (d)	7.329	7.777	0,24
3,000 % fällig am 01.12.2036 (d)	3.814	4.577	0,14
4,000 % fällig am 01.12.2031 (d)	11.513	13.641	0,43
4,250 % fällig am 01.12.2021 (d)	25.750	21.356	0,66
		65.799	2,04
Summe Kanada		65.906	2,04
CAYMAN INSELN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Catamaran CLO Ltd.			
1,444 % fällig am 22.04.2030	\$ 7.362	7.367	0,23
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.			
1,253 % fällig am 15.09.2037	10.500	10.505	0,33
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.			
1,108 % fällig am 20.04.2027	112	112	0,00
ICG U.S. CLO Ltd.			
1,584 % fällig am 22.10.2031	1.400	1.403	0,05
OCP CLO Ltd.			
0,984 % fällig am 15.07.2027	39	39	0,00
OZLM Ltd.			
1,186 % fällig am 16.05.2030	6.100	6.098	0,19
Shackleton CLO Ltd.			
1,318 % fällig am 20.10.2028	1.994	1.996	0,06
Starwood Commercial Mortgage Trust			
1,204 % fällig am 15.07.2038	5.200	5.202	0,16
Venture CLO Ltd.			
1,064 % fällig am 15.07.2027	1.018	1.020	0,03
1,129 % fällig am 07.09.2030	1.200	1.199	0,04
1,288 % fällig am 20.01.2029	3.200	3.203	0,10
Wind River CLO Ltd.			
1,054 % fällig am 15.10.2027	59	59	0,00
		38.203	1,19
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Avolon Holdings Funding Ltd.			
5,500 % fällig am 15.01.2023	58	62	0,00
Park Aerospace Holdings Ltd.			
5,250 % fällig am 15.08.2022	41	43	0,00
		105	0,00
Summe Cayman Inseln		38.308	1,19
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Jyske Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 30.805	4.733	0,15
1,000 % fällig am 01.10.2053	141.913	21.434	0,66
1,500 % fällig am 01.10.2050	4.611	733	0,02
1,500 % fällig am 01.10.2053	3.600	571	0,02
2,500 % fällig am 01.10.2047	5	1	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK 31.237	\$ 4.745	0,15
1,000 % fällig am 01.10.2050	13.537	2.082	0,06
1,500 % fällig am 01.10.2053	28.500	4.483	0,14
2,500 % fällig am 01.10.2047	21	4	0,00
Nykredit Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	491.337	74.760	2,32
1,000 % fällig am 01.10.2053	227.149	34.211	1,06
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	162.300	25.523	0,79
2,500 % fällig am 01.10.2047	5	1	0,00
Realkredit Danmark A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2053	54.157	8.144	0,25
1,500 % fällig am 01.10.2050	54.700	8.694	0,27
1,500 % fällig am 01.10.2053	85.700	13.452	0,42
2,500 % fällig am 01.04.2047	11	2	0,00
		203.573	6,31
STAATSEMISSIONEN			
Denmark Government International Bond			
0,100 % fällig am 15.11.2023 (d)	97.743	16.226	0,50
Summe Dänemark		219.799	6,81
FRANKREICH			
STAATSEMISSIONEN			
France Government International Bond			
0,100 % fällig am 01.03.2025 (d)	€ 30.351	38.312	1,19
0,100 % fällig am 01.03.2026 (d)	45.253	58.392	1,81
0,100 % fällig am 01.03.2028 (d)	35.916	47.305	1,47
0,100 % fällig am 01.03.2029 (d)	29.306	39.264	1,22
0,100 % fällig am 25.07.2036 (d)	21.488	30.446	0,94
0,250 % fällig am 25.07.2024 (d)	47.737	60.507	1,88
0,700 % fällig am 25.07.2030 (d)	59.710	85.593	2,65
0,750 % fällig am 25.05.2052	2.700	3.062	0,10
1,100 % fällig am 25.07.2022 (d)	8.488	10.434	0,32
1,800 % fällig am 25.07.2040 (d)	1.110	2.091	0,06
1,850 % fällig am 25.07.2027 (d)	12.064	17.559	0,54
Summe Frankreich		392.965	12,18
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Deutsche Bank AG			
4,250 % fällig am 14.10.2021	\$ 12.100	12.232	0,38
STAATSEMISSIONEN			
Bundesrepublik Deutschland			
0,100 % fällig am 15.04.2046 (d)	€ 3	5	0,00
Summe Deutschland		12.237	0,38
GUERNSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.			
3,800 % fällig am 15.09.2022	\$ 2.400	2.498	0,08
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Adagio CLO DAC			
0,720 % fällig am 15.10.2031	€ 1.700	2.014	0,06
Arbour CLO DAC			
0,580 % fällig am 15.03.2029	993	1.178	0,04
Ares European CLO DAC			
0,660 % fällig am 15.10.2030	7.400	8.770	0,27
0,780 % fällig am 15.10.2031	2.200	2.609	0,08
Armada Euro CLO DAC			
0,720 % fällig am 15.07.2031	4.400	5.208	0,16
Aurium CLO DAC			
0,680 % fällig am 13.10.2029	1.335	1.584	0,05
Carlyle Euro CLO DAC			
0,700 % fällig am 15.01.2031	2.500	2.965	0,09
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC			
0,700 % fällig am 15.01.2031	1.600	1.897	0,06
0,730 % fällig am 21.09.2029	417	495	0,02
CVC Cordatus Loan Fund DAC			
0,630 % fällig am 15.09.2031	2.800	3.308	0,10
Dryden Euro CLO BV			
0,860 % fällig am 15.05.2034 (a)	2.500	2.965	0,09

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Harvest CLO DAC			
0,630 % fällig am 18.11.2029	€ 2.909	\$ 3.456	0,11
0,760 % fällig am 15.07.2031	7.400	8.802	0,27
0,960 % fällig am 20.10.2031	2.200	2.606	0,08
1,040 % fällig am 15.07.2031	1.000	1.188	0,04
Laurelin DAC			
0,720 % fällig am 20.10.2031	3.800	4.502	0,14
Man GLG Euro CLO DAC			
0,680 % fällig am 15.10.2030	3.600	4.276	0,13
0,870 % fällig am 15.01.2030	900	1.067	0,03
OAK Hill European Credit Partners DAC			
0,740 % fällig am 20.10.2031	1.900	2.250	0,07
Palmer Square European Loan Funding DAC			
0,870 % fällig am 15.02.2030	3.672	4.361	0,14
Purple Finance CLO DAC			
0,800 % fällig am 25.01.2031	1.700	2.019	0,06
Segovia European CLO DAC			
0,770 % fällig am 18.01.2031	1.000	1.184	0,04
0,880 % fällig am 20.07.2032 (a)	6.400	7.590	0,24
Tymon Park CLO DAC			
0,590 % fällig am 21.01.2029	600	712	0,02
		77.006	2,39
NON-AGENCY-MBS			
European Loan Conduit			
1,000 % fällig am 17.02.2030	2.497	2.975	0,09
Summe Irland		79.981	2,48
ITALIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			
0,100 % fällig am 15.05.2023 (d)	11.657	14.176	0,44
0,400 % fällig am 15.05.2030 (d)	146.005	187.080	5,80
0,450 % fällig am 22.05.2023 (d)	15.880	19.325	0,60
1,250 % fällig am 15.09.2032 (d)	8.083	11.341	0,35
1,400 % fällig am 26.05.2025 (d)	61.665	79.028	2,45
2,550 % fällig am 15.09.2041 (d)	14.806	26.088	0,81
Summe Italien		337.038	10,45
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
NTT Finance Corp.			
1,900 % fällig am 21.07.2021	\$ 200	200	0,01
Toyota Tsusho Corp.			
3,625 % fällig am 13.09.2023	800	852	0,02
		1.052	0,03
STAATSEMISSIONEN			
Japan Government International Bond			
0,005 % fällig am 10.03.2031 (d)	¥1.638.019	15.098	0,47
0,100 % fällig am 10.03.2026 (d)	3.623.836	33.352	1,03
0,100 % fällig am 10.03.2027 (d)	590.463	5.448	0,17
0,100 % fällig am 10.03.2028 (d)	4.581.597	42.353	1,31
0,100 % fällig am 10.03.2029 (d)	4.517.883	41.865	1,30
0,200 % fällig am 10.03.2030 (d)	159.061	1.500	0,05
		139.616	4,33
Summe Japan		140.668	4,36
LUXEMBURG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
SES S.A.			
3,600 % fällig am 04.04.2023	\$ 500	523	0,02
MULTINATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
NXP BV			
3,875 % fällig am 01.09.2022	200	208	0,00
4,625 % fällig am 01.06.2023	200	215	0,01
Summe multinational		423	0,01
NIEDERLANDE			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Babson Euro CLO BV			
0,281 % fällig am 25.10.2029	€ 133	158	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Real Return Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Beschreibung				GROSSBRITANNIEN				Beschreibung			
Barings Euro CLO BV				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Carrington Mortgage Loan Trust			
0,680 % fällig am 27.07.2030	€ 442	\$ 525	0,02	FCE Bank PLC				0,342 % fällig am 25.04.2036	\$12.546	\$ 11.165	0,35
Cairn CLO BV				0,869 % fällig am 13.09.2021	€ 2.100	\$ 2.494	0,08	CIT Mortgage Loan Trust			
0,600 % fällig am 30.04.2031	3.500	4.141	0,13	Natwest Group PLC				1,442 % fällig am 25.10.2037	440	444	0,01
0,650 % fällig am 20.10.2028	2.370	2.817	0,09	1,697 % fällig am 25.06.2024	\$ 2.200	2.251	0,07	Citigroup Mortgage Loan Trust			
0,780 % fällig am 15.10.2031	4.500	5.337	0,17	4,519 % fällig am 25.06.2024	1.400	1.504	0,04	0,382 % fällig am 25.09.2036	732	709	0,02
Contego CLO BV				8,625 % fällig am 15.08.2021 (e)(g)	200	202	0,01	Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates			
0,369 % fällig am 15.11.2026	1.781	2.111	0,07	NatWest Markets PLC				1,037 % fällig am 25.10.2034	1.420	1.416	0,05
Dryden Euro CLO BV				0,362 % fällig am 27.09.2021	€ 400	475	0,01	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
0,660 % fällig am 15.04.2033	4.200	4.963	0,15			6.926	0,21	0,497 % fällig am 25.08.2036	744	742	0,02
Euro-Galaxy CLO DAC								0,782 % fällig am 25.10.2035 ^	3.100	3.006	0,09
0,620 % fällig am 24.04.2034	5.600	6.633	0,21	NON-AGENCY-MBS				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
Grosvenor Place CLO BV				Canada Square Funding PLC				0,887 % fällig am 25.02.2036	551	551	0,02
0,720 % fällig am 30.10.2029	1.925	2.285	0,07	1,149 % fällig am 17.10.2051	£ 5.534	7.687	0,24	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
Jubilee CLO BV				Finsbury Square PLC				0,712 % fällig am 25.01.2032	2	2	0,00
0,252 % fällig am 15.12.2029	750	886	0,03	1,079 % fällig am 16.09.2069	4.488	6.238	0,20	Ellington Loan Acquisition Trust			
0,600 % fällig am 15.04.2030	600	710	0,02	Great Hall Mortgages PLC				1,192 % fällig am 25.05.2037	1.080	1.083	0,03
0,650 % fällig am 15.04.2031	1.700	2.012	0,06	0,210 % fällig am 18.03.2039	73	100	0,00	Encore Credit Receivables Trust			
Segovia European CLO				0,230 % fällig am 18.06.2038	64	88	0,00	0,992 % fällig am 25.01.2036	1.400	1.383	0,04
0,870 % fällig am 15.04.2030	1.900	2.256	0,07	Hawksmoor Mortgages PLC				First Franklin Mortgage Loan Trust			
Tikehau CLO BV				1,099 % fällig am 25.05.2053	9.826	13.643	0,42	0,402 % fällig am 25.07.2036	1.402	1.379	0,04
0,600 % fällig am 04.08.2028	672	797	0,02	Precise Mortgage Funding PLC				0,962 % fällig am 25.09.2035	2.868	2.866	0,09
		35.631	1,11	1,249 % fällig am 12.12.2055	3.100	4.342	0,14	Home Equity Asset Trust			
				Towd Point Mortgage Funding PLC				0,947 % fällig am 25.08.2034	77	77	0,00
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,111 % fällig am 20.10.2051	5.170	7.181	0,22	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
ING Bank NV				Twin Bridges PLC				0,732 % fällig am 25.03.2036	4.645	4.600	0,14
2,625 % fällig am 05.12.2022	\$ 3.200	3.307	0,10	1,199 % fällig am 12.06.2053	6.461	8.991	0,28	HSI Asset Securitization Corp. Trust			
JT International Financial Services BV						48.270	1,50	0,252 % fällig am 25.05.2037	625	618	0,02
3,500 % fällig am 28.09.2023	2.700	2.877	0,09	STAATSEMISSIONEN				Massachusetts Educational Financing Authority			
		6.184	0,19	United Kingdom Gilt				1,126 % fällig am 25.04.2038	65	65	0,00
Summe Niederlande		41.815	1,30	0,125 % fällig am 10.08.2028 (d)	25.975	44.264	1,37	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
NEUSEELAND				0,125 % fällig am 22.03.2029 (d)	12.296	21.182	0,66	0,752 % fällig am 25.01.2035	1.867	1.864	0,06
STAATSEMISSIONEN				0,125 % fällig am 22.11.2036 (d)	7.975	16.217	0,50	New Century Home Equity Loan Trust			
New Zealand Government International Bond				0,125 % fällig am 22.03.2039 (d)	11.968	25.264	0,78	0,812 % fällig am 25.10.2035	1.450	1.440	0,05
2,000 % fällig am 20.09.2025 (d) NZD60.377	46.820	1.45		0,125 % fällig am 10.08.2041 (d)	17.106	37.935	1,18	0,857 % fällig am 25.02.2035	2.572	2.544	0,08
3,000 % fällig am 20.09.2030 (d)	47	41	0,00	0,125 % fällig am 22.03.2044 (d)	1	3	0,00	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
Summe Neuseeland		46.861	1,45	0,125 % fällig am 10.08.2048 (d)	10.876	27.367	0,85	0,527 % fällig am 25.03.2036	1.476	1.461	0,05
PERU				0,125 % fällig am 22.03.2051 (d)	19.637	51.457	1,60	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
STAATSEMISSIONEN				0,125 % fällig am 22.11.2056 (d)	8.918	26.092	0,81	0,887 % fällig am 25.07.2035	132	132	0,01
Peru Government International Bond				0,125 % fällig am 22.11.2065 (d)	11.266	40.036	1,24	Saxon Asset Securities Trust			
5,940 % fällig am 12.02.2029 PEN 7.900	2.258	0,07		0,125 % fällig am 22.03.2068 (d)	4.339	16.643	0,52	0,402 % fällig am 25.09.2037	1.349	1.329	0,04
6,150 % fällig am 12.08.2032	17.100	4.564	0,14	0,250 % fällig am 22.03.2052 (d)	8.489	23.397	0,73	0,812 % fällig am 25.05.2035	4.544	4.491	0,14
Summe Peru		6.822	0,21	0,375 % fällig am 22.03.2062 (d)	29.250	101.719	3,15	SLM Student Loan Trust			
SLOWENIEN				0,500 % fällig am 22.03.2050 (d)	15.485	43.239	1,34	1,676 % fällig am 25.04.2023	111	112	0,00
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,625 % fällig am 22.03.2040 (d)	7.450	17.296	0,54				
Nova Ljubljanska Banka d.d.				0,625 % fällig am 22.11.2042 (d)	3.684	9.060	0,28				
3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 1.100	1.275	0,04	0,625 % fällig am 22.10.2050	31.100	36.511	1,13				
SPANIEN				0,750 % fällig am 22.11.2047 (d)	9.387	26.208	0,81	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				1,250 % fällig am 22.11.2027 (d)	11.008	19.654	0,61	Ally Financial, Inc.			
BBVA Consumer Auto				1,250 % fällig am 22.11.2032 (d)	94.412	197.121	6,11	4,125 % fällig am 13.02.2022	200	204	0,01
0,270 % fällig am 20.07.2031	2.469	2.938	0,09	1,250 % fällig am 22.11.2055 (d)	19.389	70.957	2,20	Charter Communications Operating LLC			
STAATSEMISSIONEN				4,125 % fällig am 22.07.2030	854	2.023	0,06	4,464 % fällig am 23.07.2022	1.100	1.139	0,04
Spain Government International Bond				4,250 % fällig am 07.12.2055	2.200	5.647	0,17	CVS Health Corp.			
0,150 % fällig am 30.11.2023 (d)	17.356	21.559	0,67			859.292	26,64	3,700 % fällig am 09.03.2023	14	15	0,00
0,500 % fällig am 31.10.2031	3.000	3.565	0,11	Summe Großbritannien		914.488	28,35	Duke Energy Corp.			
0,700 % fällig am 30.11.2033 (d)	15.370	21.672	0,67	USA				2,400 % fällig am 15.08.2022	100	102	0,00
1,000 % fällig am 30.11.2030 (d)	2.403	3.418	0,11	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Energy Transfer LP			
1,450 % fällig am 31.10.2027	13.400	17.391	0,54	Accredited Mortgage Loan Trust				3,600 % fällig am 01.02.2023	100	104	0,00
1,450 % fällig am 30.04.2029	5.700	7.441	0,23	0,352 % fällig am 25.09.2036	\$ 3.275	3.229	0,10	4,250 % fällig am 15.03.2023	100	105	0,00
Summe Spanien		77.984	2,42	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				Eversource Energy			
SCHWEDEN				1,142 % fällig am 25.12.2033	1.659	1.654	0,05	2,900 % fällig am 01.10.2024	100	106	0,00
STAATSEMISSIONEN				Aegis Asset-Backed Securities Trust				Ford Motor Credit Co. LLC			
Sweden Government International Bond				0,752 % fällig am 25.06.2035	53	53	0,00	3,550 % fällig am 07.10.2022	2.100	2.159	0,07
0,125 % fällig am 01.06.2026 (d) SEK97.954	12.475	0,39		AMRESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust				Lehman Brothers Holdings, Inc.			
0,125 % fällig am 01.06.2032 (d)	48.617	6.725	0,21	1,032 % fällig am 25.06.2029	9	9	0,00	0,000 % fällig am 05.03.2010 ^	€ 950	14	0,00
Summe Schweden		19.200	0,60	Asset-Backed Funding Certificates Trust				0,000 % fällig am 05.04.2011 ^	10	0	0,00
				0,692 % fällig am 25.10.2034	1.157	1.150	0,04	Nissan Motor Acceptance Corp.			
				Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				2,600 % fällig am 28.09.2022	\$ 500	510	0,02
				1,423 % fällig am 15.04.2033	281	284	0,01	2,650 % fällig am 13.07.2022	1.900	1.932	0,06
				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				RELX Capital, Inc.			
				0,292 % fällig am 25.12.2036	587	587	0,02	3,500 % fällig am 16.03.2023	200	210	0,01
				1,067 % fällig am 25.05.2035	710	710	0,02	Sabine Pass Liquefaction LLC			
								5,625 % fällig am 15.04.2023	1.000	1.075	0,03
								Sempra Energy			
								4,050 % fällig am 01.12.2023	400	430	0,01

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Sprint Spectrum Co. LLC 3,360 % fällig am 20.03.2023	44	\$ 44	0,00	Sequoia Mortgage Trust 0,793 % fällig am 19.10.2026	10	\$ 10	0,00	0,250 % fällig am 15.07.2029 (h)	65.593	\$ 73.025	2,26
Volkswagen Group of America Finance LLC 0,994 % fällig am 24.09.2021	2.600	2.605	0,08	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 2,724 % fällig am 25.09.2034	480	501	0,01	0,375 % fällig am 15.07.2023	4.818	5.127	0,16
		10.754	0,33	3,451 % fällig am 25.08.2047	2.777	2.814	0,09	0,375 % fällig am 15.07.2025	28	31	0,00
NON-AGENCY-MBS				Structured Asset Securities Corp. 0,442 % fällig am 25.03.2035	255	238	0,01	0,375 % fällig am 15.01.2027	22.834	25.286	0,78
Banc of America Funding Trust 3,209 % fällig am 20.01.2047	1.494	1.463	0,04	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,632 % fällig am 25.12.2045	31	32	0,00	0,375 % fällig am 15.07.2027	3.624	4.043	0,13
Bear Stearns ALT-A Trust 3,008 % fällig am 25.09.2035 ^	72	57	0,00	0,652 % fällig am 25.11.2045	884	863	0,03	0,500 % fällig am 15.01.2028	22.002	24.682	0,77
Citigroup Mortgage Loan Trust 3,234 % fällig am 25.09.2037 ^	316	312	0,01			20.066	0,62	0,625 % fällig am 15.04.2023	30.719	32.500	1,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 1,860 % fällig am 25.09.2035	5	5	0,00	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				0,625 % fällig am 15.01.2024	7.407	7.979	0,25
5,500 % fällig am 25.08.2034	676	692	0,02	Freddie Mac				0,625 % fällig am 15.01.2026	4.202	4.669	0,14
Countrywide Alternative Loan Trust 6,000 % fällig am 25.04.2037	1.203	1.213	0,04	0,352 % fällig am 25.08.2031	6	6	0,00	0,625 % fällig am 15.02.2043	12.518	14.975	0,46
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 2,639 % fällig am 20.11.2034	6	7	0,00	0,372 % fällig am 25.09.2031	11	11	0,00	0,750 % fällig am 15.07.2028 (h)	44.310	50.874	1,58
2,915 % fällig am 20.04.2035	23	23	0,00	0,673 % fällig am 15.12.2037	198	201	0,01	0,750 % fällig am 15.02.2042	27.530	33.581	1,04
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 0,592 % fällig am 30.11.2037	1.200	1.138	0,03	1,316 % fällig am 25.10.2044	308	317	0,01	0,750 % fällig am 15.02.2045	26.519	32.761	1,02
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				2,018 % fällig am 01.07.2036	71	75	0,00	0,875 % fällig am 15.01.2029	1.713	1.983	0,06
0,383 % fällig am 19.10.2045	3.091	3.002	0,09	2,115 % fällig am 01.09.2036	38	41	0,00	1,000 % fällig am 15.02.2046 (h)(i)	38.750	50.729	1,57
GreenPoint Mortgage Funding Trust 0,532 % fällig am 25.06.2045	108	102	0,00	2,230 % fällig am 01.10.2036	38	38	0,00	1,000 % fällig am 15.02.2048	7.477	9.990	0,31
GSR Mortgage Loan Trust 2,924 % fällig am 25.09.2035	76	77	0,00	Ginnie Mae				1,000 % fällig am 15.02.2049	14.535	19.608	0,61
Impac CMB Trust 0,732 % fällig am 25.03.2035	1.908	1.874	0,06	0,599 % fällig am 20.08.2068	2.588	2.568	0,08	1,375 % fällig am 15.02.2044 (h)	34.561	47.764	1,48
JPMorgan Mortgage Trust 2,663 % fällig am 25.07.2035	289	293	0,01	2,875 % fällig am 20.04.2030	7	8	0,00	2,000 % fällig am 15.01.2026	15.297	18.004	0,56
Lehman XS Trust 0,392 % fällig am 25.11.2035	1.199	1.196	0,04	3,375 % fällig am 20.05.2030	30	30	0,00	2,125 % fällig am 15.02.2040	21.913	32.705	1,01
1,242 % fällig am 25.12.2037	2.679	2.778	0,09	Uniform Mortgage-Backed Security 1,328 % fällig am 01.09.2044	28	29	0,00	2,125 % fällig am 15.02.2041 (h)	59.336	89.529	2,78
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass- Through Trust				2,633 % fällig am 01.12.2030	2	1	0,00	2,375 % fällig am 15.01.2025	23.781	27.643	0,86
0,933 % fällig am 15.08.2032	238	228	0,01	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2051	158.388	168.807	5,24	3,625 % fällig am 15.04.2028 (h)	48.499	65.429	2,03
2,610 % fällig am 20.10.2029	18	18	0,00			172.132	5,34			1.424.554	44,16
OBX Trust 0,742 % fällig am 25.06.2057	304	304	0,01	US-SCHATZ OblIGATIONEN				Summe USA		1.678.661	52,04
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass- Through Certificates				U.S. Treasury Bonds				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
1,892 % fällig am 25.04.2035	820	826	0,03	1,625 % fällig am 15.11.2050 (h)	11.070	9.946	0,31	ARGENTINA TREASURY BILLS			
				U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				38,001 % fällig am 30.07.2021 (b)(c)	ARS 7.824	45	0,00
				0,125 % fällig am 15.04.2022 (h)	68.456	70.225	2,18	Summe kurzfristige Instrumente		45	0,00
				0,125 % fällig am 15.07.2022	6.095	6.317	0,20	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 4.141.660	128,39	
				0,125 % fällig am 15.01.2023 (h)	46.354	48.437	1,50	AKTIEN			
				0,125 % fällig am 15.07.2024	24.737	26.607	0,82	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
				0,125 % fällig am 15.10.2024	23.101	24.903	0,77	PIMCO Select Funds plc –			
				0,125 % fällig am 15.04.2025 (h)	111.630	120.523	3,74	PIMCO US Dollar Short- Term Floating	8.853.453	88.189	2,74
				0,125 % fällig am 15.10.2025	103	112	0,00	NAV Fund (f)			
				0,125 % fällig am 15.04.2026	58.430	63.589	1,97	Summe Investmentfonds	\$ 88.189	2,74	
				0,125 % fällig am 15.07.2026 (h)	51.324	56.221	1,74				
				0,125 % fällig am 15.01.2030 (h)(i)	166.549	182.968	5,67				
				0,125 % fällig am 15.07.2030	36.029	39.779	1,23				
				0,125 % fällig am 15.01.2031 (h)	81.515	89.785	2,78				
				0,125 % fällig am 15.02.2051	11.137	12.225	0,38				

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2021	205	\$ 43	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	101	44	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	164	(195)	(0,01)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 171,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	08.2021	160	(68)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2021	317	67	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2021	623	(721)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	20	(25)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	295	(1.253)	(0,04)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	23	17	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	3.979	76	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	51	(78)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	164	251	0,01
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 171,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	08.2021	160	155	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2021	862	265	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	5.064	(1.441)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	2.090	(1.571)	(0,05)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Real Return Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	404	\$ (3.725)	(0,12)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	210	(460)	(0,01)
				\$ (8.619)	(0,27)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (8.619)	(0,27)

(1) Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.06.2022	\$ 100	\$ (13)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	800	57	0,00
				\$ 44	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500 %	15.09.2023	€ 15.400	\$ 8	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	76.500	(111)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,710	15.03.2033	5.900	242	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,488	01.10.2021	\$ 16.200	(557)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	1,760	04.11.2029	23.300	(1.878)	(0,06)
Zahlung	CPURNSA	1,883	20.11.2029	300	(21)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	6.200	(366)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	1.800	(95)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,155	19.01.2022	7.400	(195)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,155	04.02.2022	4.200	(110)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,165	19.01.2022	15.600	(410)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,180	19.01.2022	6.300	(164)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,200	21.01.2022	12.700	(329)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,200	05.02.2022	10.900	(279)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,210	05.02.2023	21.840	325	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,263	09.05.2023	6.846	69	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,311	24.02.2031	6.500	194	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,314	26.02.2026	14.400	396	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	800	(5)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,370	06.06.2028	12.900	(94)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	700	(3)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,500	15.07.2022	38.000	2.725	0,08
Erhalt	CPURNSA	2,690	01.06.2026	2.300	4	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	8.980	14	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	13.900	(10)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	20.100	(65)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,465	15.02.2022	£ 38.100	(594)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	3,475	15.08.2030	19.800	(882)	(0,03)
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	600	(13)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,580	15.03.2036	6.800	(84)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,620	15.02.2031	1.500	(39)	0,00
				\$ (2.327)	(0,07)	
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ (2.283)	(0,07)	

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,195 %	02.11.2022	7.350	\$ 6	\$ 1.079	0,03
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	8.440	642	1.238	0,04
BRC	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	4.500	505	938	0,03
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	4.360	326	639	0,02
JPM	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	5.900	650	1.229	0,04
MYC	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,007	24.08.2021	110.900	399	47	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	7.000	510	1.036	0,03
							\$ 3.038	\$ 6.206	0,19

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	1.400	\$ 8	\$ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,156	05.08.2021	800	8	2	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	900	8	4	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	1.600	9	6	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,641	07.07.2021	1.400	8	0	0,00
					\$ 41	\$ 12	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.08.2021	4.600	\$ (5)	\$ (1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	3.900	(4)	0	0,00
BPS	Put – OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	1.000	(6)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	3.700	(4)	(1)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	8.100	(11)	(3)	0,00
	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	4.700	(4)	(3)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	4.700	(6)	(2)	0,00
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	5.500	(3)	(3)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	5.500	(7)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	24.700	(27)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.700	(3)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	6.400	(8)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	20.200	(23)	(5)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	3.700	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	3.800	(4)	(1)	0,00
	CBK	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	7.200	(8)	(4)
Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index		Verkauf	0,800	18.08.2021	4.200	(5)	(1)	0,00
DUB	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	5.200	(4)	(4)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	5.200	(6)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	15.000	(15)	(4)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	4.100	(5)	(1)	0,00
FBF	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	4.000	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	21.800	(29)	(8)	0,00
	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	2.400	(2)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	20.500	(21)	(4)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	7.000	(7)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	9.500	(10)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	17.200	(22)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	4.600	(5)	(1)	0,00
MYC	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	3.900	(5)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	3.900	(4)	0	0,00
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	1.000	(2)	0	0,00
						\$ (273)	\$ (60)	0,00

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	7.800	\$ (356)	\$ (8)	0,00
JPM	Cap - OTC CPURNSA	\$ 233,916	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	22.04.2024	37.600	(273)	0	0,00
	Cap - OTC CPURNSA	\$ 234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	3.100	(22)	0	0,00
						\$ (651)	\$ (8)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Real Return Fund (Forts.)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000 %	02.11.2022	22.100	\$ 0	\$ (991)	(0,03)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	25.850	(641)	(1.165)	(0,03)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	13.500	(495)	(918)	(0,03)
BRC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	12.450	(306)	(561)	(0,02)
	DUB	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	30.220	(206)	(19)
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	153.100	(238)	(73)	0,00
	JPM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	400	(3)	0
MYC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	17.700	(638)	(1.204)	(0,04)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,006	24.08.2021	221.800	(349)	(18)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	2.000	(15)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	32.080	(228)	(20)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	21.100	(512)	(946)	(0,03)
							\$ (3.631)	\$ (5.915)	(0,18)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens	
FAR	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	2.300	\$ (10)	\$ (2)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	05.08.2021	1.600	(6)	(2)	0,00	
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,797	05.08.2021	1.600	(5)	(2)	0,00	
GSC	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,367	05.08.2021	1.100	(4)	(3)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,023	07.09.2021	1.600	(10)	(6)	0,00	
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,023	07.09.2021	1.600	(7)	(9)	0,00	
JPM	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	12.08.2021	2.900	(9)	(5)	0,00	
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	2.800	(9)	(5)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	1.600	(10)	(3)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	1.800	(11)	(4)	0,00	
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,313	07.09.2021	800	(3)	(3)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,047	07.07.2021	600	(2)	0	0,00	
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	104,047	07.07.2021	600	(1)	0	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	1.000	(4)	(1)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	3.200	(10)	(4)	0,00	
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	1.000	(2)	(1)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	1.000	(2)	(2)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,695	07.09.2021	1.000	(3)	(2)	0,00	
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	1.000	(3)	(2)	0,00	
	SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,375	07.07.2021	800	(3)	0	0,00
		Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,547	07.07.2021	1.300	(5)	0	0,00
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051		99,609	07.07.2021	3.800	(16)	0	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051		99,672	07.07.2021	1.400	(6)	0	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051		100,219	07.07.2021	1.200	(7)	(1)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051		101,203	07.07.2021	3.900	(14)	(7)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051		101,219	07.07.2021	1.200	(6)	(2)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051		101,375	07.07.2021	800	(2)	(1)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051		101,422	07.07.2021	1.200	(5)	(1)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051		101,547	07.07.2021	500	(1)	0	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051		101,641	07.07.2021	2.400	(8)	(1)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051		101,645	07.07.2021	2.500	(8)	(1)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051		101,766	07.07.2021	1.100	(3)	0	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051		99,172	05.08.2021	2.800	(18)	(4)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051		99,188	05.08.2021	1.400	(5)	(2)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051		99,406	05.08.2021	5.400	(23)	(10)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051		99,688	05.08.2021	2.400	(8)	(5)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051		99,938	05.08.2021	1.000	(3)	(3)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051		101,188	05.08.2021	1.400	(2)	(5)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051		101,406	05.08.2021	5.400	(12)	(14)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051		99,281	07.09.2021	2.300	(11)	(9)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051		101,281	07.09.2021	4.000	(11)	(17)	(0,01)	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051		101,297	07.09.2021	1.400	(5)	(6)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051		101,328	07.09.2021	3.800	(12)	(15)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051		102,164	07.07.2021	1.450	(6)	0	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051		102,211	07.07.2021	1.450	(6)	0	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051		102,375	07.07.2021	1.400	(4)	0	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051		101,703	05.08.2021	1.400	(3)	(1)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051		101,801	05.08.2021	1.200	(5)	(1)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051		102,078	05.08.2021	2.000	(9)	(2)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051		102,344	05.08.2021	1.400	(5)	(2)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051		102,586	05.08.2021	1.000	(4)	(2)	0,00	
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051		103,609	05.08.2021	2.400	(8)	(5)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	101,844	07.09.2021	1.000	(3)	(3)	0,00		
Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	103,844	07.09.2021	1.000	(1)	(2)	0,00		
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,258	05.08.2021	1.100	(3)	(2)	0,00		
					\$ (362)	\$ (180)	(0,01)	

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 12.200	\$ (713)	\$ 837	\$ 124	0,01
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.500	(5)	28	23	0,00
					\$ (718)	\$ 865	\$ 147	0,01

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	DKK 446.761	\$ 71.095	\$ 0	\$ (153)	\$ (153)	0,00	
	07.2021	€ 4.401	5.358	139	0	139	0,00	
	07.2021	¥ 962.700	8.701	27	0	27	0,00	
	07.2021	NOK 104.410	12.178	45	0	45	0,00	
	07.2021	\$ 9.691	AUD 12.870	0	(29)	(29)	0,00	
	07.2021	2.560	DKK 16.110	9	0	9	0,00	
	08.2021	AUD 12.870	\$ 9.693	29	0	29	0,00	
	08.2021	\$ 12.180	NOK 104.410	0	(45)	(45)	0,00	
	08.2021	4	RUB 282	0	0	0	0,00	
	08.2021	945	SEK 8.188	12	0	12	0,00	
	09.2021	219	CNY 1.409	0	(2)	(2)	0,00	
	09.2021	5	RUB 391	0	0	0	0,00	
	BPS	07.2021	AUD 50.930	\$ 39.580	1.344	0	1.344	0,04
		07.2021	DKK 95.365	15.430	221	0	221	0,01
	BRC	07.2021	\$ 13.385	DKK 83.730	0	(32)	(32)	0,00
		08.2021	12.291	CNH 81.133	241	0	241	0,01
CBK	07.2021	PEN 214	\$ 56	0	0	0	0,00	
	07.2021	\$ 914	SEK 7.579	0	(28)	(28)	0,00	
GLM	07.2021	DKK 346.408	\$ 54.937	0	(307)	(307)	(0,01)	
	07.2021	¥ 502.800	4.586	56	0	56	0,00	
	07.2021	PEN 19.057	5.235	256	0	256	0,01	
	07.2021	\$ 3.315	DKK 20.850	10	0	10	0,00	
	07.2021	12.500	NOK 104.410	0	(367)	(367)	(0,01)	
	07.2021	3	RUB 215	0	0	0	0,00	
	08.2021	PEN 6.126	\$ 1.642	41	(2)	39	0,00	
	08.2021	\$ 261	MXN 5.448	12	0	12	0,00	
	09.2021	PEN 7.099	\$ 1.915	56	0	56	0,00	
	07.2021	DKK 18.050	2.927	48	0	48	0,00	
HUS	07.2021	SEK 35.535	4.297	142	0	142	0,00	
	07.2021	\$ 12	RUB 899	1	0	1	0,00	
	08.2021	5.745	NZD 8.176	0	(32)	(32)	0,00	
	08.2021	12	RUB 904	0	0	0	0,00	
	08.2021	840	SEK 7.285	13	0	13	0,00	
	09.2021	14	RUB 996	0	0	0	0,00	
	12.2021	12.347	SGD 16.604	1	0	1	0,00	
	07.2021	€ 18.607	\$ 22.576	510	0	510	0,02	
	07.2021	¥ 8.978.035	82.302	1.411	0	1.411	0,04	
	07.2021	\$ 5.213	€ 4.301	0	(113)	(113)	0,00	
	07.2021	1.727	£ 1.217	0	(45)	(45)	0,00	
	08.2021	4	RUB 291	0	0	0	0,00	
JPM	09.2021	9.005	IDR 129.624.643	0	(168)	(168)	(0,01)	
	09.2021	6	RUB 412	0	0	0	0,00	
	07.2021	DKK 420.582	\$ 66.801	62	(334)	(272)	(0,01)	
	07.2021	NZD 76.153	55.575	2.363	0	2.363	0,07	
	07.2021	\$ 64.721	DKK 402.719	0	(498)	(498)	(0,01)	
	07.2021	1.132	€ 934	0	(24)	(24)	0,00	
	07.2021	131	ILS 427	0	0	0	0,00	
	08.2021	4.074	SEK 35.295	55	0	55	0,00	
	09.2021	3.456	IDR 49.805.595	0	(60)	(60)	0,00	
	10.2021	DKK 379.869	\$ 61.081	396	0	396	0,01	
MYI	12.2021	SGD 16.580	12.341	11	0	11	0,00	
	07.2021	€ 1.772	2.113	11	0	11	0,00	
	07.2021	£ 9.216	13.033	302	0	302	0,01	
	07.2021	¥ 4.635.307	42.581	818	0	818	0,03	
	07.2021	SGD 102	76	0	0	0	0,00	
	07.2021	\$ 7.206	AUD 9.527	0	(54)	(54)	0,00	
	07.2021	72.323	DKK 450.331	0	(506)	(506)	(0,02)	
	07.2021	5.651	£ 4.083	0	(11)	(11)	0,00	
	07.2021	3	RUB 212	0	0	0	0,00	
	07.2021	2	SGD 2	0	0	0	0,00	
08.2021	AUD 9.527	\$ 7.207	54	0	54	0,00		
10.2021	DKK 450.331	72.448	506	0	506	0,02		

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SCX	07.2021	DKK 186.250	\$ 30.149	\$ 447	\$ 0	\$ 447	0,01
	07.2021	£ 16.786		673	0	673	0,02
	07.2021	SEK 28.970		3.509	121	121	0,00
SOG	07.2021	\$ 86.072	DKK 535.967	0	(599)	(599)	(0,02)
	07.2021	3	RUB 245	0	0	0	0,00
	08.2021	4	322	0	0	0	0,00
	10.2021	DKK 535.967	\$ 86.221	598	0	598	0,02
SSB	08.2021	£ 635.330		878.050	294	294	0,01
TOR	07.2021	CAD 63.808		52.814	1.285	1.285	0,04
	07.2021	€ 727.814		890.374	27.258	27.258	0,85
UAG	07.2021	AUD 17.647		13.679	430	430	0,01
	07.2021	£ 612.012		867.140	21.676	21.676	0,67
	07.2021	SEK 42.585		5.143	164	164	0,01
	07.2021	\$ 35.030	AUD 46.180	0	(360)	(360)	(0,01)
	07.2021	136.214	¥ 15.078.842	0	(356)	(356)	(0,01)
	07.2021	3	RUB 228	0	0	0	0,00
	08.2021	AUD 46.180	\$ 35.035	359	0	359	0,01
	08.2021	¥ 15.078.842	136.249	356	0	356	0,01
				\$ 62.863	\$ (4.125)	\$ 58.738	1,82

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend und Investor CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 37.242	CHF 33.409	\$ 0	\$ (1.098)	\$ (1.098)	(0,03)
BPS	07.2021	13	12	0	0	0	0,00
BRC	07.2021	1.277	1.147	0	(36)	(36)	0,00
CBK	07.2021	CHF 33.918	\$ 36.843	149	0	149	0,00
	07.2021	\$ 37.292	CHF 33.437	0	(1.119)	(1.119)	(0,04)
	08.2021	36.874	33.918	0	(148)	(148)	0,00
GLM	07.2021	209	189	0	(4)	(4)	0,00
MYI	07.2021	CHF 23	\$ 25	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 35.319	CHF 31.822	0	(893)	(893)	(0,03)
SCX	07.2021	CHF 34	\$ 38	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 696	CHF 626	0	(18)	(18)	0,00
SSB	07.2021	222	202	0	(4)	(4)	0,00
UAG	07.2021	CHF 70	\$ 76	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 72	CHF 65	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 151	\$ (3.322)	\$ (3.171)	(0,10)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 2.034	€ 1.673	\$ 0	\$ (49)	\$ (49)	0,00
BPS	07.2021	431.640	€ 352.850	0	(13.095)	(13.095)	(0,41)
BRC	07.2021	762	626	0	(20)	(20)	0,00
GLM	07.2021	490	405	0	(11)	(11)	0,00
HUS	07.2021	€ 581	\$ 694	5	0	5	0,00
	07.2021	\$ 7.207	€ 5.945	0	(157)	(157)	0,00
RYL	07.2021	158.852	133.433	0	(614)	(614)	(0,02)
SCX	07.2021	506.984	414.423	0	(15.520)	(15.520)	(0,48)
TOR	07.2021	505.771	413.425	0	(15.490)	(15.490)	(0,48)
UAG	07.2021	806	663	0	(20)	(20)	0,00
				\$ 5	\$ (44.976)	\$ (44.971)	(1,39)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 9.367	\$ 13.080	\$ 140	\$ 0	\$ 140	0,00
	07.2021	\$ 2.857	£ 2.030	0	(52)	(52)	0,00
BRC	07.2021	724	515	0	(12)	(12)	0,00
GLM	07.2021	155.202	109.782	0	(3.543)	(3.543)	(0,11)
HUS	07.2021	£ 115.125	\$ 159.350	309	0	309	0,01
	08.2021	\$ 158.959	£ 114.839	0	(300)	(300)	(0,01)
MYI	07.2021	£ 2	\$ 2	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 4.263	£ 3.054	0	(44)	(44)	0,00
RYL	07.2021	514	365	0	(10)	(10)	0,00
SCX	07.2021	156.540	110.127	0	(4.405)	(4.405)	(0,14)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SSB	07.2021	£ 114.839	\$ 158.700	\$ 55	\$ 0	\$ 55	0,00
	07.2021	\$ 1.108	£ 784	0	(26)	(26)	0,00
	08.2021	158.712	114.839	0	(53)	(53)	0,00
UAG	07.2021	155.547	109.782	0	(3.888)	(3.888)	(0,12)
				\$ 504	\$ (12.333)	\$ (11.829)	(0,37)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 102.998	\$ 76.713	\$ 89	\$ 0	\$ 89	0,00
	08.2021	\$ 76.707	SGD 102.998	0	(88)	(88)	0,00
BPS	07.2021	77.692	102.779	0	(1.231)	(1.231)	(0,04)
GLM	08.2021	SGD 16.603	\$ 12.350	0	(1)	(1)	0,00
HUS	07.2021	\$ 77.429	SGD 102.444	0	(1.217)	(1.217)	(0,04)
MYI	07.2021	SGD 97.649	\$ 72.648	3	0	3	0,00
	08.2021	\$ 72.642	SGD 97.649	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2021	73.833	97.858	0	(1.033)	(1.033)	(0,03)
SSB	07.2021	3.045	4.026	0	(50)	(50)	0,00
				\$ 92	\$ (3.623)	\$ (3.531)	(0,11)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 126	¥ 13.892	\$ 0	(1)	(1)	0,00
BPS	07.2021	879	€ 725	0	(19)	(19)	0,00
	07.2021	1.392	£ 989	0	(26)	(26)	0,00
GLM	07.2021	2.302	¥ 251.722	0	(34)	(34)	0,00
	07.2021	421	NZD 580	0	(16)	(16)	0,00
CBK	07.2021	764	AUD 987	0	(22)	(22)	0,00
	07.2021	79	CAD 96	0	(1)	(1)	0,00
HUS	07.2021	24.568	£ 17.378	0	(561)	(561)	(0,02)
	07.2021	£ 18.822	\$ 26.051	49	0	49	0,00
GLM	07.2021	\$ 42	AUD 55	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	645	£ 455	0	(17)	(17)	0,00
	07.2021	528	SEK 4.361	0	(18)	(18)	0,00
	08.2021	26.053	£ 18.822	0	(49)	(49)	0,00
SCX	07.2021	219	DKK 1.351	0	(4)	(4)	0,00
	07.2021	16.053	€ 13.122	0	(492)	(492)	(0,02)
TOR	07.2021	1.436	CAD 1.735	0	(35)	(35)	0,00
				\$ 49	\$ (1.296)	\$ (1.247)	(0,04)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (5.809) (0,18)

Summe Anlagen

\$ 4.213.138 130,61

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (987.368) (30,61)

Nettovermögen

\$ 3.225.770 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 772.748 als Sicherheiten verpfändet.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 65.945 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.001 und Barmittel in Höhe von USD 389 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 16.187 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Real Return Fund (Forts.)

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 34.690 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 4.141.660	\$ 0	\$ 4.141.660
Investmentfonds	88.189	0	0	88.189
Finanzderivate ⁽³⁾	(2.147)	(14.564)	0	(16.711)
Summen	\$ 86.042	\$ 4.127.096	\$ 0	\$ 4.213.138

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.634.557	\$ 0	\$ 3.634.557
Investmentfonds	43.486	0	0	43.486
Pensionsgeschäfte	0	906	0	906
Finanzderivate ⁽³⁾	(133)	(3.620)	(3)	(3.756)
Summen	\$ 43.353	\$ 3.631.843	\$ (3)	\$ 3.675.193

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	0,010 %	04.06.2021	07.07.2021	\$ (11.694)	\$ (11.694)	(0,36)
	0,020	02.06.2021	06.07.2021	(7.719)	(7.720)	(0,24)
	0,030	03.06.2021	06.07.2021	(19.668)	(19.668)	(0,61)
GRE	0,050	05.05.2021	06.07.2021	(4.340)	(4.340)	(0,14)
	0,060	06.05.2021	07.07.2021	(13.325)	(13.327)	(0,41)
	0,060	11.05.2021	12.07.2021	(15.619)	(15.620)	(0,49)
	0,060	12.05.2021	12.07.2021	(9.437)	(9.438)	(0,29)
NOM	0,050	17.06.2021	19.07.2021	(689.450)	(689.464)	(21,37)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (771.271)	(23,91)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	% des Nettovermögens
BOS	0,000 %	21.06.2021	06.07.2021	\$ (5.319)	\$ (5.319)	(0,17)
BRC	0,010	11.06.2021	12.07.2021	(33.538)	(33.539)	(1,04)
TDM	0,070	30.06.2021	02.07.2021	(26.902)	(26.902)	(0,83)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (65.760)	(2,04)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (1.116)	\$ 1.230	\$ 114
BPS	(12.382)	10.900	(1.482)
BRC	(41)	0	(41)
CBK	(1.386)	1.090	(296)
DUB	(39)	(30)	(69)
FAR	(6)	0	(6)
FBF	(9)	0	(9)
GLM	(4.029)	3.220	(809)
GSC	(18)	0	(18)
GST	122	0	122
HUS	199	0	199
JPM	1.976	(1.700)	276
MYC	99	(347)	(248)
MYI	184	(310)	(126)
RYL	(624)	0	(624)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
SAL	\$ (101)	\$ 0	\$ (101)
SCX	(20.230)	18.200	(2.030)
SOG	(1)	0	(1)
SSB	216	0	216
TOR	13.018	(11.640)	1.378
UAG	18.359	(16.500)	1.859

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	108,26	109,80
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	19,68	30,65
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,45	0,53
Investmentfonds	2,74	1,69
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,27)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,07)	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,18)	(0,15)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(23,91)	(29,84)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(2,04)	(0,07)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Argentinien	k. A.	0,00
Australien	1,98	2,43
Brasilien	0,00	0,01
Kanada	2,04	2,21
Cayman Inseln	1,19	1,21
Dänemark	6,81	5,43
Frankreich	12,18	15,15
Deutschland	0,38	0,48
Guernsey, Kanalinseln	0,08	0,10
Irland	2,48	1,69
Italien	10,45	7,03
Japan	4,36	3,25
Luxemburg	0,02	0,02
Multinational	0,01	k. A.
Niederlande	1,30	1,06
Neuseeland	1,45	1,09
Peru	0,21	0,33
Katar	k. A.	0,09
Slowenien	0,04	0,05
Spanien	2,42	3,49
Schweden	0,60	0,27
Großbritannien	28,35	30,85
USA	52,04	64,73
Kurzfristige Instrumente	0,00	0,01
Investmentfonds	2,74	1,69
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,27)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Zinsswaps	(0,07)	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	0,19	0,13
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Inflation-Capped Options	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,18)	(0,12)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	(0,00)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,01
Devisenterminkontrakte	1,82	(1,63)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,01)	1,47
Sonstige Aktiva und Passiva	(30,61)	(42,56)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG											
AA Advantage Loyalty IP Ltd. 5,500 % fällig am 20.04.2028	\$ 32.600	\$ 34.026	0,05	Golden Nugget, Inc. 3,250 % fällig am 04.10.2023	\$ 8.429	\$ 8.375	0,01	SkyMiles IP Ltd. 4,750 % fällig am 20.10.2027	\$ 44.044	\$ 46.571	0,07
Alphabet Holding Co., Inc. 3,604 % fällig am 26.09.2024	4.235	4.235	0,01	Gray Television, Inc. 2,592 % fällig am 02.01.2026	5.617	5.597	0,01	Sotera Health Holdings LLC 3,250 % fällig am 11.12.2026	17.409	17.376	0,02
Alltice France S.A. 3,871 % fällig am 31.01.2026	619	615	0,00	Grifols Worldwide Operations USA, Inc. 2,088 % fällig am 15.11.2027	12.625	12.514	0,02	SS&C Technologies, Inc. 1,854 % fällig am 16.04.2025	28.457	28.169	0,04
4,155 % fällig am 14.08.2026	28.665	28.662	0,04	Hilton Worldwide Finance LLC 1,842 % fällig am 22.06.2026	64.007	63.555	0,09	Starfruit Finco BV 2,843 % - 5,000 % fällig am 01.10.2025	14.663	14.571	0,02
American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 2,104 % fällig am 15.01.2027	15.813	15.718	0,02	Icon Luxembourg SARL TBD % fällig am 16.06.2028	27.138	27.223	0,04	Sunshine Luxembourg SARL 4,500 % fällig am 01.10.2026	31.010	31.146	0,04
Aramark Services, Inc. 1,854 % fällig am 11.03.2025	6.716	6.659	0,01	iHeartCommunications, Inc. 3,104 % fällig am 01.05.2026	296.677	294.545	0,41	Syniverse Holdings, Inc. 6,000 % fällig am 09.03.2023	14.108	13.999	0,02
Avantor Funding, Inc. 3,000 % fällig am 21.11.2024	1.314	1.317	0,00	4,750 % fällig am 01.05.2026	44.253	44.281	0,06	TransDigm, Inc. 2,354 % fällig am 22.08.2024	18.553	18.349	0,03
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 2,250 % fällig am 12.02.2027	10.148	10.043	0,01	ILLUMINATE BUYER LLC 3,604 % fällig am 30.06.2027	0	0	0,00	2,354 % fällig am 30.05.2025	9.975	9.838	0,01
2,500 % fällig am 15.01.2025	21.326	21.296	0,03	INEOS Finance PLC 2,500 % fällig am 01.04.2024	€ 42.598	50.303	0,07	2,354 % fällig am 09.12.2025	29.924	29.515	0,04
Axalta Coating Systems U.S. Holdings, Inc. 1,897 % fällig am 01.06.2024	2.372	2.359	0,00	Intelsat Jackson Holdings S.A. 3,600 % - 6,500 % fällig am 13.07.2022	\$ 37.413	37.881	0,05	U.S. Renal Care, Inc. 5,125 % fällig am 26.06.2026	16.626	16.719	0,02
Banjilay Entertainment S.A.S. 3,836 % fällig am 01.03.2025	1.741	1.739	0,00	8,000 % fällig am 27.11.2023	132.233	134.327	0,19	Uber Technologies, Inc. 3,604 % fällig am 04.04.2025	17.994	18.007	0,03
Bausch Health Cos., Inc. 2,854 % fällig am 27.11.2025	7.860	7.811	0,01	8,750 % fällig am 02.01.2024	2.700	2.758	0,00	3,604 % fällig am 16.02.2027	16.100	16.122	0,02
3,104 % fällig am 02.06.2025	6.088	6.071	0,01	IRB Holding Corp. 2,964 % - 3,750 % fällig am 05.02.2025	12.271	12.254	0,02	United Airlines, Inc. 4,500 % fällig am 21.04.2028	30.800	31.240	0,04
BWAY Holding Co. 3,354 % fällig am 03.04.2024	3.302	3.229	0,01	Lesland Finance Company B.V. 3,096 % fällig am 30.06.2024	2.771	1.801	0,00	Univision Communications, Inc. 2,854 % fällig am 15.03.2024	196.019	195.966	0,27
Caesars Resort Collection LLC 2,854 % fällig am 23.12.2024	113.671	112.825	0,16	1,109 % - 3,000 % fällig am 30.06.2025 (d)	6.231	2.863	0,00	VICI Properties LLC 1,841 % fällig am 20.12.2024	37.043	36.777	0,05
4,604 % fällig am 21.07.2025	33.138	33.289	0,05	Marriott Ownership Resorts, Inc. 1,854 % fällig am 29.08.2025	5.054	4.999	0,01	Westmoreland Coal Co. (15,000 % PIK) TBD % - 15,000 % fällig am 15.03.2029 (d)	4.164	895	0,00
Camelot U.S. Acquisition Co. 3,104 % fällig am 30.10.2026	1.970	1.965	0,00	MH Sub LLC 3,604 % fällig am 13.09.2024	26.544	26.466	0,04	Westmoreland Mining Holdings LLC 9,250 % fällig am 15.03.2022	257	248	0,00
Carnival Corp. 3,750 % fällig am 30.06.2025	€ 43.956	53.399	0,07	Nascar Holdings, Inc. 2,854 % fällig am 19.10.2026	3.404	3.393	0,01	Whatabrands LLC 2,832 % fällig am 31.07.2026	2.654	2.646	0,00
8,500 % fällig am 30.06.2025	\$ 110.148	112.901	0,16	Nielsen Finance LLC 2,081 % fällig am 04.10.2023	3.114	3.114	0,00	Windstream Services LLC 7,250 % fällig am 21.09.2027	10.158	10.205	0,01
Cengage Learning, Inc. TBD % fällig am 29.06.2026	46.063	46.164	0,06	Numericable Group S.A. 2,936 % fällig am 31.07.2025	217	214	0,00	Wyndham Hotels & Resorts, Inc. 1,854 % fällig am 30.05.2025	8.169	8.109	0,01
CenturyLink, Inc. 2,354 % fällig am 15.03.2027	52.595	51.975	0,07	Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 3,089 % fällig am 30.06.2025	2.951	2.951	0,00	Zayo Group Holdings, Inc. 3,104 % fällig am 09.03.2027	50.953	50.454	0,07
Charter Communications Operating LLC 1,860 % fällig am 01.02.2027	65.748	65.312	0,09	Parexel International Corp. 2,845 % fällig am 27.09.2024	5.209	5.184	0,01	3,250 % fällig am 09.03.2027	€ 9.233	10.903	0,02
CityCenter Holdings LLC 3,000 % - 3,250 % fällig am 18.04.2024	35.707	35.474	0,05	Petco Health & Wellness Co., Inc. 4,000 % fällig am 03.03.2028	29.327	29.313	0,04				
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. 3,686 % fällig am 21.08.2026	20.079	19.631	0,03	PetSmart, Inc. 4,500 % fällig am 12.02.2028	39.000	39.073	0,06	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSELBANKEN UND FINANZEN			
Commscope, Inc. 3,346 % fällig am 06.04.2026	18.078	18.021	0,03	PRA Health Science, Inc. TBD % fällig am 16.06.2028	6.762	6.783	0,01	AGFC Capital Trust 1,934 % fällig am 15.01.2067	\$ 5.300	3.476	0,00
Core & Main LP 3,750 % fällig am 01.08.2024	3.445	3.448	0,01	Prestige Brands, Inc. 2,104 % fällig am 26.01.2024	140	140	0,00	AIB Group PLC 2,875 % fällig am 30.05.2031	€ 24.600	31.233	0,04
Cornerstone Building Brands, Inc. 3,750 % fällig am 12.04.2028	37.926	37.974	0,05	PUG LLC 3,604 % fällig am 12.02.2027	4.344	4.257	0,01	6,250 % fällig am 23.06.2025 (j)(k)	25.000	33.798	0,05
Dell International LLC 2,000 % fällig am 19.09.2025	28.670	28.699	0,04	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 3,854 % fällig am 16.11.2025	5.539	5.534	0,01	Ally Financial, Inc. 8,000 % fällig am 01.11.2031	\$ 25.106	36.024	0,05
Delos Finance SARL 1,897 % fällig am 06.10.2023	8.226	8.230	0,01	Reynolds Group Holdings, Inc. 2,854 % fällig am 05.02.2023	1.124	1.123	0,00	Alpha Bank Romania S.A. 0,985 % fällig am 16.05.2024	€ 20.000	23.877	0,03
Diamond (BC) BV 3,147 % - 3,186 % fällig am 06.09.2024	2.564	2.553	0,00	SBA Senior Finance LLC 1,860 % fällig am 11.04.2025	3.104	3.082	0,00	Alpha Bank S.A. 2,500 % fällig am 05.02.2023	19.213	23.633	0,03
Diamond Resorts Corp. 4,750 % fällig am 02.09.2023	63.827	63.899	0,09	Sequa Mezzanine Holdings LLC 7,750 % fällig am 28.11.2023	39.090	39.415	0,06	Ambac Assurance Corp. 5,100 % (i)	\$ 0	0	0,00
Elanco Animal Health, Inc. 1,842 % fällig am 02.08.2027	8.456	8.346	0,01	10,000 % fällig am 23.07.2025	68.784	66.721	0,09	Ambac LSNi LLC 6,000 % fällig am 12.02.2023	63.660	63.700	0,09
Emerald TopCo, Inc. 3,604 % - 3,686 % fällig am 24.07.2026	3.650	3.636	0,01	Sequa Mezzanine Holdings LLC (11,750 % bar oder 6,750 % PIK) 11,750 % fällig am 28.04.2024 (d)	11.853	11.720	0,02	American Assets Trust LP 3,375 % fällig am 01.02.2031	25.800	26.614	0,04
Envision Healthcare Corp. 3,854 % fällig am 10.10.2025	151.988	130.520	0,18	Serta Simmons Bedding LLC 4,500 % fällig am 08.11.2023	1.436	998	0,00	Army Hawaii Family Housing Trust Certificates 0,473 % fällig am 15.06.2050	104.800	76.250	0,11
Fleet U.S. Bidco, Inc. 3,104 % fällig am 07.10.2026	0	0	0,00	Sierra Hamilton LLC 15,000 % fällig am 12.09.2023	0	0	0,00	Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	2.000	2.395	0,00
Forest City Enterprises LP 3,604 % fällig am 08.12.2025	8.960	8.762	0,01	Sigma Bidco BV 3,500 % fällig am 02.07.2025	€ 28.800	33.327	0,05	Asian Development Bank 4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN 99.000	4.981	0,01
Gates Global LLC 3,500 % fällig am 31.03.2027	2.648	2.646	0,00	Sinclair Television Group, Inc. 2,610 % fällig am 30.09.2026	\$ 5.620	5.567	0,01	Aviation Capital Group LLC 3,875 % fällig am 01.05.2023	\$ 634	664	0,00
								4,125 % fällig am 01.08.2025	4.400	4.758	0,01
								4,875 % fällig am 01.10.2025	5.800	6.446	0,01
										2.592.925	3,61

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES MARKT- WERT (000S) MÖGENS		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES MARKT- WERT (000S) MÖGENS		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES MARKT- WERT (000S) MÖGENS	
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025	\$ 3.973	\$ 4.093	0,01	BNP Paribas S.A. 4,625 % fällig am 25.02.2031 (i)(k)	\$ 47.400	\$ 49.463	0,07	Cyrusone Europe Finance DAC 1,125 % fällig am 26.05.2028	€ 24.900	\$ 29.378	0,04
3,250 % fällig am 15.02.2027	5.438	5.614	0,01	6,750 % fällig am 14.03.2022 (i)(k)	8.400	8.688	0,01	CyrusOne LP 1,450 % fällig am 22.01.2027	€ 24.271	29.373	0,04
3,625 % fällig am 01.05.2022	8.620	8.820	0,01	BOC Aviation Ltd. 1,271 % fällig am 26.09.2023	5.500	5.497	0,01	2,150 % fällig am 01.11.2030	\$ 17.600	16.752	0,02
3,950 % fällig am 01.07.2024	6.940	7.405	0,01	2,375 % fällig am 15.09.2021	5.130	5.138	0,01	Dalian Wanda Commercial Management Group Co. Ltd. 4,890 % fällig am 17.04.2023	CNY 10.000	1.457	0,00
4,375 % fällig am 01.05.2026	2.500	2.720	0,00	Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % fällig am 15.02.2023	4.160	4.339	0,01	Deutsche Bank AG 0,750 % fällig am 17.02.2027	€ 69.400	82.880	0,12
5,125 % fällig am 01.10.2023	33.356	36.074	0,05	Brixmor Operating Partnership LP 1,226 % fällig am 01.02.2022	15.606	15.668	0,02	1,346 % fällig am 16.11.2022	\$ 6.401	6.456	0,01
5,250 % fällig am 15.05.2024	11.906	13.103	0,02	Brookfield Finance, Inc. 4,700 % fällig am 20.09.2047	8.028	9.832	0,01	1,369 % fällig am 27.02.2023	€ 11.600	11.723	0,02
5,500 % fällig am 15.01.2023	34.400	36.546	0,05	CaixaBank S.A. 3,750 % fällig am 15.02.2029	€ 19.800	25.327	0,04	1,375 % fällig am 17.02.2032	€ 140.600	169.370	0,24
Banca Carige SpA 1,161 % fällig am 25.10.2021	€ 195.000	231.956	0,32	6,000 % fällig am 18.07.2022 (i)(k)	1.200	1.488	0,00	1,750 % fällig am 16.12.2021	€ 6.800	9.444	0,01
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (i)(k)	2.400	3.081	0,00	CBL & Associates LP 4,600 % fällig am 15.10.2024 ^	\$ 68	39	0,00	1,750 % fällig am 19.11.2030	€ 88.700	111.275	0,16
Banco Bradesco S.A. 2,850 % fällig am 27.01.2023	\$ 24.932	25.512	0,04	5,950 % fällig am 15.12.2026 ^	10.402	5.882	0,01	1,875 % fällig am 22.12.2028	€ 15.300	21.116	0,03
3,200 % fällig am 27.01.2025	3.467	3.572	0,01	CDBL Funding 3,000 % fällig am 01.08.2022	7.800	7.940	0,01	2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 36.100	52.118	0,07
Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % fällig am 10.01.2025	23.200	24.330	0,03	China Construction Bank Corp. 0,060 % fällig am 24.09.2021	€ 22.200	26.341	0,04	3,035 % fällig am 28.05.2032 (m)	\$ 43.000	43.818	0,06
Banco de Credito del Peru 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 95.500	25.793	0,04	China Construction Bank New Zealand Ltd. 0,885 % fällig am 20.12.2021	\$ 41.500	41.574	0,06	3,547 % fällig am 18.09.2031	€ 18.600	19.820	0,03
Banco Espirito Santo S.A. 2,625 % fällig am 08.05.2017 ^	€ 16.200	3.074	0,00	CIT Bank N.A. 2,969 % fällig am 27.09.2025	31.200	32.740	0,05	3,875 % fällig am 12.02.2024	€ 12.900	19.062	0,03
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	8.100	1.537	0,00	CIT Group, Inc. 4,750 % fällig am 16.02.2024	4.900	5.325	0,01	3,961 % fällig am 26.11.2025	\$ 210.380	227.582	0,32
Banco Santander S.A. 4,125 % fällig am 12.11.2027 (i)(k)	73.000	88.886	0,12	5,000 % fällig am 15.08.2022	102.434	107.176	0,15	4,100 % fällig am 13.01.2026	€ 153	168	0,00
4,750 % fällig am 19.03.2025 (i)(k)	27.400	33.915	0,05	5,000 % fällig am 01.08.2023	92.156	99.759	0,14	4,250 % fällig am 14.10.2021	147.940	149.550	0,21
6,250 % fällig am 11.09.2021 (i)(k)	15.700	18.824	0,03	CNH Industrial Capital LLC 3,875 % fällig am 15.10.2021	3.343	3.375	0,00	4,625 % fällig am 30.10.2027 (i)(k)	€ 57.800	71.390	0,10
6,750 % fällig am 25.04.2022 (i)(k)	5.300	6.568	0,01	Cooperative Rabobank UA 3,100 % fällig am 29.06.2028 (i)(k)	€ 35.000	42.063	0,06	5,625 % fällig am 19.05.2031	€ 24.300	34.156	0,05
Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025 (i)(k)	150.039	210.628	0,29	Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % fällig am 15.04.2023 (n)	30.000	30.975	0,04	DNB Bank ASA 6,500 % fällig am 26.03.2022 (i)(k)	\$ 1.060	1.100	0,00
Bank of Nova Scotia 4,900 % fällig am 04.06.2025 (i)(k)	\$ 9.271	10.198	0,01	Corp. Andina de Fomento 3,950 % fällig am 15.10.2021 (h)	MXN 14.191	716	0,00	Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust 5,250 % fällig am 30.05.2025	700	703	0,00
Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022 (k)	28.440	31.029	0,04	Corporate Office Properties LP 2,750 % fällig am 15.04.2031	\$ 6.700	6.759	0,01	Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust 5,125 % fällig am 30.11.2024	569	571	0,00
Barclays PLC 1,824 % fällig am 15.06.2023	AUD 3.500	2.686	0,00	CPI Property Group S.A. 1,625 % fällig am 23.04.2027	€ 7.200	8.796	0,01	EPR Properties 4,750 % fällig am 15.12.2026	7.623	8.273	0,01
3,250 % fällig am 12.02.2027	£ 64.748	97.406	0,14	2,750 % fällig am 12.05.2026	47.700	61.651	0,09	4,950 % fällig am 15.04.2028	2.170	2.346	0,00
4,337 % fällig am 10.01.2028	\$ 25.601	28.644	0,04	2,750 % fällig am 22.01.2028	£ 24.550	34.764	0,05	Equinix, Inc. 3,200 % fällig am 18.11.2029	13.317	14.300	0,02
4,375 % fällig am 12.01.2026	26.370	29.542	0,04	4,750 % fällig am 08.03.2023	\$ 23.300	24.892	0,03	Erste Group Bank AG 4,250 % fällig am 15.10.2027 (i)(k)	€ 28.600	36.379	0,05
4,836 % fällig am 09.05.2028	7.700	8.662	0,01	Credit Agricole S.A. 7,875 % fällig am 23.01.2024 (i)(k)	550	623	0,00	8,875 % fällig am 15.10.2021 (i)(k)	8.800	10.696	0,02
4,972 % fällig am 16.05.2029	96.015	112.526	0,16	Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (k)	77.325	85.602	0,12	Essential Properties LP 2,950 % fällig am 15.07.2031	\$ 4.000	4.005	0,01
5,088 % fällig am 20.06.2030	2.900	3.385	0,00	Credit Suisse Group AG 3,091 % fällig am 14.05.2032	52.600	54.306	0,08	Extra Space Storage LP 2,550 % fällig am 01.06.2031	9.500	9.576	0,01
5,200 % fällig am 12.05.2026	9.200	10.532	0,01	4,194 % fällig am 01.04.2031	2.900	3.262	0,00	Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 1.200	1.566	0,00
5,875 % fällig am 15.09.2024 (i)(k)	£ 44.658	66.320	0,09	5,250 % fällig am 11.02.2027 (i)(k)	6.400	6.784	0,01	3,375 % fällig am 03.03.2031	€ 3.900	4.069	0,01
6,125 % fällig am 15.12.2025 (i)(k)	\$ 44.800	49.700	0,07	6,250 % fällig am 18.12.2024 (i)(k)	32.020	35.138	0,05	3,950 % fällig am 03.03.2031	CAD 13.000	10.861	0,02
6,375 % fällig am 15.12.2025 (i)(k)	€ 25.880	40.085	0,06	6,375 % fällig am 21.08.2026 (i)(k)	9.670	10.787	0,02	4,230 % fällig am 14.06.2029	3.000	2.612	0,00
7,125 % fällig am 15.06.2025 (i)(k)	87.185	137.906	0,19	7,125 % fällig am 29.07.2022 (i)(k)	17.889	18.680	0,03	4,625 % fällig am 29.04.2030	\$ 7.477	8.580	0,01
7,250 % fällig am 15.03.2023 (i)(k)	65.437	97.747	0,14	7,250 % fällig am 12.09.2025 (i)(k)	5.900	6.674	0,01	4,700 % fällig am 16.12.2026	CAD 3.400	3.049	0,00
7,750 % fällig am 15.09.2023 (i)(k)	\$ 82.246	90.573	0,13	7,500 % fällig am 17.07.2023 (i)(k)	41.815	45.578	0,06	4,850 % fällig am 17.04.2028	\$ 13.037	15.015	0,02
7,875 % fällig am 15.03.2022 (i)(k)	39.298	41.037	0,06	7,500 % fällig am 11.12.2023 (i)(k)	54.686	60.786	0,08	FCE Bank PLC 1,615 % fällig am 11.05.2023	€ 1.000	1.211	0,00
7,875 % fällig am 15.09.2022 (i)(k)	£ 68.757	102.043	0,14	CTR Partnership LP 5,250 % fällig am 01.06.2025	4.748	4.873	0,01	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 01.12.2021	6.600	7.822	0,01
8,000 % fällig am 15.06.2024 (i)(k)	\$ 44.550	50.703	0,07	CVS Pass-Through Trust 4,704 % fällig am 10.01.2036	5.850	6.641	0,01	0,157 % fällig am 01.12.2024	€ 6.200	7.167	0,01
Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 25.000	29.405	0,04					1,068 % fällig am 12.10.2021	\$ 700	699	0,00
BGC Partners, Inc. 3,750 % fällig am 01.10.2024	\$ 18.812	19.875	0,03					1,416 % fällig am 28.03.2022	€ 600	599	0,00
4,375 % fällig am 15.12.2025	5.900	6.394	0,01					1,514 % fällig am 17.02.2023	€ 8.000	9.642	0,01
5,375 % fällig am 24.07.2023	3.798	4.114	0,01					1,744 % fällig am 19.07.2024	27.789	33.495	0,05
BNP Paribas Issuance BV 0,000 % fällig am 12.04.2024	10	1.863.244	2,59					2,330 % fällig am 25.11.2025	1.000	1.228	0,00
								2,386 % fällig am 17.02.2026	2.100	2.589	0,00
								2,748 % fällig am 14.06.2024	€ 54.800	76.885	0,11
								2,979 % fällig am 03.08.2022	\$ 11.281	11.466	0,02
								3,021 % fällig am 06.03.2024	€ 1.400	1.744	0,00
								3,087 % fällig am 09.01.2023	\$ 66.919	68.341	0,10
								3,096 % fällig am 04.05.2023	€ 13.835	14.129	0,02
								3,219 % fällig am 09.01.2022	€ 13.361	13.521	0,02
								3,250 % fällig am 15.09.2025	€ 1.136	1.446	0,00
								3,339 % fällig am 28.03.2022	\$ 20.500	20.861	0,03
								3,340 % fällig am 07.01.2022	3.408	3.441	0,00
								3,350 % fällig am 01.11.2022	30.003	30.788	0,04
								3,375 % fällig am 13.11.2025	22.860	23.733	0,03
								3,550 % fällig am 07.10.2022	€ 49.800	51.201	0,07
								3,664 % fällig am 08.09.2024	5.300	5.571	0,01
								3,810 % fällig am 09.01.2024	1.300	1.362	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS			
3,813 % fällig am 12.10.2021	\$	6.661	\$ 6.719	0,01	International Lease Finance Corp.			6,125 % fällig am 25.03.2024	\$	8.598	\$ 9.306	0,01		
4,063 % fällig am 01.11.2024		3.710	3.951	0,01	8,625 % fällig am 15.01.2022	\$	2.280	\$ 2.378	0,00	6,500 % fällig am 15.06.2022		26.830	28.009	0,04
4,140 % fällig am 15.02.2023		35.491	36.822	0,05	Intesa Sanpaolo SpA			7,250 % fällig am 25.01.2022		66.765	69.332	0,10		
4,250 % fällig am 20.09.2022		16.420	16.999	0,02	7,750 % fällig am			7,250 % fällig am 25.09.2023		1.976	2.186	0,00		
4,375 % fällig am 06.08.2023		17.192	18.176	0,03	11.01.2027 (i)(k)	€	14.475	21.060	0,03	Newmark Group, Inc.				
4,389 % fällig am 08.01.2026		3.949	4.270	0,01	Itau Unibanco Holding S.A.			6,125 % fällig am 15.11.2023	10.106	11.136	0,02			
4,535 % fällig am 06.03.2025	£	4.279	6.348	0,01	3,250 % fällig am 24.01.2023	\$	30.000	30.723	0,04	Nissan Motor Acceptance Corp.				
4,687 % fällig am 09.06.2025	\$	2.368	2.571	0,00	4,250 % fällig am			0,836 % fällig am 28.09.2022	2.300	2.303	0,00			
5,125 % fällig am 16.06.2025		12.028	13.261	0,02	24.10.2025 (i)(k)	€	2.600	3.280	0,00	1,078 % fällig am 13.01.2022	577	578	0,00	
5,584 % fällig am 18.03.2024		15.300	16.776	0,02	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.			1,900 % fällig am 14.09.2021	1.074	1.077	0,00			
5,596 % fällig am 07.01.2022		28.113	28.725	0,04	3,250 % fällig am 12.11.2025		24.100	30.815	0,04	2,000 % fällig am 09.03.2026	32.738	32.973	0,05	
5,875 % fällig am 02.08.2021		37.853	38.093	0,05	3,950 % fällig am 30.06.2022	£	9.328	13.170	0,02	2,600 % fällig am 28.09.2022	5.800	5.922	0,01	
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC					Kilroy Realty LP			2,650 % fällig am 13.07.2022	1.800	1.830	0,00			
6,500 % fällig am 01.10.2025		34.273	35.644	0,05	3,050 % fällig am 15.11.2032	\$	6.402	6.330	0,01	2,750 % fällig am 09.03.2028	21.400	21.616	0,03	
Gateway Casinos & Entertainment Ltd.					3,050 % fällig am 15.02.2030		1.036	1.080	0,00	2,800 % fällig am 13.01.2022	2.200	2.225	0,00	
5,000 % fällig am 12.03.2038	CAD	49.864	35.543	0,05	Legal & General Group PLC			Nordea Kredit Realkreditaktieselskab						
GE Capital Funding LLC					5,625 % fällig am			2,000 % fällig am 01.10.2047	DKK	0	0	0,00		
4,400 % fällig am 15.05.2030	\$	76.200	88.862	0,12	24.03.2031 (i)(k)	£	18.600	28.859	0,04	Nykredit Realkredit A/S				
Globalworth Real Estate Investments Ltd.					Lexington Realty Trust			2,000 % fällig am 01.07.2037	0	0	0,00			
3,000 % fällig am 29.03.2025	€	2.100	2.680	0,00	2,700 % fällig am 15.09.2030	\$	4.400	4.479	0,01	2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00	
GLP Capital LP					Lloyds Banking Group PLC			Omega Healthcare Investors, Inc.						
4,000 % fällig am 15.01.2031	\$	16.467	17.764	0,02	4,000 % fällig am 07.03.2025	AUD	21.100	17.303	0,02	3,250 % fällig am 15.04.2033	\$	12.852	12.840	0,02
5,250 % fällig am 01.06.2025		3.502	3.947	0,01	4,375 % fällig am 22.03.2028	\$	5.900	6.783	0,01	3,625 % fällig am 01.10.2029	9.874	10.591	0,01	
5,300 % fällig am 15.01.2029		16.214	18.930	0,03	4,947 % fällig am			4,500 % fällig am 15.01.2025	310	339	0,00			
Goodman U.S. Finance Three LLC					27.06.2025 (i)(k)	€	13.440	17.623	0,02	4,500 % fällig am 01.04.2027	310	347	0,00	
3,700 % fällig am 15.03.2028		21.137	22.933	0,03	5,125 % fällig am			4,750 % fällig am 15.01.2028	2.670	3.013	0,00			
Grainger PLC					12.12.2024 (i)(k)	£	8.800	12.917	0,02	5,250 % fällig am 15.01.2026	550	628	0,00	
3,375 % fällig am 24.04.2028	£	300	449	0,00	7,500 % fällig am			OneAmerica Financial Partners, Inc.						
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.					27.06.2024 (i)(k)	\$	24.502	27.937	0,04	4,250 % fällig am 15.10.2050	4.400	4.585	0,01	
5,872 % fällig am 02.05.2023	\$	7.200	7.728	0,01	7,500 % fällig am			OneMain Finance Corp.						
Horse Gallop Finance Ltd.					27.09.2025 (i)(k)			5,625 % fällig am 15.03.2023	111.724	119.465	0,17			
3,250 % fällig am 30.05.2022		69.200	70.456	0,10	7,625 % fällig am			6,125 % fällig am 15.05.2022	152.434	158.760	0,22			
Host Hotels & Resorts LP					27.06.2023 (i)(k)	£	92.702	140.472	0,20	6,125 % fällig am 15.03.2024	74.610	80.392	0,11	
3,375 % fällig am 15.12.2029		800	840	0,00	7,875 % fällig am			6,875 % fällig am 15.03.2025	19.042	21.515	0,03			
3,500 % fällig am 15.09.2030		5.000	5.253	0,01	27.06.2029 (i)(k)			Park Aerospace Holdings Ltd.						
3,875 % fällig am 01.04.2024		14.340	15.317	0,02	MDGH - GMTN BV			4,500 % fällig am 15.03.2023	40.005	42.061	0,06			
4,000 % fällig am 15.06.2025		1.430	1.549	0,00	3,950 % fällig am 21.05.2050	\$	34.800	39.871	0,06	5,250 % fällig am 15.08.2022	87.067	91.128	0,13	
HSBC Holdings PLC					MGM Growth Properties Operating Partnership LP			5,500 % fällig am 15.02.2024	49.488	54.432	0,08			
2,357 % fällig am 18.08.2031		46.700	46.775	0,07	3,875 % fällig am 15.02.2029		2.180	2.220	0,00	Physicians Realty LP				
2,804 % fällig am 24.05.2032		25.700	26.394	0,04	4,500 % fällig am 01.09.2026		4.925	5.267	0,01	3,950 % fällig am 15.01.2028	3.239	3.560	0,01	
2,848 % fällig am 04.06.2031		3.600	3.740	0,01	4,500 % fällig am 15.01.2028		400	424	0,00	Preferred Term Securities Ltd.				
3,000 % fällig am 29.05.2030	£	6.400	9.561	0,01	4,625 % fällig am 15.06.2025		4.858	5.200	0,01	0,319 % fällig am 22.12.2036	447	439	0,00	
3,973 % fällig am 22.05.2030	\$	46.600	52.201	0,07	5,625 % fällig am 01.05.2024		5.205	5.643	0,01	0,409 % fällig am 22.06.2037	19.271	17.055	0,02	
4,041 % fällig am 13.03.2028		18.500	20.529	0,03	5,750 % fällig am 01.02.2027		24.649	27.464	0,04	0,419 % fällig am 22.03.2037	20.297	18.065	0,03	
4,583 % fällig am 19.06.2029		15.300	17.695	0,02	Morgan Stanley			0,419 % fällig am 22.09.2037	17.646	16.235	0,02			
4,600 % fällig am 17.12.2030 (i)(k)		14.200	14.768	0,02	7,500 % fällig am			0,429 % fällig am 22.12.2036	26.156	25.633	0,04			
4,700 % fällig am 09.03.2031 (i)(k)		13.800	14.352	0,02	02.04.2032 (m)		68.500	55.595	0,08	0,459 % fällig am 22.09.2036	1.552	1.455	0,00	
4,750 % fällig am					MPT Operating Partnership LP			0,469 % fällig am 22.12.2035	13.253	11.944	0,02			
04.07.2029 (i)(k)	€	17.700	23.798	0,03	2,500 % fällig am 24.03.2026	£	6.800	9.581	0,01	0,489 % fällig am 22.03.2038	10.385	9.398	0,01	
4,950 % fällig am 31.03.2030	\$	1.600	1.933	0,00	3,375 % fällig am 24.04.2030		6.800	9.729	0,01	0,489 % fällig am 23.09.2035	1.518	1.484	0,00	
5,250 % fällig am					3,500 % fällig am 15.03.2031		26.100	26.393	0,04	0,499 % fällig am 22.03.2037	13.164	11.057	0,02	
16.09.2022 (i)(k)	€	600	746	0,00	3,692 % fällig am 05.06.2028	£	1.472	2.171	0,00	0,519 % fällig am 22.03.2038	14.071	12.281	0,02	
5,875 % fällig am					5,000 % fällig am 15.10.2027	\$	23.020	24.432	0,03	0,549 % fällig am 22.12.2035	2.241	1.894	0,00	
28.09.2026 (i)(k)	£	34.800	54.023	0,08	5,250 % fällig am 10.10.2026		750	775	0,00	0,569 % fällig am 22.03.2038	9.253	7.773	0,01	
6,000 % fällig am					National Health Investors, Inc.			0,599 % fällig am 22.03.2035	6.666	5.900	0,01			
29.09.2023 (i)(k)	€	27.240	35.471	0,05	3,000 % fällig am 01.02.2031		9.900	9.594	0,01	0,615 % fällig am 26.09.2034	11.635	11.053	0,02	
6,000 % fällig am					Nationwide Building Society			0,619 % fällig am 23.03.2035	4.160	3.900	0,01			
22.05.2027 (i)(k)	\$	19.111	21.261	0,03	3,960 % fällig am 18.07.2030		165.913	186.405	0,26	0,699 % fällig am 23.03.2035	10.000	8.800	0,01	
6,500 % fällig am 23.03.2028 (i)(k)		90.319	103.754	0,14	4,302 % fällig am 08.03.2029		34.100	38.546	0,05	1,019 % fällig am 22.03.2038	1.399	1.367	0,00	
IMMOFINANZ AG					5,750 % fällig am			1,055 % fällig am 03.07.2033	1.207	1.183	0,00			
2,500 % fällig am 15.10.2027	€	3.300	4.052	0,01	20.06.2027 (i)(k)	£	66.050	102.422	0,14	QNB Finance Ltd.				
2,625 % fällig am 27.01.2023		15.400	18.843	0,03	5,875 % fällig am			1,256 % fällig am 12.02.2022	169.400	170.145	0,24			
InCaps Funding Ltd.					20.12.2024 (i)(k)		19.500	29.705	0,04	3,500 % fällig am 28.03.2024	30.900	33.004	0,05	
2,135 % fällig am 01.06.2033	\$	4.103	3.857	0,01	Natwest Group PLC			Rayonier LP						
Indian Railway Finance Corp. Ltd.					4,445 % fällig am 08.05.2030	\$	121.125	138.836	0,19	2,750 % fällig am 17.05.2031	5.900	5.962	0,01	
3,249 % fällig am 13.02.2030		11.300	11.476	0,02	4,600 % fällig am			Realkredit Danmark A/S						
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.					28.06.2031 (i)(k)		21.300	21.453	0,03	2,500 % fällig am 01.04.2047	DKK	0	0	0,00
0,885 % fällig am 21.12.2021		21.400	21.411	0,03	4,892 % fällig am 18.05.2029		62.833	73.677	0,10	Sabra Health Care LP				
ING Groep NV					5,076 % fällig am 27.01.2030		134.670	159.850	0,22	3,900 % fällig am 15.10.2029	\$	6.600	6.987	0,01
4,875 % fällig am 16.05.2029 (i)(k)		2.142	2.242	0,00	5,125 % fällig am			4,800 % fällig am 01.06.2024	3.514	3.844	0,01			
5,750 % fällig am 16.11.2026 (i)(k)		34.550	38.296	0,05	12.05.2027 (i)(k)	£	18.400	27.430	0,04	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB				
6,875 % fällig am 16.04.2022 (i)(k)		7.490	7.801	0,01	6,000 % fällig am			1,000 % fällig am 12.08.2027	€	12.500	14.998	0,02		
Intercontinental Exchange, Inc.					29.12.2025 (i)(k)	\$	80.200	89.590	0,12	Santander Holdings USA, Inc.				
2,650 % fällig am 15.09.2040		18.200	17.507	0,02	8,000 % fällig am			4,400 % fällig am 13.07.2027	\$	11.232	12.630	0,02		
3,000 % fällig am 15.09.2060		41.800	40.530	0,06										

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
6,750 % fällig am 24.06.2024 (i)(k)	£ 61.153	\$ 94.459	0,13	Volkswagen Financial Services NV	£ 3.800	\$ 5.262	0,01	Broadcom Corp.	\$ 23.412	\$ 25.883	0,04
7,375 % fällig am 24.06.2022 (i)(k)	50.634	73.969	0,10	1,875 % fällig am 07.09.2021				3,875 % fällig am 15.01.2027			
SBA Communications Corp.				Voyager Aviation Holdings LLC	\$ 4.668	4.277	0,01	Broadcom, Inc.			
3,125 % fällig am 01.02.2029	\$ 21.600	20.876	0,03	8,500 % fällig am 09.05.2026				2,450 % fällig am 15.02.2031	57.900	56.943	0,08
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				Yango Group Co. Ltd.	CNY 50.000	7.358	0,01	2,600 % fällig am 15.02.2033	34.200	33.482	0,05
5,125 % fällig am 29.10.2022	6.100	6.382	0,01	6,900 % fällig am 31.10.2022				3,419 % fällig am 15.04.2033	31.564	33.184	0,05
5,125 % fällig am 07.02.2022	69.000	71.303	0,10					3,469 % fällig am 15.04.2034	142.800	151.194	0,21
Sitka Holdings LLC								3,500 % fällig am 15.02.2041	30.200	30.934	0,04
4,643 % fällig am 06.07.2026 (c)	87.221	87.163	0,12					3,750 % fällig am 15.02.2051	12.800	13.383	0,02
SL Green Operating Partnership LP				INDUSTRIEWERTE				4,110 % fällig am 15.09.2028	17.904	20.159	0,03
3,250 % fällig am 15.10.2022	2.006	2.066	0,00	AA Bond Co. Ltd.	£ 5.907	8.199	0,01	4,150 % fällig am 15.11.2030	43.715	49.071	0,07
SLM Corp.				2,875 % fällig am 31.07.2043	£ 16.680	24.555	0,03	4,300 % fällig am 15.11.2032	29.340	33.447	0,05
5,125 % fällig am 05.04.2022	46.130	47.143	0,07	4,875 % fällig am 31.07.2050	4.875	7.461	0,01	4,750 % fällig am 15.04.2029	50.010	58.228	0,08
SMBC Aviation Capital Finance DAC				5,500 % fällig am 31.07.2050				5,000 % fällig am 15.04.2030	45.757	54.038	0,08
2,650 % fällig am 15.07.2021	3.300	3.302	0,00	Aeroporti di Roma SpA	€ 47.238	58.464	0,08	Caesars Entertainment, Inc.			
3,000 % fällig am 15.07.2022	5.300	5.423	0,01	1,750 % fällig am 30.07.2031	€ 47.238	58.464	0,08	6,250 % fällig am 01.07.2025	57.165	60.666	0,08
Societe Generale S.A.				Air Canada Pass-Through Trust	\$ 37.791	41.077	0,06	Caesars Resort Collection LLC	24.850	26.217	0,04
2,889 % fällig am 09.06.2032	14.300	14.488	0,02	5,250 % fällig am 01.10.2030				5,750 % fällig am 01.07.2025			
4,750 % fällig am 26.05.2026 (i)(k)	1.900	1.974	0,00	Airbus SE	€ 25.600	35.345	0,05	California Institute of Technology			
5,375 % fällig am 18.11.2030 (i)(k)	18.400	19.527	0,03	2,375 % fällig am 09.06.2040	€ 25.600	35.345	0,05	4,283 % fällig am 01.09.2116	9.100	11.167	0,02
6,750 % fällig am 06.04.2028 (i)(k)	8.773	9.952	0,01	Aker BP ASA				Cameron LNG LLC			
7,375 % fällig am 13.09.2021 (i)(k)	31.350	31.709	0,04	1,125 % fällig am 12.05.2029	25.000	29.731	0,04	3,402 % fällig am 15.01.2038	800	848	0,00
7,375 % fällig am 04.10.2023 (i)(k)	47.030	51.413	0,07	3,750 % fällig am 15.01.2030	\$ 2.950	3.186	0,00	Carnival Corp.			
7,875 % fällig am 18.12.2023 (i)(k)	7.855	8.800	0,01	Alaska Airlines Pass-Through Trust				11,500 % fällig am 01.04.2023	48.734	54.907	0,08
Society of Lloyd's				4,800 % fällig am 15.02.2029	13.329	14.783	0,02	CCO Holdings LLC			
4,750 % fällig am 30.10.2024	£ 6.280	9.622	0,01	Alice Financing S.A.	€ 12.532	14.462	0,02	4,500 % fällig am 15.08.2030	20.303	21.165	0,03
Standard Chartered PLC				2,250 % fällig am 15.01.2025	€ 12.532	14.462	0,02	4,500 % fällig am 01.06.2033	49.319	50.528	0,07
4,750 % fällig am 14.01.2031 (i)(k)	\$ 26.300	27.078	0,04	3,000 % fällig am 15.01.2028	21.662	24.948	0,03	4,750 % fällig am 01.03.2030	22.200	23.504	0,03
7,500 % fällig am 02.04.2022 (i)(k)	7.016	7.326	0,01	7,500 % fällig am 15.05.2026	\$ 8.575	8.940	0,01	Cellnex Finance Co. S.A.			
Starwood Property Trust, Inc.				Alice France S.A.				3,875 % fällig am 07.07.2041 (c)	9.900	9.882	0,01
5,000 % fällig am 15.12.2021	3.400	3.421	0,00	7,375 % fällig am 01.05.2026	38.868	40.469	0,06	Centene Corp.			
Stichting AK Rabobank Certificaten				8,125 % fällig am 01.02.2027	24.392	26.606	0,04	2,450 % fällig am 15.07.2028 (c)	63.500	64.437	0,09
2,188 % (i)	€ 197.284	315.549	0,44	Amdocs Ltd.	17.400	17.420	0,02	4,250 % fällig am 15.12.2027	8.720	9.200	0,01
Summit Properties Ltd.				2,538 % fällig am 15.06.2030				4,625 % fällig am 15.12.2029	11.592	12.763	0,02
2,000 % fällig am 31.01.2025	7.300	8.636	0,01	American Airlines Pass-Through Trust				Champion Path Holdings Ltd.			
Sunac China Holdings Ltd.				3,000 % fällig am 15.04.2030	1.776	1.809	0,00	4,500 % fällig am 27.01.2026	10.800	11.252	0,02
8,350 % fällig am 19.04.2023	\$ 5.300	5.496	0,01	3,350 % fällig am 15.04.2031	11.735	11.965	0,02	4,850 % fällig am 27.01.2028	28.500	29.866	0,04
Svenska Handelsbanken AB				3,375 % fällig am 01.11.2028	12.473	12.420	0,02	Charter Communications Operating LLC			
4,375 % fällig am 01.03.2027 (i)(k)	9.200	9.763	0,01	3,575 % fällig am 15.07.2029	4.248	4.338	0,01	3,500 % fällig am 01.06.2041	22.200	22.387	0,03
4,750 % fällig am 01.03.2031 (i)(k)	14.600	15.468	0,02	3,700 % fällig am 01.04.2028	16.158	16.461	0,02	3,700 % fällig am 01.04.2051	20.286	20.112	0,03
Tesco Property Finance PLC				4,000 % fällig am 15.08.2030	5.957	6.026	0,01	3,850 % fällig am 01.04.2061	34.100	33.552	0,05
5,411 % fällig am 13.07.2044	£ 38.787	70.313	0,10	American Airlines, Inc.	17.366	18.408	0,03	3,900 % fällig am 01.06.2052	112.300	114.674	0,16
5,661 % fällig am 13.10.2041	8.092	15.014	0,02	5,500 % fällig am 20.04.2026	15.200	16.454	0,02	4,400 % fällig am 01.12.2061	54.400	58.566	0,08
5,744 % fällig am 13.04.2040	8.691	16.121	0,02	5,750 % fällig am 20.04.2029				4,800 % fällig am 01.03.2050	20.349	23.415	0,03
5,801 % fällig am 13.10.2040	28.825	53.525	0,07	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	9.939	12.116	0,02	China Resources Gas Group Ltd.			
6,052 % fällig am 13.10.2039	26.449	48.793	0,07	4,500 % fällig am 01.06.2050	3.449	4.256	0,01	4,500 % fällig am 05.04.2022	2.620	2.687	0,00
7,623 % fällig am 13.07.2039	5.114	10.527	0,01	4,600 % fällig am 01.06.2060				Citrix Systems, Inc.			
TP ICAP Ltd.				Arconic Corp.	877	936	0,00	3,300 % fällig am 01.03.2030	7.676	8.085	0,01
5,250 % fällig am 29.05.2026	45.339	71.664	0,10	6,000 % fällig am 15.05.2025				Clear Channel International BV			
U.S. Capital Funding Ltd.				Atlantia SpA	€ 100.000	122.207	0,17	6,625 % fällig am 01.08.2025	30.800	32.474	0,05
0,468 % fällig am 10.07.2043	\$ 5.715	5.030	0,01	1,875 % fällig am 12.02.2028				Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.			
0,926 % fällig am 01.08.2034	4.304	4.100	0,01	B.C. Unlimited Liability Co.	\$ 16.675	16.869	0,02	7,500 % fällig am 01.06.2029	30.000	31.098	0,04
UBS AG				4,375 % fällig am 15.01.2028	2.816	2.859	0,00	7,750 % fällig am 15.04.2028	37.789	39.633	0,05
5,125 % fällig am 15.05.2024 (k)	80.545	88.970	0,12	Baptist Healthcare System Obligated Group	13.100	14.166	0,02	CommonSpirit Health			
UBS Group AG				3,540 % fällig am 15.08.2050				3,910 % fällig am 01.10.2050	13.300	14.670	0,02
4,375 % fällig am 10.02.2031 (i)(k)	38.300	39.227	0,05	Bausch Health Cos., Inc.	22.000	22.577	0,03	Community Health Systems, Inc.			
5,125 % fällig am 29.07.2026 (i)(k)	20.500	22.358	0,03	6,125 % fällig am 15.04.2025				4,750 % fällig am 15.02.2031	109.800	110.349	0,15
5,750 % fällig am 19.02.2022 (i)(k)	€ 13.711	16.788	0,02	Boeing Co.				5,625 % fällig am 15.03.2027	283.140	302.624	0,42
6,875 % fällig am 07.08.2025 (i)(k)	\$ 15.436	17.612	0,02	3,250 % fällig am 01.02.2035	900	913	0,00	6,000 % fällig am 15.01.2029	59.680	63.937	0,09
7,000 % fällig am 31.01.2024 (i)(k)	9.906	10.916	0,02	3,600 % fällig am 01.05.2034	5.500	5.809	0,01	6,625 % fällig am 15.02.2025	69.050	73.106	0,10
7,000 % fällig am 19.02.2025 (i)(k)	2.841	3.284	0,00	5,040 % fällig am 01.05.2027	16.385	18.915	0,03	8,000 % fällig am 15.03.2026	95.253	102.756	0,14
7,125 % fällig am 10.08.2021 (i)(k)	25.794	25.955	0,04	5,150 % fällig am 01.05.2030	60.970	72.256	0,10	Connect Finco SARL			
UniCredit SpA				5,705 % fällig am 01.05.2040	45.647	58.874	0,08	6,750 % fällig am 01.10.2026	7.026	7.439	0,01
6,750 % fällig am 10.09.2021 (i)(k)	€ 26.650	31.996	0,04	5,805 % fällig am 01.05.2050	219.713	296.358	0,41	Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK)			
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 320.870	371.972	0,52	5,930 % fällig am 01.05.2060	129.249	178.812	0,25	10,000 % fällig am 09.11.2024 *(d)	7.352	1.875	0,00
9,250 % fällig am 03.06.2022 (i)(k)	€ 14.788	18.816	0,03	6,125 % fällig am 15.02.2033	14.822	18.792	0,03	Continental Airlines Pass-Through Trust			
Unique Pub Finance Co. PLC				Bombardier, Inc.				4,150 % fällig am 11.10.2025	398	423	0,00
5,659 % fällig am 30.06.2027	£ 5.208	8.112	0,01	6,000 % fällig am 15.10.2022	34.103	34.215	0,05	Corning, Inc.			
7,395 % fällig am 28.03.2024	6.368	9.417	0,01	6,125 % fällig am 15.01.2023	54.157	57.149	0,08	5,450 % fällig am 15.11.2079	7.044	9.884	0,01
Uniti Group LP				7,500 % fällig am 01.12.2024	23.212	24.286	0,03	CoStar Group, Inc.			
7,125 % fällig am 15.12.2024	\$ 3.125	3.234	0,00	7,500 % fällig am 15.03.2025	8.471	8.730	0,01	2,800 % fällig am 15.07.2030	11.362	11.561	0,02
7,875 % fällig am 15.02.2025	36.412	39.093	0,05	7,875 % fällig am 15.04.2027	26.977	28.023	0,04	CSC Holdings LLC			
VICI Properties LP				Bon Secours Mercy Health, Inc.	6.000	6.231	0,01	4,500 % fällig am 15.11.2031	33.700	33.949	0,05
3,500 % fällig am 15.02.2025	45.127	46.165	0,06	3,205 % fällig am 01.06.2050				CVS Pass-Through Trust			
3,750 % fällig am 15.02.2027	45.918	46.856	0,07	British Airways Pass-Through Trust	1.689	1.724	0,00	4,163 % fällig am 11.08.2036	1.561	1.741	0,00
4,125 % fällig am 15.08.2030	52.351	53.904	0,08	3,300 % fällig am 15.06.2034	2.912	3.051	0,00	5,926 % fällig am 10.01.2034	836	1.012	0,00
4,250 % fällig am 01.12.2026	40.800	42.492	0,06	3,800 % fällig am 20.03.2033	6.342	6.849	0,01	6,036 % fällig am 10.12.2028	3.308	3.876	0,01
4,625 % fällig am 01.12.2029	40.800	43.432	0,06	4,250 % fällig am 15.05.2034			</				

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
6,943 % fällig am 10.01.2030	\$ 6.295	\$ 7.660	0,01	IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)	€ 3.340	\$ 4.087	0,01	Mitchells & Butlers Finance PLC	\$ 5.220	\$ 4.964	0,01
7,507 % fällig am 10.01.2032	6.879	8.719	0,01	3,875 % fällig am 15.05.2027 (d)	€ 3.340	\$ 4.087	0,01	0,569 % fällig am 15.12.2030	€ 6.340	9.667	0,01
8,353 % fällig am 10.07.2031	5.416	7.102	0,01	IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar oder 6,750 % PIK)	\$ 11.602	12.194	0,02	6,013 % fällig am 15.12.2030	\$ 22.500	26.262	0,04
DAE Funding LLC				6,000 % fällig am 15.05.2027 (d)	16.730	18.310	0,03	Motorola Solutions, Inc.			
4,500 % fällig am 01.08.2022	15.500	15.569	0,02	IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar oder 7,125 % PIK)				4,600 % fällig am 23.05.2029			
5,000 % fällig am 01.08.2024	14.884	15.323	0,02	6,375 % fällig am 15.05.2029 (d)				NCL Corp. Ltd.	3.400	3.961	0,01
5,250 % fällig am 15.11.2021	48.568	48.991	0,07	IMCD NV	€ 13.800	17.167	0,02	10,250 % fällig am 01.02.2026			
Dell International LLC				2,500 % fällig am 26.03.2025				Netflix, Inc.	€ 44.605	60.960	0,08
5,300 % fällig am 01.10.2029	27.706	33.458	0,05	Imperial Brands Finance Netherlands BV	5.290	6.335	0,01	3,625 % fällig am 15.05.2027	20.466	28.912	0,04
6,020 % fällig am 15.06.2026	4.500	5.405	0,01	1,750 % fällig am 18.03.2033				3,625 % fällig am 15.06.2030	74.280	106.257	0,15
6,200 % fällig am 15.07.2030	12.332	15.871	0,02	Informa PLC	497	628	0,00	3,875 % fällig am 15.11.2029	72.140	107.056	0,15
Delta Air Lines, Inc.				2,125 % fällig am 06.10.2025				4,625 % fällig am 15.05.2029	\$ 16.200	19.313	0,03
3,625 % fällig am 15.03.2022	33.240	33.714	0,05	Integrus Baptist Medical Center, Inc.	\$ 10.500	11.884	0,02	4,875 % fällig am 15.06.2030	6.394	7.775	0,01
4,500 % fällig am 20.10.2025	20.600	22.147	0,03	Intelsat Connect Finance S.A.	24.150	8.045	0,01	5,375 % fällig am 15.11.2029			
4,750 % fällig am 20.10.2028	21.300	23.698	0,03	9,500 % fällig am 15.02.2023 ^				Nissan Motor Co. Ltd.	€ 56.900	73.594	0,10
7,000 % fällig am 01.05.2025	44.344	51.779	0,07	Intelsat Jackson Holdings S.A.				2,652 % fällig am 17.03.2026	86.900	116.854	0,16
Diamond Resorts International, Inc.				5,500 % fällig am 01.08.2023 ^	24.332	13.960	0,02	3,201 % fällig am 17.09.2028	\$ 56.700	60.586	0,08
7,750 % fällig am 01.09.2023	55.555	57.313	0,08	8,000 % fällig am 15.02.2024	46.123	47.711	0,07	3,522 % fällig am 17.09.2025	77.846	85.639	0,12
10,750 % fällig am 01.09.2024	1.044	1.088	0,00	8,500 % fällig am 15.10.2024 ^	233.385	138.531	0,19	4,345 % fällig am 17.09.2027	33.775	38.167	0,05
DISH DBS Corp.				9,750 % fällig am 15.07.2025 ^	222.507	129.966	0,18	4,810 % fällig am 17.09.2030			
5,875 % fällig am 15.07.2022	1.900	1.984	0,00	Intelsat Luxembourg S.A.	32.574	1.238	0,00	NMG Holding Co., Inc.	92.700	99.073	0,14
Dufry One BV	CHF 2.687	2.929	0,00	7,750 % fällig am 01.06.2021 ^				7,125 % fällig am 01.04.2026			
3,625 % fällig am 15.04.2026				InterContinental Hotels Group PLC	€ 30.600	37.841	0,05	Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK)	7.107	7.864	0,01
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.	\$ 10.800	12.217	0,02	1,625 % fällig am 08.10.2024	€ 10.750	15.135	0,02	11,000 % fällig am 15.02.2028 (d)			
4,700 % fällig am 07.05.2050				2,125 % fällig am 24.08.2026	€ 8.373	10.711	0,01	Nokia Oyj	€ 19.800	26.168	0,04
Energy Transfer LP	900	1.041	0,00	2,125 % fällig am 15.05.2027	€ 23.700	35.460	0,05	3,125 % fällig am 15.05.2028			
5,300 % fällig am 01.04.2044				3,375 % fällig am 08.10.2028				Norfolk Southern Corp.	\$ 5.000	5.499	0,01
Energy Transfer Partners LP				IQVIA, Inc.	€ 3.400	4.090	0,01	4,100 % fällig am 15.05.2121			
5,875 % fällig am 01.03.2022	3.050	3.116	0,00	2,875 % fällig am 15.09.2025				NXP BV	13.517	15.520	0,02
Exela Intermediate LLC				JetBlue Pass-Through Trust	\$ 45.322	50.142	0,07	4,300 % fällig am 18.06.2029			
10,000 % fällig am 15.07.2023	8.158	5.384	0,01	4,000 % fällig am 15.05.2034				Occidental Petroleum Corp.	22.542	22.436	0,03
Expedia Group, Inc.				Kraft Heinz Foods Co.	23.836	26.192	0,04	1,606 % fällig am 15.08.2022			
2,950 % fällig am 15.03.2031	25.967	26.367	0,04	3,750 % fällig am 01.04.2030	18.950	20.836	0,03	Oracle Corp.	27.699	29.485	0,04
4,625 % fällig am 01.08.2027	18.071	20.449	0,03	3,875 % fällig am 15.05.2027	16.365	18.608	0,03	3,850 % fällig am 01.04.2060	19.729	21.560	0,03
6,250 % fällig am 01.05.2025	27.596	32.123	0,04	4,250 % fällig am 01.03.2031	4.600	5.721	0,01	3,950 % fällig am 25.03.2051 (m)	3.708	4.028	0,01
F-Brasile SpA				5,200 % fällig am 15.07.2045	11.212	14.583	0,02	4,000 % fällig am 15.07.2046	1.500	1.639	0,00
7,375 % fällig am 15.08.2026	5.700	5.892	0,01	5,500 % fällig am 01.06.2050				4,000 % fällig am 15.11.2047	17.400	19.334	0,03
Ford Foundation				Las Vegas Sands Corp.	1.796	1.913	0,00	4,100 % fällig am 25.03.2061 (m)			
2,415 % fällig am 01.06.2050	4.100	3.956	0,01	3,900 % fällig am 08.08.2029				Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.	7.989	8.742	0,01
2,815 % fällig am 01.06.2070	7.900	7.970	0,01	Leidos, Inc.	2.400	2.348	0,00	7,250 % fällig am 01.02.2028	3.334	3.593	0,01
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	€ 3.102	3.808	0,01	2,300 % fällig am 15.02.2031	2.609	2.967	0,00	7,375 % fällig am 01.06.2025			
1,625 % fällig am 09.07.2024	50.000	62.181	0,09	4,375 % fällig am 15.05.2030				PeaceHealth Obligated Group	13.300	14.044	0,02
1,875 % fällig am 31.03.2028				Lendlease U.S. Capital, Inc.	9.423	10.421	0,01	3,218 % fällig am 15.11.2050			
Gap, Inc.				4,500 % fällig am 26.05.2026				Pelabuhan Indonesia Persero PT	9.600	10.217	0,01
8,375 % fällig am 15.05.2023	\$ 11.621	13.108	0,02	Level 3 Financing, Inc.	16.035	17.049	0,02	4,500 % fällig am 02.05.2023			
8,625 % fällig am 15.05.2025	51.603	56.676	0,08	3,400 % fällig am 01.03.2027	22.564	24.195	0,03	Petroleos de Venezuela S.A.	53.114	2.390	0,00
8,875 % fällig am 15.05.2027	28.069	32.551	0,05	3,875 % fällig am 15.11.2029				5,375 % fällig am 12.04.2027 ^			
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	€ 500	616	0,00	Live Nation Entertainment, Inc.	6.000	6.035	0,01	5,500 % fällig am 12.04.2037 ^	50.574	2.276	0,00
2,250 % fällig am 22.11.2024	56.890	71.034	0,10	3,750 % fällig am 15.01.2028				6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	47.576	2.141	0,00
2,949 % fällig am 24.01.2024	€ 500	736	0,00	Lundin Energy Finance BV	7.800	7.822	0,01	6,000 % fällig am 15.11.2026 ^	63.177	2.843	0,00
4,250 % fällig am 06.04.2024	\$ 1.600	1.668	0,00	2,000 % fällig am 15.07.2026	6.600	6.681	0,01	9,750 % fällig am 17.05.2035 ^	28.330	1.275	0,00
4,950 % fällig am 19.07.2022	20.300	22.722	0,03	3,100 % fällig am 15.07.2031				Petroleos Mexicanos	11.983	11.800	0,02
4,950 % fällig am 23.03.2027	24.600	27.547	0,04	Marriott International, Inc.	7.200	7.319	0,01	5,350 % fällig am 12.02.2028	120.615	117.328	0,16
4,950 % fällig am 06.02.2028	32.700	36.860	0,05	2,850 % fällig am 15.04.2031	1.678	1.934	0,00	5,950 % fällig am 28.01.2031	9.590	10.141	0,01
5,150 % fällig am 11.02.2026	30.930	32.208	0,04	4,625 % fällig am 15.06.2030				6,490 % fällig am 23.01.2027	102.375	108.185	0,15
6,510 % fällig am 07.03.2022	18.510	25.844	0,04	Marriott Ownership Resorts, Inc.	3.719	3.966	0,01	6,500 % fällig am 13.03.2027	171.345	176.571	0,25
7,288 % fällig am 16.08.2037	38.699	57.856	0,08	6,125 % fällig am 15.09.2025				6,500 % fällig am 23.01.2029	3.730	3.306	0,00
8,625 % fällig am 28.04.2034				Marvell Technology, Inc.	10.550	10.944	0,02	6,840 % fällig am 23.01.2030	95.292	98.317	0,14
General Electric Co.	€ 1.408	2.551	0,00	2,950 % fällig am 15.04.2031				6,950 % fällig am 28.01.2060	76.875	68.127	0,09
5,625 % fällig am 16.09.2031	\$ 5	7	0,00	Massachusetts Institute of Technology	375	548	0,00	7,690 % fällig am 23.01.2050	14.280	13.762	0,02
6,875 % fällig am 01.10.2039				4,678 % fällig am 01.07.2114	597	1.021	0,00	Petronas Capital Ltd.	8.700	10.757	0,01
Greene King Finance PLC	€ 4.380	6.630	0,01	5,600 % fällig am 01.07.2111				4,550 % fällig am 21.04.2050	5.800	7.709	0,01
4,064 % fällig am 15.03.2035	3.467	5.548	0,01	Melco Resorts Finance Ltd.	47.380	50.134	0,07	4,800 % fällig am 21.04.2060			
5,106 % fällig am 15.03.2034				5,375 % fällig am 04.12.2029	1.450	1.517	0,00	PetSmart, Inc.	3.800	3.952	0,01
Heathrow Funding Ltd.	\$ 10.610	10.626	0,01	5,625 % fällig am 17.07.2027				4,750 % fällig am 15.02.2028			
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				Memorial Sloan-Kettering Cancer Center	2.500	2.554	0,00	PTC, Inc.	5.682	5.871	0,01
3,625 % fällig am 15.02.2032	5.614	5.551	0,01	2,955 % fällig am 01.01.2050				3,625 % fällig am 15.02.2025			
3,750 % fällig am 01.05.2029	36.100	36.509	0,05	MGM China Holdings Ltd.	7.618	7.780	0,01	RAC Bond Co. PLC	€ 5.000	7.576	0,01
4,000 % fällig am 01.05.2031	40.953	41.371	0,06	4,750 % fällig am 01.02.2027	19.381	20.198	0,03	4,870 % fällig am 06.05.2046			
4,875 % fällig am 15.01.2030	1.419	1.518	0,00	5,250 % fällig am 18.06.2025	7.000	7.207	0,01	Rite Aid Corp.	\$ 6.037	6.135	0,01
Hyatt Hotels Corp.				5,375 % fällig am 15.05.2024	13.375	14.060	0,02	8,000 % fällig am 15.11.2026			
3,135 % fällig am 01.09.2022	45.500	45.673	0,06	5,875 % fällig am 15.05.2026				Roadster Finance DAC	€ 7.000	8.888	0,01
iHeartCommunications, Inc.				MGM Resorts International	7.750	13.947	0,02	2,375 % fällig am 08.12.2032			
6,375 % fällig am 01.05.2026	57.370	61.142	0,08	7,750 % fällig am 15.03.2022				Rockefeller Foundation	\$ 12.600	12.323	0,02
8,375 % fällig am 01.05.2027	40.687	43.637	0,06	Micron Technology, Inc.	27.749	32.306	0,04	2,492 % fällig am 01.10.2050			
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)	€ 13.327	16.075	0,02	4,663 % fällig am 15.02.2030	9.282	11.226	0,02	Rolls-Royce PLC	€ 14.176	16.591	0,02
3,625 % fällig am 15.05.2025 (d)				5,327 % fällig am 06.02.2029				0,875 % fällig am 09.05.2024	1.455	1.613	0,00
								1,625 % fällig am 09.05.2028			

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
4,250 % fällig am 15.03.2046 ^	\$ 25.035	\$ 23.920	0,03	Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2007				4,559 % fällig am 25.03.2035 (a)	\$ 186	\$ 24	0,00
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	65.134	62.765	0,09	5,000 % fällig am 01.07.2027 ^	\$ 5.015	\$ 4.614	0,01	5,000 % fällig am 25.08.2037	2	2	0,00
4,450 % fällig am 15.04.2042 ^	33.949	33.703	0,05	5,000 % fällig am 01.07.2028 ^	610	561	0,00	5,500 % fällig am 25.05.2038	107	143	0,00
4,500 % fällig am 01.07.2040	87.391	87.577	0,12	5,250 % fällig am 01.07.2032 ^	3.100	2.860	0,00	5,909 % fällig am 25.10.2049 (a)	64.139	11.448	0,02
4,500 % fällig am 15.12.2041 ^	4.657	4.547	0,01	5,250 % fällig am 01.07.2034 ^	3.098	2.858	0,00	5,959 % fällig am 25.04.2044 - 25.02.2049 (a)	24.208	3.166	0,00
4,550 % fällig am 01.07.2030	210.515	225.357	0,31	5,250 % fällig am 01.07.2037 ^	3.405	3.141	0,01	6,109 % fällig am 25.05.2048 (a)	22.817	5.202	0,01
4,600 % fällig am 15.06.2043 ^	41.543	41.357	0,06	Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2008				7,344 % fällig am 25.08.2033	254	283	0,00
4,650 % fällig am 01.08.2028	4.100	4.518	0,01	5,000 % fällig am 01.07.2023 ^	2.535	2.310	0,00	13,226 % fällig am 25.05.2041	52	76	0,00
4,750 % fällig am 15.02.2044 ^	31.088	31.533	0,04	5,125 % fällig am 01.07.2028 ^	1.070	982	0,00	39,051 % fällig am 25.07.2037	10	17	0,00
4,950 % fällig am 01.07.2050	158.571	163.367	0,23	5,500 % fällig am 01.07.2032 ^	9.320	8.504	0,01	Freddie Mac			
Pennsylvania Electric Co. 3,250 % fällig am 15.03.2028	2.360	2.481	0,00	5,700 % fällig am 01.07.2023 ^	4.565	4.086	0,01	0,847 % fällig am 25.01.2023 (a)	24.031	222	0,00
Petrobras Global Finance BV				5,900 % fällig am 01.07.2028 ^	1.195	1.071	0,00	1,111 % fällig am 25.04.2029 (a)	42.970	2.451	0,00
6,250 % fällig am 14.12.2026	£ 37.833	60.075	0,08	6,000 % fällig am 01.07.2038 ^	3.520	3.274	0,01	2,500 % fällig am 15.09.2027 (a)	9.209	499	0,00
6,250 % fällig am 16.01.2034	6.800	10.853	0,02	Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2009				3,000 % fällig am 15.12.2032 - 15.04.2049 (a)	5.968	1.047	0,00
6,850 % fällig am 05.06.2115	\$ 2.868	3.282	0,00	5,750 % fällig am 01.07.2038 ^	4.360	3.935	0,01	3,000 % fällig am 01.11.2046 - 01.05.2049	2.580	2.746	0,00
ReNew Power Synthetic 6,870 % fällig am 12.03.2024	6.675	7.024	0,01	6,500 % fällig am 01.07.2037 ^	3.100	2.871	0,00	3,037 % fällig am 25.12.2047	11.773	12.117	0,02
Rio Oil Finance Trust				Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2011				3,045 % fällig am 25.10.2046	7.697	7.859	0,01
8,200 % fällig am 06.04.2028	16.608	19.232	0,03	5,375 % fällig am 01.07.2030 ^	5.700	5.094	0,01	3,500 % fällig am 15.12.2032 - 15.06.2049 (a)	12.550	1.610	0,00
9,250 % fällig am 06.07.2024	18.681	20.736	0,03	5,750 % fällig am 01.07.2041 ^	14.805	13.250	0,02	3,500 % fällig am 01.07.2046 - 01.05.2049	12.441	13.354	0,02
9,750 % fällig am 06.01.2027	9.748	11.539	0,02	5,500 % fällig am 01.07.2048 ^	990	907	0,00	4,000 % fällig am 01.04.2025 - 01.08.2048	18.971	20.327	0,03
S.A. Global Sukuk Ltd.				Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2012				4,000 % fällig am 15.06.2049 (a)	7.060	1.131	0,00
1,602 % fällig am 17.06.2026	15.000	15.005	0,02	5,000 % fällig am 01.07.2041 ^	31.225	26.268	0,04	4,322 % fällig am 25.10.2052	124.473	143.829	0,20
2,694 % fällig am 17.06.2031	15.800	16.016	0,02	5,125 % fällig am 01.07.2037 ^	6.540	5.633	0,01	4,438 % fällig am 25.11.2052	148.172	170.602	0,24
San Diego Gas & Electric Co. 3,750 % fällig am 01.06.2047	276	316	0,00	5,500 % fällig am 01.07.2026 ^	14.605	12.889	0,02	4,500 % fällig am 01.08.2048	20.653	22.282	0,03
Southern California Edison Co.				5,500 % fällig am 01.07.2039 ^	36.515	32.224	0,05	4,500 % fällig am 15.05.2049 (a)	5.644	1.013	0,00
4,650 % fällig am 01.10.2043	27.323	31.469	0,04	Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2014				5,000 % fällig am 15.02.2049 (a)	1.103	190	0,00
4,875 % fällig am 01.03.2049	6.798	8.070	0,01	8,000 % fällig am 01.07.2035 ^	97.685	81.079	0,11	5,500 % fällig am 01.08.2033 - 01.04.2036	0	0	0,00
6,650 % fällig am 01.04.2029	4.654	5.815	0,01	Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Notes, Series 2006				5,909 % fällig am 25.12.2049 (a)	44.726	6.097	0,01
Southern California Gas Co. 5,125 % fällig am 15.11.2040	482	631	0,00	5,250 % fällig am 01.07.2016 ^	4.415	4.023	0,01	6,000 % fällig am 01.01.2033	0	0	0,00
Sprint Communications, Inc. 6,000 % fällig am 15.11.2022	104.716	110.999	0,15	Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Notes, Series 2007				6,077 % fällig am 15.11.2042 (a)	5.493	989	0,00
11,500 % fällig am 15.11.2021	14.157	14.703	0,02	5,500 % fällig am 01.07.2017 ^	1.800	1.667	0,00	6,127 % fällig am 15.01.2042 (a)	350	46	0,00
Sprint Corp.				Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Notes, Series 2012				6,500 % fällig am 01.02.2032 - 25.11.2049	4.423	5.166	0,01
7,125 % fällig am 15.06.2024	80.719	93.230	0,13	4,125 % fällig am 01.07.2022 ^	4.380	3.750	0,01	6,677 % fällig am 15.03.2037 (a)	101	20	0,00
7,250 % fällig am 15.09.2021	168.374	171.214	0,24	5,000 % fällig am 01.07.2021 ^	8.335	7.314	0,01	7,000 % fällig am 01.12.2025 - 01.06.2037	9	7	0,00
7,625 % fällig am 01.03.2026	20.490	25.052	0,03	Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010				7,944 % fällig am 15.10.2033	626	722	0,00
7,875 % fällig am 15.09.2023	187.491	213.238	0,30	6,630 % fällig am 01.02.2035	5.545	6.930	0,01	8,000 % fällig am 01.07.2030	0	0	0,00
Talen Energy Supply LLC 6,625 % fällig am 15.01.2028	1.488	1.365	0,00	6,725 % fällig am 01.04.2035	2.525	3.182	0,00	9,754 % fällig am 15.01.2041	629	790	0,00
Transocean Phoenix Ltd. 7,750 % fällig am 15.10.2024	10.749	11.165	0,02	7,350 % fällig am 01.07.2035	4.520	5.843	0,01	Ginnie Mae			
Transocean Proteus Ltd. 6,250 % fällig am 01.12.2024	276	280	0,00	Illinois State General Obligation Bonds, Series 2003				0,001 % fällig am 16.05.2050 (a)	3.638	0	0,00
Verizon Communications, Inc.				5,100 % fällig am 01.06.2033	7.430	8.743	0,01	0,557 % fällig am 20.08.2066	90	90	0,00
2,550 % fällig am 21.03.2031	5.700	5.830	0,01	Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, Series 2006				0,677 % fällig am 20.04.2062	865	871	0,00
3,400 % fällig am 22.03.2041	22.240	23.555	0,03	0,306 % fällig am 25.10.2036	10.192	10.066	0,01	0,707 % fällig am 20.01.2062	33	33	0,00
3,550 % fällig am 22.03.2051	8.400	8.987	0,01	Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				0,807 % fällig am 20.08.2066	6.534	6.586	0,01
3,700 % fällig am 22.03.2061	16.300	17.486	0,02	6,050 % fällig am 01.07.2032 ^	6.790	6.476	0,01	0,907 % fällig am 20.06.2066	12.431	12.657	0,02
		3.195.874	4,45	6,125 % fällig am 01.07.2040 ^	435	415	0,00	0,957 % fällig am 20.07.2066	3.634	3.709	0,01
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		25.669.312	35,71	Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, Series 2008				1,027 % fällig am 20.07.2065	18.449	18.818	0,03
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				5,375 % fällig am 01.07.2022 ^	2.355	2.299	0,00	1,031 % fällig am 20.06.2067	34.404	34.956	0,05
Multiplan Corp. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK) 6,000 % fällig am 15.10.2027 (d)	30.000	30.990	0,04	8,250 % fällig am 01.07.2024	9.142	9.228	0,01	1,249 % fällig am 20.09.2067	17.899	18.243	0,03
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				University of California Revenue Bonds, Series 2012				1,438 % fällig am 20.07.2067	20.298	20.670	0,03
Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015 7,750 % fällig am 01.01.2042	952	1.087	0,00	4,858 % fällig am 15.05.2112	12.280	17.337	0,02	2,125 % fällig am 20.12.2045	5.918	6.160	0,01
Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2017 7,045 % fällig am 01.01.2029	2.555	2.974	0,00					2,250 % fällig am 20.07.2045	13.432	13.968	0,02
Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2001								2,868 % fällig am 20.09.2066	12.487	13.225	0,02
5,125 % fällig am 01.07.2031 ^	15.000	13.762	0,02					3,032 % fällig am 20.09.2066	25.534	27.162	0,04
Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2004								3,187 % fällig am 20.05.2049 (a)	66.695	6.070	0,01
5,000 % fällig am 01.07.2025 ^	1.820	1.674	0,00					3,500 % fällig am 20.03.2043 (a)	1.229	141	0,00
5,000 % fällig am 01.07.2029 ^	2.180	2.006	0,00					3,707 % fällig am 20.01.2049 (a)	18.218	1.508	0,00
Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2006								6,000 % fällig am 15.04.2037 - 20.11.2038	0	0	0,00
5,000 % fällig am 01.07.2031 ^	2.770	2.524	0,00	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				6,075 % fällig am 16.01.2043 (a)	1.310	173	0,00
5,250 % fällig am 01.07.2023 ^	3.800	3.506	0,01	Fannie Mae				6,500 % fällig am 15.06.2023 - 15.09.2037	7	4	0,00
5,250 % fällig am 01.07.2026 ^	8.330	7.684	0,01	0,248 % fällig am 27.12.2022 (a)	68.694	205	0,00	7,000 % fällig am 15.05.2023 - 15.05.2038	4	3	0,00
				0,645 % fällig am 25.08.2022 (a)	6.066	16	0,00	7,500 % fällig am 20.11.2022 - 20.01.2030	1	0	0,00
				2,500 % fällig am 25.12.2027 - 25.02.2028 (a)	8.901	475	0,00	8,000 % fällig am 20.06.2022 - 15.05.2032	1	1	0,00
				2,576 % fällig am 25.01.2022 (a)	388	3	0,00	8,500 % fällig am 15.01.2031	0	0	0,00
				3,000 % fällig am 25.06.2042 - 25.02.2046 (a)	832	117	0,00	9,313 % fällig am 20.12.2040	2.564	2.884	0,00
				3,500 % fällig am 25.12.2049 (a)	9.146	1.597	0,00	9,828 % fällig am 20.12.2040	237	256	0,00
				4,500 % fällig am 25.09.2040	3.018	3.402	0,00	22,948 % fällig am 20.04.2037	11	16	0,00
				4,500 % fällig am 25.12.2042 (a)	210	34	0,00	Ginnie Mae, TBA			
								2,500 % fällig am 01.07.2051	28.600	29.547	0,04

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Uniform Mortgage-Backed Security				2,625 % fällig am 31.01.2026	\$ 1.012.400	\$ 1.095.369	1,52	0,382 % fällig am 25.07.2037	\$ 2.807	\$ 2.732	0,00
2,500 % fällig am 01.06.2031 - 01.03.2032	\$ 575	\$ 604	0,00	2,875 % fällig am 15.08.2028	500	556	0,00	0,413 % fällig am 20.02.2047	5.112	4.924	0,01
3,000 % fällig am 01.11.2024 - 01.09.2057	273.507	288.248	0,40			9.124.062	12,69	0,473 % fällig am 20.10.2036	3.127	2.635	0,00
3,500 % fällig am 01.11.2025 - 01.07.2050	370.147	391.735	0,54	NON-AGENCY-MBS				0,473 % fällig am 20.12.2046 ^	1.465	1.454	0,00
4,000 % fällig am 01.11.2023 - 01.01.2059	431.823	463.097	0,64	20 Times Square Trust	54.000	53.961	0,08	0,492 % fällig am 25.05.2037 ^	1.228	1.138	0,00
4,500 % fällig am 01.11.2023 - 01.08.2048	24.598	26.715	0,04	Adjustable Rate Mortgage Trust	13.756	6.712	0,01	0,512 % fällig am 29.04.2037	6.881	6.551	0,01
5,000 % fällig am 01.05.2026 - 01.04.2049	4.026	4.414	0,01	0,332 % fällig am 25.08.2036	6.013	2.516	0,00	0,513 % fällig am 20.04.2047 ^	985	966	0,00
5,500 % fällig am 01.05.2033 - 01.12.2034	2	2	0,00	0,432 % fällig am 25.05.2036	4.288	4.336	0,01	0,513 % fällig am 20.06.2047	738	675	0,00
6,000 % fällig am 01.06.2022 - 01.10.2038	3	1	0,00	0,512 % fällig am 25.06.2037	2.226	159	0,00	0,653 % fällig am 20.06.2047	3.032	2.806	0,00
6,500 % fällig am 01.07.2022 - 01.10.2039	2	1	0,00	0,612 % fällig am 25.01.2036	361	349	0,00	0,692 % fällig am 25.08.2036 ^	212	188	0,00
7,000 % fällig am 01.04.2029	0	0	0,00	0,632 % fällig am 25.02.2036	226	159	0,00	0,693 % fällig am 20.05.2047	1.997	2.014	0,00
7,500 % fällig am 01.05.2022 - 01.10.2030	2	1	0,00	1,242 % fällig am 25.01.2035 ^	1.884	1.757	0,00	1,999 % fällig am 20.07.2036	3.739	3.931	0,01
8,000 % fällig am 01.12.2022 - 01.03.2030	1	1	0,00	1,242 % fällig am 25.03.2035	2.528	2.358	0,00	2,410 % fällig am 20.06.2032	5	5	0,00
8,500 % fällig am 01.04.2025	0	0	0,00	2,146 % fällig am 25.08.2035	562	439	0,00	2,547 % fällig am 20.02.2036 ^	60	60	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				2,706 % fällig am 25.04.2035	8	8	0,00	2,603 % fällig am 20.07.2036	154	158	0,00
2,000 % fällig am 01.08.2036 - 01.08.2051	928.394	947.596	1,32	2,845 % fällig am 25.09.2035	4.299	3.568	0,01	2,784 % fällig am 20.05.2036 ^	405	406	0,00
2,500 % fällig am 01.07.2036 - 01.09.2051	1.747.950	1.803.962	2,51	2,992 % fällig am 25.01.2036	680	610	0,00	2,800 % fällig am 20.11.2035 ^	369	356	0,00
3,000 % fällig am 01.08.2036 - 01.09.2051	2.112.889	2.201.832	3,06	3,226 % fällig am 25.05.2036 ^	151	148	0,00	2,854 % fällig am 20.09.2035 ^	1.067	1.015	0,00
3,500 % fällig am 01.07.2051	4.152.208	4.373.144	6,08	3,720 % fällig am 25.03.2037	1.145	1.102	0,00	2,888 % fällig am 20.11.2034	60	60	0,00
4,000 % fällig am 01.07.2051	3.582.762	3.817.548	5,31	5,054 % fällig am 25.11.2037 ^	976	897	0,00	2,984 % fällig am 20.05.2035 ^	1.209	1.165	0,00
4,500 % fällig am 01.07.2051	50.500	54.335	0,08	Alliance Bancorp Trust	1.266	1.188	0,00	3,018 % fällig am 20.05.2036 ^	330	337	0,00
		15.032.313	20,91	0,332 % fällig am 25.07.2037	1.266	1.188	0,00	3,078 % fällig am 20.05.2036	1.785	1.818	0,00
US-SCHATZ Obligationen				American Home Mortgage Assets Trust				3,080 % fällig am 20.09.2046 ^	108	100	0,00
U.S. Treasury Bonds				0,212 % fällig am 25.10.2046	6.557	6.002	0,01	3,209 % fällig am 20.01.2047 ^	228	223	0,00
2,500 % fällig am 15.02.2045	59.000	63.854	0,09	0,217 % fällig am 25.03.2047	1.978	1.901	0,00	3,224 % fällig am 20.07.2047 ^	1.101	1.137	0,00
2,875 % fällig am 15.05.2043	69.079	79.468	0,11	0,282 % fällig am 25.10.2046	13.670	9.774	0,01	3,348 % fällig am 20.01.2047 ^	2.705	2.598	0,00
2,875 % fällig am 15.08.2045	510.010	589.739	0,82	0,382 % fällig am 25.08.2037 ^	2.562	2.441	0,00	3,363 % fällig am 20.06.2047	6.463	5.999	0,01
3,000 % fällig am 15.11.2044	371.252	437.178	0,61	0,472 % fällig am 25.09.2046 ^	3.102	3.012	0,01	3,389 % fällig am 20.11.2035	3.943	3.865	0,01
3,000 % fällig am 15.08.2048	81.815	97.711	0,13	0,816 % fällig am 25.02.2047	28.114	16.067	0,02	5,500 % fällig am 25.01.2036	149	141	0,00
3,000 % fällig am 15.02.2049	10.169	12.178	0,02	1,036 % fällig am 25.11.2046	33.910	14.580	0,02	5,500 % fällig am 25.03.2036 ^	78	77	0,00
3,125 % fällig am 15.02.2043	178.076	212.828	0,30	1,056 % fällig am 25.10.2046	4.982	4.078	0,01	5,750 % fällig am 25.11.2035	1	1	0,00
3,125 % fällig am 15.08.2044	283.117	339.862	0,47	2,852 % fällig am 25.11.2035 ^	1.790	1.560	0,00	5,750 % fällig am 25.03.2036	197	198	0,00
3,125 % fällig am 15.05.2048	55.840	68.118	0,09	6,750 % fällig am 25.11.2046	8.868	8.610	0,01	5,763 % fällig am 25.10.2036	278	278	0,00
3,375 % fällig am 15.05.2044	416.095	518.965	0,72	American Home Mortgage Investment Trust				5,773 % fällig am 25.05.2037	111	113	0,00
3,625 % fällig am 15.02.2044	145.436	188.027	0,26	0,282 % fällig am 25.05.2047	2.642	1.547	0,00	5,846 % fällig am 25.01.2037	254	259	0,00
3,750 % fällig am 15.11.2043	80.988	106.335	0,15	0,372 % fällig am 25.03.2046	10.646	10.263	0,02	5,847 % fällig am 25.01.2037	792	809	0,00
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (h)				0,452 % fällig am 25.12.2046	9.460	9.119	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2036 ^	756	719	0,00
0,125 % fällig am 15.10.2024	271.597	292.782	0,41	0,492 % fällig am 25.03.2046	4.116	3.997	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2036	309	303	0,00
0,125 % fällig am 15.07.2030	332.487	367.089	0,51	0,692 % fällig am 25.09.2045	1.631	1.498	0,00	6,000 % fällig am 25.09.2036 ^	1.031	1.025	0,00
0,250 % fällig am 15.07.2029	968.260	1.077.977	1,50	0,692 % fällig am 25.11.2045	7.798	6.793	0,01	6,000 % fällig am 26.10.2037	1.919	1.892	0,00
0,250 % fällig am 15.02.2050	130.741	148.290	0,21	0,917 % fällig am 25.02.2045	10.298	9.924	0,01	6,479 % fällig am 25.10.2036	688	682	0,00
0,375 % fällig am 15.01.2027	16.823	18.629	0,03	1,804 % fällig am 25.09.2035	4.085	2.367	0,00	14,839 % fällig am 26.07.2035	226	245	0,00
0,375 % fällig am 15.07.2027	4.540	5.066	0,01	1,921 % fällig am 25.12.2036	2.917	2.773	0,00	Banc of America Mortgage Trust			
0,625 % fällig am 15.02.2043	14.051	16.809	0,02	5,883 % fällig am 25.09.2035	15.384	11.141	0,02	2,533 % fällig am 20.10.2046 ^	589	571	0,00
0,750 % fällig am 15.07.2028	494.545	567.807	0,79	6,000 % fällig am 25.03.2047	982	910	0,00	2,581 % fällig am 25.09.2035 ^	917	783	0,00
0,750 % fällig am 15.02.2042	39.818	48.570	0,07	6,950 % fällig am 25.06.2036	7.761	2.044	0,00	2,613 % fällig am 25.01.2035	1.240	1.251	0,00
0,750 % fällig am 15.02.2045	158.614	195.947	0,27	Angel Oak Mortgage Trust				2,982 % fällig am 25.07.2035	1.569	1.572	0,00
0,875 % fällig am 15.01.2029	180.053	208.477	0,29	1,469 % fällig am 25.06.2065	5.584	5.622	0,01	3,109 % fällig am 20.11.2046 ^	262	253	0,00
0,875 % fällig am 15.02.2047	125.532	161.792	0,22	APS Resecuritization Trust				3,152 % fällig am 25.01.2036 ^	81	79	0,00
1,000 % fällig am 15.02.2046	54.874	71.839	0,10	1,098 % fällig am 27.06.2049	2.326	2.207	0,00	3,166 % fällig am 25.08.2035	2.325	2.340	0,00
1,000 % fällig am 15.02.2048	121.584	162.454	0,23	0,949 % fällig am 25.07.2058	£ 27.000	37.538	0,05	3,233 % fällig am 25.02.2036	382	340	0,00
1,000 % fällig am 15.02.2049	370.388	499.648	0,69	0,949 % fällig am 20.09.2048	67.854	94.054	0,13	6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	947	958	0,00
1,375 % fällig am 15.02.2044	15.350	21.214	0,03	BAMLL Re-REMIC Trust				6,000 % fällig am 25.05.2037	280	257	0,00
2,125 % fällig am 15.02.2040	20.258	30.235	0,04	6,010 % fällig am 17.06.2050	\$ 615	514	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2046 ^	25	25	0,00
2,125 % fällig am 15.02.2041	9.144	13.796	0,02	Banc of America Alternative Loan Trust				BCAP LLC Trust			
U.S. Treasury Notes				0,492 % fällig am 25.01.2037 ^	2.512	1.946	0,00	0,000 % fällig am 26.08.2036	1.263	639	0,00
1,125 % fällig am 29.02.2028	22.258	22.195	0,03	5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	209	208	0,00	0,262 % fällig am 26.01.2037	5.921	5.454	0,01
1,125 % fällig am 15.02.2031	439.881	427.097	0,60	5,913 % fällig am 25.10.2036	11.362	5.116	0,02	0,272 % fällig am 25.03.2037	8.586	8.436	0,01
1,500 % fällig am 15.08.2026	56.200	57.884	0,08	6,000 % fällig am 25.11.2035 ^	310	309	0,00	0,372 % fällig am 25.04.2037	2.590	2.471	0,00
2,000 % fällig am 15.02.2025	15.000	15.752	0,02	6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	482	475	0,00	0,472 % fällig am 25.10.2036	88	83	0,00
2,000 % fällig am 15.08.2025	110.000	115.788	0,16	6,000 % fällig am 25.06.2046 ^	774	761	0,00	0,499 % fällig am 26.07.2036	213	213	0,00
2,000 % fällig am 15.11.2026	9.100	9.606	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2046	2.499	2.267	0,00	0,512 % fällig am 25.04.2037	102	98	0,00
2,125 % fällig am 15.05.2025	132.200	139.626	0,20	6,000 % fällig am 25.07.2046 ^	1.966	1.913	0,00	0,512 % fällig am 26.07.2046	1.233	1.232	0,00
2,250 % fällig am 15.11.2025	57.430	61.116	0,09	6,500 % fällig am 25.03.2036 ^	3.000	2.997	0,01	0,512 % fällig am 25.05.2047	347	334	0,00
2,250 % fällig am 15.02.2027	262.600	280.736	0,39	Banc of America Funding Corp.				0,592 % fällig am 25.02.2047	1.471	1.484	0,00
2,375 % fällig am 15.05.2029	255.400	275.653	0,38	3,848 % fällig am 25.09.2048	3.140	3.253	0,01	0,967 % fällig am 26.11.2046	1.033	1.042	0,00
				Banc of America Funding Trust				1,292 % fällig am 25.10.2046	3.284	3.085	0,01
				0,152 % fällig am 25.01.2037 ^	3.031	2.731	0,00	1,392 % fällig am 25.09.2047	1.506	1.489	0,00
				0,192 % fällig am 25.04.2037 ^	4.511	4.218	0,01	2,829 % fällig am 26.03.2037	0	0	0,00
				0,222 % fällig am 26.10.2036	13.852	12.987	0,02	2,889 % fällig am 26.02.2036	2.946	2.991	0,01
				0,232 % fällig am 27.08.2036	17.60						

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
2,800 % fällig am 25.02.2047	\$ 2.990	\$ 2.954	0,01	2,573 % fällig am 25.07.2037	\$ 168	\$ 148	0,00	5,500 % fällig am 25.09.2035	\$ 1.486	\$ 1.475	0,00
2,849 % fällig am 25.07.2034	2	2	0,00	2,677 % fällig am 25.02.2037	2.324	2.367	0,00	6,000 % fällig am 25.12.2035	2.108	2.126	0,00
2,881 % fällig am 25.02.2036 ^	3.582	3.398	0,01	2,733 % fällig am 25.02.2037	257	260	0,00	6,000 % fällig am 25.11.2036	98	101	0,00
2,910 % fällig am 25.07.2036 ^	262	253	0,00	2,877 % fällig am 25.12.2035 ^	5.046	4.881	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2037	1.625	1.031	0,00
2,968 % fällig am 25.08.2035 ^	1.164	1.056	0,00	3,000 % fällig am 25.12.2035 ^	112	111	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
3,050 % fällig am 25.06.2035 ^	29	30	0,00	3,032 % fällig am 25.03.2037 ^	1.034	1.032	0,00	2,470 % fällig am 25.04.2035	672	673	0,00
3,068 % fällig am 25.08.2047 ^	2.368	2.161	0,00	3,059 % fällig am 25.07.2037	710	666	0,00	2,579 % fällig am 25.05.2035	69	72	0,00
3,128 % fällig am 25.10.2046	2.187	2.047	0,00	3,067 % fällig am 25.03.2037 ^	4.208	4.237	0,01	2,710 % fällig am 25.12.2035 ^	741	585	0,00
3,156 % fällig am 25.03.2035	20	20	0,00	3,101 % fällig am 25.01.2036 ^	759	731	0,00	2,818 % fällig am 25.08.2035	2.742	2.232	0,00
3,156 % fällig am 25.05.2047 ^	4.813	4.789	0,01	5,250 % fällig am 25.05.2035	2	2	0,00	3,250 % fällig am 25.07.2067	9.035	9.153	0,01
3,196 % fällig am 25.05.2047 ^	137	136	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035	2.823	2.661	0,00	5,750 % fällig am 25.11.2035 ^	3.305	3.024	0,01
Bear Stearns ALT-A Trust				6,000 % fällig am 25.05.2036	3.395	2.384	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates			
0,412 % fällig am 25.08.2036	7.747	7.349	0,01	6,000 % fällig am 25.11.2036 ^	1.062	719	0,00	2,351 % fällig am 25.09.2035 ^	1.528	1.466	0,00
0,412 % fällig am 25.06.2046 ^	4.177	3.928	0,01	6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	2.862	1.975	0,00	CitiMortgage Alternative Loan Trust			
0,432 % fällig am 25.08.2036 ^	23.483	22.237	0,03	ChaseFlex Trust				0,592 % fällig am 25.05.2037	5.849	4.846	0,01
0,432 % fällig am 25.12.2046 ^	7.219	7.000	0,01	0,392 % fällig am 25.07.2037	8.576	7.937	0,01	0,642 % fällig am 25.01.2037	6.405	5.306	0,01
0,532 % fällig am 25.04.2035	18	18	0,00	4,491 % fällig am 25.09.2036	817	821	0,00	0,642 % fällig am 25.02.2037 ^	2.125	1.751	0,00
0,532 % fällig am 25.04.2036 ^	4.311	5.566	0,01	5,000 % fällig am 25.07.2037 ^	1.703	1.226	0,00	0,692 % fällig am 25.03.2037	3.645	3.057	0,01
0,572 % fällig am 25.02.2036	1.886	1.902	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2035	2.617	2.527	0,00	0,742 % fällig am 25.12.2036	1.644	1.373	0,00
0,592 % fällig am 25.01.2036 ^	963	1.217	0,00	ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust				5,750 % fällig am 25.12.2036 ^	2.735	2.746	0,00
0,632 % fällig am 25.10.2035	6.645	6.666	0,01	0,422 % fällig am 25.08.2037 ^	818	674	0,00	5,750 % fällig am 25.04.2037	5.212	5.200	0,01
0,732 % fällig am 25.04.2034	4	4	0,00	0,552 % fällig am 25.08.2037 ^	7.594	7.141	0,01	6,000 % fällig am 25.09.2036	259	254	0,00
0,792 % fällig am 25.10.2035	723	670	0,00	Chester A PLC				6,000 % fällig am 25.10.2036 ^	295	294	0,00
0,812 % fällig am 25.08.2035	6.000	5.798	0,01	0,000 % fällig am 17.03.2046 (f)(m)	£ 13.675	16.209	0,02	6,000 % fällig am 25.11.2036	4.292	4.285	0,01
1,217 % fällig am 25.01.2035	2.673	2.836	0,00	0,000 % fällig am 20.05.2046	1	12.451	0,02	6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	605	608	0,00
2,169 % fällig am 25.10.2033	3	3	0,00	0,849 % fällig am 17.03.2046 (m)	99.831	139.017	0,19	6,000 % fällig am 25.06.2037	9.161	9.202	0,01
2,440 % fällig am 25.09.2034	324	321	0,00	1,299 % fällig am 17.03.2046 (m)	14.727	20.326	0,03	Commercial Mortgage Trust			
2,624 % fällig am 25.05.2035	491	503	0,00	1,799 % fällig am 17.03.2046 (m)	13.675	18.989	0,03	0,248 % fällig am 10.04.2047 (a)	58.900	278	0,00
2,667 % fällig am 25.01.2036 ^	1.167	1.168	0,00	2,299 % fällig am 17.03.2046 (m)	8.415	11.637	0,02	1,182 % fällig am 10.08.2046 (a)	14.767	269	0,00
2,816 % fällig am 25.09.2035	2.083	1.944	0,00	3,049 % fällig am 17.03.2046 (m)	4.207	5.747	0,01	1,535 % fällig am 10.10.2049 (a)	75.346	3.952	0,01
2,934 % fällig am 25.08.2046 ^	5.291	4.222	0,01	Chester B1 Issuer PLC				1,776 % fällig am 15.08.2045 (a)	62.792	614	0,00
2,992 % fällig am 25.01.2047	670	468	0,00	1,349 % fällig am 17.01.2058	20.776	28.799	0,04	3,140 % fällig am 10.10.2036	10.000	10.612	0,02
3,008 % fällig am 25.09.2035 ^	1.911	1.497	0,00	1,649 % fällig am 17.01.2058	2.045	2.832	0,00	3,505 % fällig am 10.08.2048	8.607	9.158	0,01
3,051 % fällig am 25.09.2035 ^	2.393	1.413	0,00	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				3,651 % fällig am 10.02.2049	14.511	15.502	0,02
3,089 % fällig am 25.11.2036 ^	6.180	4.156	0,01	0,242 % fällig am 25.01.2036	\$ 434	407	0,00	3,961 % fällig am 10.05.2051	40.000	44.644	0,06
3,123 % fällig am 25.09.2035 ^	4.148	2.326	0,00	0,272 % fällig am 25.05.2036	1.001	955	0,00	Countrywide			
3,144 % fällig am 25.07.2035	1.156	1.091	0,00	0,292 % fällig am 25.01.2036	1.182	1.123	0,00	5,693 % fällig am 27.11.2035	1	1	0,00
3,245 % fällig am 25.05.2036 ^	1.923	1.862	0,00	0,292 % fällig am 25.10.2036	1.412	1.368	0,00	Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust			
3,246 % fällig am 25.12.2046 ^	315	255	0,00	0,322 % fällig am 25.10.2035	1.240	1.238	0,00	1,981 % fällig am 25.03.2047	2.170	2.132	0,00
3,389 % fällig am 25.08.2036 ^	2.155	1.423	0,00	0,342 % fällig am 25.08.2035	1.150	1.184	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	340	272	0,00
3,448 % fällig am 25.09.2047	23.226	17.607	0,03	0,362 % fällig am 25.05.2035	937	939	0,00	6,250 % fällig am 25.08.2037	1.467	1.109	0,00
3,952 % fällig am 25.07.2035 ^	357	299	0,00	0,372 % fällig am 25.01.2035	672	686	0,00	7,000 % fällig am 25.01.2037 ^	308	110	0,00
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				0,392 % fällig am 25.08.2035	191	198	0,00	Countrywide Alternative Loan Trust			
0,492 % fällig am 25.10.2034	84	73	0,00	0,412 % fällig am 25.05.2035	258	260	0,00	0,222 % fällig am 25.03.2047 ^	6.472	5.522	0,01
0,692 % fällig am 25.12.2035	3.550	2.144	0,00	0,452 % fällig am 25.03.2035	236	243	0,00	0,232 % fällig am 25.08.2037	9.678	9.505	0,01
5,125 % fällig am 25.03.2034	603	638	0,00	0,626 % fällig am 25.08.2035	1.210	1.031	0,00	0,232 % fällig am 25.04.2047	8.308	7.553	0,01
5,500 % fällig am 25.08.2035	2.636	2.162	0,00	0,672 % fällig am 25.10.2035	591	594	0,00	0,252 % fällig am 25.09.2047	4.824	4.697	0,01
5,500 % fällig am 25.09.2035	237	240	0,00	0,772 % fällig am 25.10.2034	662	662	0,00	0,262 % fällig am 25.05.2047	4.728	4.498	0,01
5,750 % fällig am 25.11.2034 ^	1.994	1.976	0,00	Ciel No. 1 PLC				0,272 % fällig am 25.06.2047	6.406	5.654	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2037	1.474	1.294	0,00	1,134 % fällig am 12.06.2046	£ 14.166	19.651	0,03	0,273 % fällig am 20.02.2047 ^	2.206	1.731	0,00
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				Citigroup Commercial Mortgage Trust				0,282 % fällig am 25.07.2046 ^	2.602	2.458	0,00
0,232 % fällig am 25.03.2037	3.207	3.054	0,01	0,457 % fällig am 10.03.2047 (a)	\$ 25.416	209	0,00	0,283 % fällig am 20.03.2047	7.263	6.281	0,01
0,252 % fällig am 25.12.2046	3.993	3.910	0,01	1,173 % fällig am 15.07.2030	5.280	5.255	0,01	0,288 % fällig am 20.12.2046 ^	11.914	10.429	0,02
0,252 % fällig am 25.06.2047	3.615	3.445	0,01	Citigroup Mortgage Loan Trust				0,302 % fällig am 25.07.2046	6.297	6.014	0,01
0,262 % fällig am 25.06.2047	8.690	8.299	0,01	0,222 % fällig am 25.06.2036	6.637	6.011	0,01	0,312 % fällig am 25.09.2047	5.472	5.204	0,01
0,272 % fällig am 25.10.2036	1.344	1.283	0,00	0,412 % fällig am 25.09.2036	752	735	0,00	0,321 % fällig am 20.07.2035	2.407	2.422	0,00
0,282 % fällig am 25.01.2037	2.452	2.288	0,00	0,592 % fällig am 25.09.2036	6.979	6.827	0,01	0,332 % fällig am 25.06.2036	2.472	2.400	0,00
0,292 % fällig am 25.02.2037 ^	12.115	11.494	0,02	1,613 % fällig am 25.08.2036	12.017	5.458	0,01	0,332 % fällig am 25.01.2037	4.531	4.348	0,01
0,292 % fällig am 25.09.2047	15.559	15.355	0,02	2,107 % fällig am 25.03.2037 ^	554	490	0,00	0,332 % fällig am 25.12.2046	934	906	0,00
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				2,242 % fällig am 25.03.2037 ^	4.846	4.368	0,01	0,342 % fällig am 25.06.2037	5.082	4.038	0,01
2,986 % fällig am 26.12.2046 ^	2.434	2.139	0,00	2,250 % fällig am 25.07.2036 ^	2.115	1.721	0,00	0,372 % fällig am 25.08.2047 ^	7.219	6.995	0,01
3,227 % fällig am 26.01.2036 ^	2.451	2.101	0,00	2,393 % fällig am 25.07.2036 ^	190	152	0,00	0,373 % fällig am 20.09.2046	7.166	4.855	0,01
BellaVista Mortgage Trust				2,622 % fällig am 20.02.2036	2.784	2.604	0,00	0,392 % fällig am 25.08.2035 ^	359	259	0,00
0,811 % fällig am 22.01.2045	664	641	0,00	2,640 % fällig am 25.11.2036	848	702	0,00	0,392 % fällig am 25.11.2035 ^	1.305	116	0,00
BNPP Mortgage Securities LLC Trust				2,887 % fällig am 25.03.2036 ^	521	519	0,00	0,432 % fällig am 25.06.2046	5	22	0,00
6,000 % fällig am 27.08.2037	1.337	497	0,00	2,887 % fällig am 25.04.2037 ^	431	431	0,00	0,432 % fällig am 25.07.2046	158	267	0,00
Business Mortgage Finance PLC				2,952 % fällig am 25.08.2047 ^	320	310	0,00	0,442 % fällig am 25.05.2036 ^	2.401	1.216	0,00
0,000 % fällig am 15.08.2040	€ 238	282	0,00	2,966 % fällig am 25.11.2036 ^	3.796	3.729	0,01	0,442 % fällig am 25.10.2036 ^	1.888	896	0,00
BXP Trust				2,995 % fällig am 25.11.2038	565	570	0,00	0,442 % fällig am 25.11.2036	7.187	7.086	0,01
3,379 % fällig am 13.06.2039	\$ 90.000	98.605	0,14	2,996 % fällig am 25.08.2035 ^	555	475	0,00	0,452 % fällig am 25.09.2046	2.638	2.480	0,00
Canada Square Funding PLC				3,037 % fällig am 25.02.2037	3.620	3.189	0,01	0,462 % fällig am 25.02.2037 ^	956	235	0,00
0,999 % fällig am 17.06.2058	£ 19.771	27.476	0,04	3,055 % fällig am 25.04.2036	273	204	0,00	0,472 % fällig am 25.08.2046	18.712	16.832	0,02
1,149 % fällig am 17.10.2051	27.601	38.337	0,05	3,065 % fällig am 25.07.2037 ^	2.035	1.968	0,00	0,492 % fällig am 25.05.2036	4.863	4.338	0,01
1,299 % fällig am 17.12.2057	15.167	21.259	0,03	3,083 % fällig am 25.05.2042	1.306	1.295	0,00	0,492 % fällig am 25.12.2036 ^	4.273	438	0,00
Canterbury Finance PLC				3,188 % fällig am 25.06.2036 ^	2.660	2.588	0,00	0,492 % fällig am 25.04.2037 ^	2.311	722	0,00
1,219 % fällig am 16.05.2056											

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VER- MÖGENS
0,592 % fällig am 25.05.2035 ^	\$ 4.221	\$ 3.510	0,01	6,000 % fällig am 25.01.2036 ^	\$ 2.772	\$ 2.542	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2036	\$ 2.596	\$ 1.830	0,00
0,592 % fällig am 25.06.2035 ^	4.461	3.668	0,01	6,000 % fällig am 25.04.2036 ^	7.516	5.000	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2036	3.147	2.389	0,00
0,592 % fällig am 25.12.2035	2.181	1.528	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2036	1.750	1.283	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2037	1.640	1.194	0,00
0,592 % fällig am 25.07.2036 ^	2.730	1.369	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	48	32	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	53	39	0,00
0,592 % fällig am 25.09.2036	133	59	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2036 ^	21.744	18.763	0,03	6,000 % fällig am 25.03.2037	1.719	1.323	0,00
0,592 % fällig am 25.05.2037 ^	2.094	738	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2036 ^	2.235	1.760	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	3.469	2.580	0,00
0,592 % fällig am 25.05.2037	185	93	0,00	6,000 % fällig am 25.11.2036 ^	3.444	2.819	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2037	2.476	1.840	0,00
0,592 % fällig am 25.09.2037	964	418	0,00	6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	2.160	1.020	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	870	646	0,00
0,592 % fällig am 25.07.2046	3.520	3.291	0,01	6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	1.672	1.430	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	10.267	7.051	0,01
0,612 % fällig am 25.07.2035	1.559	1.543	0,00	6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	12.337	7.156	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2037	1.156	742	0,00
0,612 % fällig am 25.12.2035	250	236	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2037	1.982	1.146	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	39	28	0,00
0,632 % fällig am 25.01.2036	3.444	3.432	0,01	6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	2.137	1.235	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2037	4.178	2.925	0,01
0,632 % fällig am 25.07.2036	3.848	3.550	0,01	6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	3.094	2.456	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2037	2.009	1.871	0,00
0,642 % fällig am 25.08.2035 ^	4.139	3.513	0,01	6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	11.791	7.629	0,01	6,000 % fällig am 25.01.2038 ^	7.817	5.448	0,01
0,652 % fällig am 25.08.2035	4.324	4.131	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2037	7.110	4.857	0,01	6,250 % fällig am 25.09.2036 ^	538	355	0,00
0,652 % fällig am 25.02.2037	6.424	5.665	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	18.212	13.177	0,02	6,500 % fällig am 25.12.2037	4.952	3.129	0,01
0,652 % fällig am 25.10.2046	9.976	9.735	0,01	6,000 % fällig am 25.02.2047 ^	2.489	1.862	0,00	7,109 % fällig am 25.05.2036 (a)	390	105	0,00
0,672 % fällig am 25.02.2036 ^	1.458	1.431	0,00	6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	466	329	0,00	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust			
0,691 % fällig am 20.11.2035	2.578	2.474	0,00	6,409 % fällig am 25.09.2037 (a)	964	313	0,00	4,767 % fällig am 25.01.2034 ^	238	239	0,00
0,692 % fällig am 25.12.2035	2.105	1.856	0,00	6,500 % fällig am 25.08.2032	25	25	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2035 ^	462	469	0,00
0,692 % fällig am 25.01.2036	1.735	1.674	0,00	6,500 % fällig am 25.09.2037 ^	9.834	5.816	0,01	Countrywide Mortgage-Backed Securities, Inc.			
0,692 % fällig am 25.10.2036	731	303	0,00	6,750 % fällig am 25.10.2036 ^	1.473	673	0,00	5,945 % fällig am 27.11.2035	1.214	1.199	0,00
0,712 % fällig am 25.08.2035 ^	2.204	2.002	0,00	6,859 % fällig am 25.10.2037 ^ (a)	1.699	551	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
0,731 % fällig am 20.11.2035	8.942	8.268	0,01	7,000 % fällig am 25.10.2037	6.117	3.221	0,01	2,297 % fällig am 25.03.2033	105	107	0,00
0,732 % fällig am 25.11.2035	1.008	904	0,00	7,500 % fällig am 25.07.2036	2.366	2.233	0,00	3,160 % fällig am 25.06.2046	46.349	47.308	0,07
0,751 % fällig am 20.11.2035	13.233	12.707	0,02	Countrywide Asset-Backed Certificates				5,000 % fällig am 25.07.2035 ^	841	835	0,00
0,772 % fällig am 25.09.2035	729	521	0,00	0,572 % fällig am 25.04.2036 ^	945	873	0,00	5,500 % fällig am 25.07.2035	2.415	2.409	0,00
0,792 % fällig am 25.09.2035	6.091	5.793	0,01	0,812 % fällig am 25.11.2035	212	210	0,00	6,000 % fällig am 25.12.2035	2.191	1.505	0,00
0,792 % fällig am 25.02.2036	3.925	2.827	0,00	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				6,500 % fällig am 25.12.2035 ^	508	365	0,00
0,792 % fällig am 25.05.2036	5.053	2.378	0,00	0,392 % fällig am 25.05.2036	390	153	0,00	7,000 % fällig am 25.12.2035 ^	1.296	399	0,00
0,842 % fällig am 25.01.2036 ^	102	71	0,00	0,492 % fällig am 25.08.2035	2.879	2.253	0,00	7,000 % fällig am 25.01.2036 ^	4.837	1.073	0,00
0,892 % fällig am 25.12.2035 ^	452	372	0,00	0,492 % fällig am 25.09.2037 ^	4.758	2.109	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass- Through Certificates			
0,966 % fällig am 25.11.2046	7.940	7.220	0,01	0,492 % fällig am 25.04.2046	2.349	2.056	0,00	2,428 % fällig am 25.10.2033	6	6	0,00
0,992 % fällig am 25.12.2036 ^	954	346	0,00	0,532 % fällig am 25.05.2035 ^	4	4	0,00	5,632 % fällig am 25.07.2035	2.864	3.034	0,01
1,056 % fällig am 25.06.2046	8.082	7.275	0,01	0,572 % fällig am 25.03.2036	4.923	4.617	0,01	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
1,116 % fällig am 25.12.2035	1.363	1.329	0,00	0,672 % fällig am 25.04.2035	1.738	1.653	0,00	0,202 % fällig am 27.12.2036	302	301	0,00
1,116 % fällig am 25.02.2036	189	180	0,00	0,712 % fällig am 25.03.2035	128	124	0,00	0,262 % fällig am 27.11.2036	14.562	16.871	0,02
1,192 % fällig am 25.02.2036 ^	94	80	0,00	0,732 % fällig am 25.03.2035	2.000	1.869	0,00	0,292 % fällig am 27.02.2046	8.563	4.609	0,01
1,426 % fällig am 20.07.2035 ^	128	119	0,00	0,752 % fällig am 25.02.2035	2.838	2.576	0,00	0,372 % fällig am 27.10.2036	12.248	10.692	0,02
1,466 % fällig am 25.08.2035 ^	486	440	0,00	0,772 % fällig am 25.04.2046	7.454	2.892	0,00	0,382 % fällig am 27.07.2037	1.472	1.359	0,00
1,496 % fällig am 25.11.2047 ^	6.242	5.745	0,01	0,792 % fällig am 25.02.2035	3.824	3.673	0,01	0,592 % fällig am 30.11.2037	1.313	1.313	0,00
1,516 % fällig am 25.08.2035	974	947	0,00	0,812 % fällig am 25.03.2035	1.023	783	0,00	1,706 % fällig am 27.11.2037	2.371	2.385	0,00
1,552 % fällig am 25.11.2035	8.496	8.462	0,01	0,832 % fällig am 25.02.2035	3.255	3.046	0,01	2,387 % fällig am 26.06.2036	7.038	6.762	0,01
1,716 % fällig am 25.08.2035 ^	2.452	2.250	0,00	0,852 % fällig am 25.09.2034	1.76	178	0,00	2,814 % fällig am 27.01.2036	4.357	4.367	0,01
1,761 % fällig am 25.06.2035	2.511	2.411	0,00	2,109 % fällig am 20.02.2036 ^	2.301	2.311	0,00	3,000 % fällig am 27.06.2037	1.372	1.393	0,00
1,949 % fällig am 25.03.2047 ^	1.457	1.345	0,00	2,186 % fällig am 20.01.2035	69	67	0,00	3,107 % fällig am 27.07.2037	955	1.004	0,00
2,484 % fällig am 25.05.2035 ^	3.103	2.360	0,00	2,366 % fällig am 20.07.2034	254	246	0,00	3,143 % fällig am 27.02.2036	2.981	2.534	0,00
2,678 % fällig am 25.10.2035 ^	398	352	0,00	2,440 % fällig am 25.03.2037	2.485	2.415	0,00	3,320 % fällig am 26.08.2036	6.356	5.861	0,01
2,717 % fällig am 25.06.2037 ^	11.580	10.373	0,02	2,548 % fällig am 25.02.2035	2.918	2.608	0,00	5,750 % fällig am 26.12.2035	571	503	0,00
2,802 % fällig am 25.03.2047	1.002	1.001	0,00	2,575 % fällig am 25.04.2035 ^	2.548	2.095	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	1.598	1.536	0,00
2,820 % fällig am 25.04.2036 ^	447	423	0,00	2,586 % fällig am 20.12.2035	95	99	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
2,921 % fällig am 25.09.2034	71	72	0,00	2,605 % fällig am 25.05.2047	4.943	4.659	0,01	5,500 % fällig am 25.08.2036 ^	1.745	1.559	0,00
3,017 % fällig am 25.09.2034 ^	3.204	3.158	0,01	2,609 % fällig am 20.06.2035	31	33	0,00	5,942 % fällig am 25.02.2037 ^	1.153	397	0,00
4,052 % fällig am 25.07.2021 ^	28	28	0,00	2,664 % fällig am 20.03.2036	546	546	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2021 ^	15	10	0,00
5,000 % fällig am 25.08.2035	3.347	3.076	0,01	2,666 % fällig am 20.09.2035	115	100	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2036 ^	1.640	1.040	0,00
5,250 % fällig am 25.06.2035	989	945	0,00	2,707 % fällig am 20.10.2034	525	535	0,00	6,396 % fällig am 25.04.2036	352	246	0,00
5,250 % fällig am 25.06.2035 ^	993	948	0,00	2,713 % fällig am 20.12.2035	446	426	0,00	6,421 % fällig am 25.10.2037	5.551	4.769	0,01
5,500 % fällig am 25.04.2035	3.303	3.333	0,01	2,744 % fällig am 20.05.2036	2.851	2.662	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
5,500 % fällig am 25.05.2035	1.442	1.383	0,00	2,770 % fällig am 20.04.2035	172	183	0,00	1,073 % fällig am 15.07.2032	48.000	47.837	0,07
5,500 % fällig am 25.06.2035 ^	1.014	821	0,00	2,790 % fällig am 25.04.2037 ^	2.334	2.286	0,00	1,323 % fällig am 15.07.2032	22.200	21.989	0,03
5,500 % fällig am 25.07.2035 ^	379	358	0,00	2,799 % fällig am 20.02.2036	2.207	2.184	0,00	2,348 % fällig am 25.04.2058	78.053	78.248	0,11
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	6.140	5.769	0,01	2,837 % fällig am 25.01.2036 ^	265	269	0,00	2,500 % fällig am 25.07.2057	85.513	89.158	0,12
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	3.915	3.157	0,01	2,847 % fällig am 20.09.2035	3.015	2.828	0,00	2,856 % fällig am 25.09.2048	16.202	14.816	0,02
5,500 % fällig am 25.11.2035	14	10	0,00	2,866 % fällig am 20.10.2034	254	237	0,00	2,931 % fällig am 27.03.2036	990	1.000	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	4.397	4.373	0,01	2,880 % fällig am 20.04.2036	688	658	0,00	2,942 % fällig am 25.06.2048	67.902	67.237	0,09
5,500 % fällig am 25.12.2035	7.233	6.299	0,01	2,890 % fällig am 25.08.2034 ^	574	541	0,00	2,982 % fällig am 01.06.2050	177.964	182.360	0,25
5,500 % fällig am 25.01.2036 ^	1.180	1.091	0,00	2,992 % fällig am 25.08.2034 ^	42	42	0,00	3,084 % fällig am 25.07.2057	53.326	41.024	0,06
5,500 % fällig am 25.02.2036	2.263	2.185	0,00	3,014 % fällig am 20.09.2036 ^	3.151	3.041	0,01	3,276 % fällig am 25.07.2058	346.451	338.814	0,47
5,500 % fällig am 25.02.2036 ^	2.087	1.765	0,00	3,015 % fällig am 20.04.2035	945	936	0,00	3,434 % fällig am 25.07.2057	4.445	3.942	0,01
5,500 % fällig am 25.04.2036	791	765	0,00	3,015 % fällig am 20.06.2036	2.436	2.330	0,00	3,726 % fällig am 25.10.2058	742	756	0,00
5,500 % fällig am 25.04.2037 ^	592	439	0,00	3,114 % fällig am 20.05.2036 ^	1.746	1.694	0,00	4,324 % fällig am 25.09.2057	41.360	44.112	0,06
5,750 % fällig am 25.07.2035 ^	137	115	0,00	3,125 % fällig am 25.11.2037	2.573	2.444	0,00	4,456 % fällig am 25.12.2048	17.203	17.716	0,03
5,750 % fällig am 25.05.2036 ^	6.202	3.794	0,01	3,138 % fällig am 25.11.2037	2.1						

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
0,332 % fällig am 25.08.2036 ^	\$ 719	\$ 699	0,00	2,568 % fällig am 25.01.2037 ^	\$ 1.199	\$ 1.059	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2036	\$ 2.293	\$ 1.788	0,00
0,332 % fällig am 25.01.2047	4.349	3.958	0,01	2,629 % fällig am 25.09.2035 ^	201	199	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	520	451	0,00
0,392 % fällig am 25.09.2047 ^	14.539	13.276	0,02	2,640 % fällig am 25.11.2036 ^	1.070	879	0,00	6,250 % fällig am 25.08.2036	1.250	640	0,00
0,422 % fällig am 25.08.2037 ^	17.399	14.892	0,02	2,753 % fällig am 25.02.2036	140	119	0,00	6,500 % fällig am 25.05.2036	1.162	532	0,00
0,472 % fällig am 25.10.2036 ^	17.827	8.001	0,01	2,933 % fällig am 25.03.2035	987	766	0,00	Harben Finance PLC			
0,472 % fällig am 25.12.2036	2.253	1.083	0,00	2,962 % fällig am 25.02.2037 ^	457	344	0,00	0,881 % fällig am 20.08.2056	£ 14.559	20.154	0,03
0,472 % fällig am 25.02.2037 ^	3.514	3.410	0,01	5,500 % fällig am 25.11.2035	91	68	0,00	HarborView Mortgage Loan Trust			
0,482 % fällig am 25.11.2035	1.598	1.489	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	817	533	0,00	0,223 % fällig am 19.03.2037	\$ 1.411	1.318	0,00
0,652 % fällig am 25.08.2036	4.842	4.766	0,01	6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	831	518	0,00	0,243 % fällig am 25.01.2047	15.997	15.099	0,02
1,989 % fällig am 25.08.2035 ^	352	349	0,00	First Horizon Asset Securities, Inc.				0,273 % fällig am 19.11.2036	1.538	1.483	0,00
2,807 % fällig am 25.10.2035	2.889	2.885	0,00	2,768 % fällig am 25.01.2036 ^	43	33	0,00	0,273 % fällig am 19.11.2046 ^	1.254	1.070	0,00
3,143 % fällig am 25.02.2036 ^	440	381	0,00	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				0,283 % fällig am 19.09.2037	12.512	12.217	0,02
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	876	849	0,00	2,596 % fällig am 25.11.2036 ^	531	434	0,00	0,283 % fällig am 19.01.2038	13.713	13.199	0,02
Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				2,890 % fällig am 25.09.2035	6	6	0,00	0,298 % fällig am 19.12.2036	43.538	40.941	0,06
4,908 % fällig am 25.06.2036	361	359	0,00	2,960 % fällig am 25.08.2037 ^	277	143	0,00	0,433 % fällig am 19.12.2036 ^	1.163	1.103	0,00
4,909 % fällig am 25.06.2036 ^	24	24	0,00	3,144 % fällig am 25.11.2037 ^	772	757	0,00	0,513 % fällig am 19.11.2036	18.572	17.468	0,03
5,945 % fällig am 25.02.2036 ^	4.941	4.957	0,01	3,410 % fällig am 25.07.2037 ^	253	189	0,00	0,533 % fällig am 19.05.2035	4.136	3.994	0,01
6,005 % fällig am 25.10.2036 ^	1.856	1.834	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2036	195	133	0,00	0,633 % fällig am 19.03.2035	1.045	1.047	0,00
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.				6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	334	226	0,00	0,653 % fällig am 20.10.2045	5.269	3.928	0,01
6,985 % fällig am 27.07.2037	716	673	0,00	FirstMac Mortgage Funding Trust				0,693 % fällig am 19.04.2034	172	165	0,00
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				1,060 % fällig am 08.03.2049	AUD 6.343	4.796	0,01	0,713 % fällig am 19.09.2035	9.686	6.096	0,01
1,067 % fällig am 25.06.2034	1.382	1.404	0,00	Fondo de Titulacion de Activos UCI				0,713 % fällig am 19.11.2035	433	394	0,00
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC				0,000 % fällig am 16.06.2049	€ 15.756	18.272	0,03	0,733 % fällig am 19.08.2045	3.019	2.725	0,00
Trust Certificates				FWF Securitization Trust				0,773 % fällig am 19.01.2035	251	255	0,00
3,016 % fällig am 27.06.2037	726	739	0,00	2,240 % fällig am 25.01.2050	\$ 16.852	17.101	0,02	0,966 % fällig am 19.12.2036 ^	2.487	2.410	0,00
Dilosk RMBS DAC				2,810 % fällig am 25.06.2049	4.165	4.265	0,01	1,092 % fällig am 25.10.2037	16.799	17.781	0,03
0,207 % fällig am 20.12.2057	€ 10.049	11.934	0,02	GC Pastor Hipotecario FTA				1,616 % fällig am 19.09.2035 ^	169	155	0,00
0,213 % fällig am 20.10.2057	16.280	19.344	0,03	0,000 % fällig am 21.06.2046	€ 1.896	1.996	0,00	1,633 % fällig am 19.02.2036	2.283	1.678	0,00
Domi BV				GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.				2,116 % fällig am 19.10.2035	8.125	5.890	0,01
0,302 % fällig am 15.06.2051	11.950	14.260	0,02	5,456 % fällig am 10.03.2051	\$ 18.679	20.377	0,03	2,116 % fällig am 19.01.2036 ^	1.206	694	0,00
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				5,550 % fällig am 10.08.2038	20.488	22.671	0,03	2,303 % fällig am 19.11.2034	493	507	0,00
0,283 % fällig am 19.10.2036	\$ 7.867	7.025	0,01	GMAC Mortgage Corp. Loan Trust				2,622 % fällig am 25.02.2036 ^	160	72	0,00
0,293 % fällig am 19.10.2036	4.584	4.161	0,01	3,052 % fällig am 19.04.2036 ^	138	121	0,00	2,655 % fällig am 19.12.2035 ^	1.400	1.359	0,00
0,383 % fällig am 19.10.2045	25	24	0,00	3,317 % fällig am 19.11.2035 ^	71	71	0,00	3,125 % fällig am 19.06.2036 ^	2.754	1.668	0,00
0,463 % fällig am 19.10.2045	3.437	3.393	0,01	3,600 % fällig am 19.07.2035	167	155	0,00	Hawsmoor Mortgages PLC			
0,913 % fällig am 19.09.2044	10	10	0,00	3,759 % fällig am 18.03.2035	30	29	0,00	1,099 % fällig am 25.05.2053	£ 12.223	16.973	0,02
Dragon Finance BV				5,750 % fällig am 25.07.2035	1.210	1.207	0,00	Hipocot FTA			
1,267 % fällig am 13.07.2023	£ 4.221	5.742	0,01	Great Hall Mortgages PLC				0,000 % fällig am 24.10.2039	€ 3.586	4.219	0,01
Dukinfield PLC				0,210 % fällig am 18.03.2039	£ 9.268	12.693	0,02	HomeBanc Mortgage Trust			
1,331 % fällig am 20.12.2052	8.771	12.143	0,02	0,230 % fällig am 18.06.2038	7.458	10.180	0,02	0,572 % fällig am 25.07.2035	\$ 1	1	0,00
Durham Mortgages B PLC				0,255 % fällig am 18.06.2039	\$ 483	477	0,00	0,612 % fällig am 25.01.2036	1.736	1.717	0,00
0,688 % fällig am 31.03.2054	85.522	118.067	0,17	GreenPoint Mortgage Funding Trust				0,827 % fällig am 25.01.2036	9.254	8.233	0,01
1,088 % fällig am 31.03.2054	50.404	69.619	0,10	0,292 % fällig am 25.10.2046	10.078	9.898	0,01	2,387 % fällig am 25.04.2037	1.374	1.283	0,00
1,288 % fällig am 31.03.2054	31.503	43.542	0,06	0,532 % fällig am 25.06.2045	1.002	944	0,00	2,926 % fällig am 25.04.2047	1.553	1.536	0,00
Dutch Property Finance BV				0,612 % fällig am 25.10.2045	5.004	5.076	0,01	Hops Hill No. 1 PLC			
0,111 % fällig am 28.07.2054	€ 22.734	27.045	0,04	0,672 % fällig am 25.02.2036	2.973	2.958	0,01	1,000 % fällig am 27.05.2054	£ 32.668	45.490	0,06
0,141 % fällig am 28.01.2048	39.499	46.943	0,07	0,712 % fällig am 25.10.2045	3.034	2.837	0,00	HSI Asset Loan Obligation Trust			
Eurohome UK Mortgages PLC				Grifonas Finance No. 1 PLC				0,462 % fällig am 25.12.2036	\$ 2.084	361	0,00
0,231 % fällig am 15.06.2044	£ 6.383	8.669	0,01	0,000 % fällig am 28.08.2039	€ 26.156	30.495	0,04	6,539 % fällig am 25.12.2036 (a)	1.624	370	0,00
0,431 % fällig am 15.09.2044	8.750	11.318	0,02	GS Mortgage Securities Corp.				IM Pastor Fondo de Titulacion Hipotecaria			
0,681 % fällig am 15.09.2044	7.250	9.354	0,01	1,629 % fällig am 10.02.2046 (a)	\$ 28.616	545	0,00	0,000 % fällig am 22.09.2041	€ 172	204	0,00
European Loan Conduit				GS Mortgage Securities Corp. Trust				Impac CMB Trust			
1,000 % fällig am 23.04.2029	€ 14.296	17.015	0,02	3,419 % fällig am 10.10.2032	26.700	27.420	0,04	0,632 % fällig am 25.05.2035	\$ 298	297	0,00
1,000 % fällig am 17.02.2030	66.931	79.731	0,11	4,744 % fällig am 10.10.2032	35.288	35.247	0,05	0,732 % fällig am 25.11.2034	2.727	2.779	0,00
Eurosail PLC				GSC Capital Corp. Mortgage Trust				0,732 % fällig am 25.03.2035	4.503	4.422	0,01
0,000 % fällig am 10.09.2044	3.200	3.652	0,01	0,492 % fällig am 25.02.2036 ^	2.325	2.346	0,00	0,772 % fällig am 25.01.2035	3.510	3.569	0,01
0,000 % fällig am 13.03.2045	5.747	6.619	0,01	GSMPS Mortgage Loan Trust				6,060 % fällig am 25.10.2034	470	505	0,00
0,244 % fällig am 13.03.2045	£ 16	21	0,00	0,442 % fällig am 25.03.2035	8.116	7.606	0,01	Impac Secured Assets CMN Owner Trust			
0,534 % fällig am 10.09.2044	3.200	4.255	0,01	0,442 % fällig am 25.09.2035	8.957	7.703	0,01	5,450 % fällig am 25.03.2033	378	385	0,00
0,854 % fällig am 13.09.2045	16.975	22.828	0,03	0,492 % fällig am 25.06.2034	1.764	1.602	0,00	Impac Secured Assets Corp.			
1,034 % fällig am 13.06.2045	4.732	6.562	0,01	3,660 % fällig am 25.06.2034	5.576	5.427	0,01	0,732 % fällig am 25.03.2036	2.045	1.830	0,00
1,084 % fällig am 13.06.2045	1.766	2.335	0,00	7,087 % fällig am 20.10.2032	1.620	1.638	0,00	1,517 % fällig am 25.02.2035	1.000	1.011	0,00
Exantas Capital Corp.				GSMSC Resecuritization Trust				Impac Secured Assets Trust			
2,624 % fällig am 17.04.2037	\$ 10.848	10.867	0,02	0,272 % fällig am 26.09.2036	10.178	7.825	0,01	0,202 % fällig am 25.05.2037 ^	1.228	1.157	0,00
Feldspar PLC				3,475 % fällig am 26.08.2035	348	355	0,00	0,252 % fällig am 25.03.2037 ^	1.768	1.753	0,00
0,781 % fällig am 15.09.2045	£ 1.784	2.467	0,00	8,757 % fällig am 26.04.2037	9.204	3.492	0,01	0,292 % fällig am 25.11.2036	3.356	3.181	0,01
Fingal Securities RMBS DAC				GSR Mortgage Loan Trust				0,332 % fällig am 25.09.2037 ^	3.935	3.336	0,01
0,962 % fällig am 28.07.2055	€ 32.308	38.534	0,05	0,322 % fällig am 25.05.2037	14.978	10.275	0,02	0,352 % fällig am 25.01.2037	12.967	12.327	0,02
Finsbury Square PLC				1,790 % fällig am 25.05.2034	43	37	0,00	0,362 % fällig am 25.11.2036	6.708	5.607	0,01
1,034 % fällig am 12.09.2068	£ 17.869	24.762	0,04	2,632 % fällig am 25.10.2035 ^	110	110	0,00	0,362 % fällig am 25.02.2037 ^	6.948	6.554	0,01
1,052 % fällig am 16.06.2069	28.605	39.653	0,06	2,844 % fällig am 25.05.2037 ^	1.629	1.193	0,00	0,452 % fällig am 25.09.2037	3.356	2.957	0,01
1,059 % fällig am 16.12.2069	34.027	47.325	0,07	2,927 % fällig am 25.01.2036	1.239	1.260	0,00	0,792 % fällig am 25.05.2036	517	516	0,00
1,079 % fällig am 16.09.2069	31.498	43.776	0,06	2,976 % fällig am 25.04.2036 ^	4.555	3.605	0,01	IMT Trust			
1,349 % fällig am 16.06.2070	31.008	43.298	0,06	3,043 % fällig am 25.05.2037 ^	209	196	0,00	0,773 % fällig am 15.06.2034	15.772	15.782	0,02
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				3,219 % fällig am 25.05.2037	6.032	6.090	0,01	IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust			
0,562 % fällig am 25.07.2036 ^	\$ 3.640	1.536	0,00	5,500 % fällig am 25.07.2035	664	701	0,00	1,810 % fällig am 25.01.2032	1	1	0,00
2,542 % fällig am 25.11.2035 ^	2.346	1.955	0,00	5,750 % fällig am 25.03.2036 ^	336	368	0,00	IndyMac Mortgage Loan Trust			
				5,750 % fällig am 25.05.2037 ^	375	579	0,00	0,222 % fällig am 25.10.2036	3.747	3.629	0,01
				6,000 % fällig am 25.02.2036	2.424	1.760	0,00	0,262 % fällig am 25.01.2037 ^	2.862	2.875	0,00
								0,272 % fällig am 25.02.2037 ^	7.770	7.701	0,01

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
0,272 % fällig am 25.07.2047	\$ 4.385	\$ 3.499	0,01	0,923 % fällig am 15.12.2036	\$ 17.100	\$ 17.148	0,02	1,116 % fällig am 25.11.2035	\$ 309	\$ 314	0,00
0,282 % fällig am 25.10.2036	6.177	3.463	0,01	1,380 % fällig am 15.04.2046 (a)	16.321	283	0,00	1,242 % fällig am 25.12.2037	1.521	1.577	0,00
0,282 % fällig am 25.04.2037	2.198	2.097	0,00	1,702 % fällig am 15.05.2045 (a)	16.533	125	0,00	Liberty Funding Pty. Ltd.			
0,302 % fällig am 25.11.2036	213	213	0,00	3,881 % fällig am 05.01.2031	19.300	19.790	0,03	1,260 % fällig am 10.10.2049	AUD 20.416	15.407	0,02
0,332 % fällig am 25.07.2036	6.322	6.002	0,01	5,337 % fällig am 15.05.2047	2.859	2.474	0,00	Ludgate Funding PLC			
0,342 % fällig am 25.09.2037	5.555	5.396	0,01	JPMorgan Mortgage Trust				0,000 % fällig am 01.01.2061	€ 10.251	11.802	0,02
0,362 % fällig am 25.10.2036	2.516	1.433	0,00	1,968 % fällig am 25.06.2034	17	17	0,00	0,160 % fällig am 01.01.2061	7.321	8.599	0,01
0,442 % fällig am 25.06.2036	3.298	3.223	0,01	2,559 % fällig am 25.08.2036	5.107	4.678	0,01	0,270 % fällig am 01.12.2060	€ 1.301	1.751	0,00
0,452 % fällig am 25.08.2036	10.871	7.667	0,01	2,564 % fällig am 25.04.2035 ^	387	383	0,00	0,690 % fällig am 01.01.2061	22.992	31.600	0,04
0,492 % fällig am 25.06.2046	8.074	7.393	0,01	2,646 % fällig am 25.07.2035	352	353	0,00	Luminent Mortgage Trust			
0,492 % fällig am 25.11.2046	8.941	8.533	0,01	2,679 % fällig am 25.10.2036	336	282	0,00	0,262 % fällig am 25.12.2036	\$ 3.202	3.005	0,01
0,512 % fällig am 25.05.2046	10.447	10.206	0,02	2,732 % fällig am 25.05.2036	4.099	3.844	0,01	0,372 % fällig am 25.01.2037 ^	3.370	2.984	0,01
0,552 % fällig am 25.04.2035	449	418	0,00	2,766 % fällig am 25.08.2036	143	119	0,00	0,452 % fällig am 25.12.2036 ^	163	154	0,00
0,612 % fällig am 25.07.2035	7.048	5.858	0,01	2,790 % fällig am 25.04.2036 ^	4.408	4.352	0,01	0,472 % fällig am 25.05.2046	1.148	1.053	0,00
0,672 % fällig am 25.01.2036	3.700	2.983	0,01	2,837 % fällig am 25.08.2035	3.641	3.566	0,01	0,492 % fällig am 25.02.2046	2.209	1.846	0,00
0,692 % fällig am 25.07.2035	1.426	1.335	0,00	2,905 % fällig am 25.11.2035 ^	2.744	2.552	0,00	Mansard Mortgages PLC			
0,872 % fällig am 25.12.2034	1.096	939	0,00	2,913 % fällig am 25.11.2035 ^	1.148	1.109	0,00	1,331 % fällig am 15.12.2049	€ 4.953	6.819	0,01
0,892 % fällig am 25.07.2046	5.820	5.435	0,01	2,913 % fällig am 25.11.2035	3.792	3.662	0,01	2,081 % fällig am 15.12.2049	4.402	6.078	0,01
0,912 % fällig am 25.11.2034 ^	1.273	1.186	0,00	2,949 % fällig am 27.07.2037	695	687	0,00	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
0,952 % fällig am 25.09.2034	59	57	0,00	2,972 % fällig am 25.04.2037 ^	4	4	0,00	1,192 % fällig am 25.09.2037	\$ 7.382	3.610	0,01
2,644 % fällig am 25.09.2036 ^	165	146	0,00	3,001 % fällig am 25.05.2036 ^	55	51	0,00	1,999 % fällig am 25.12.2035	1.276	1.313	0,00
2,644 % fällig am 25.06.2037 ^	4.200	3.952	0,01	3,026 % fällig am 25.08.2035 ^	198	183	0,00	2,531 % fällig am 25.03.2035	65	54	0,00
2,709 % fällig am 25.05.2035 ^	80	63	0,00	3,028 % fällig am 25.09.2035	597	614	0,00	2,622 % fällig am 25.03.2035	160	158	0,00
2,742 % fällig am 25.09.2035 ^	131	126	0,00	3,038 % fällig am 25.05.2036	1.894	1.746	0,00	2,654 % fällig am 25.09.2034	912	822	0,00
2,761 % fällig am 25.11.2035 ^	1.988	1.894	0,00	3,075 % fällig am 25.05.2037 ^	556	527	0,00	2,778 % fällig am 25.03.2035	670	654	0,00
2,773 % fällig am 25.06.2037 ^	2.354	2.479	0,00	3,092 % fällig am 25.01.2037 ^	1.028	965	0,00	3,260 % fällig am 25.02.2035	168	164	0,00
2,813 % fällig am 25.09.2035 ^	373	308	0,00	3,154 % fällig am 25.10.2037	4.750	4.279	0,01	MASTR Alternative Loan Trust			
2,820 % fällig am 25.05.2035 ^	336	316	0,00	3,200 % fällig am 25.05.2037	2.053	2.003	0,00	5,500 % fällig am 25.04.2035	3.103	3.111	0,01
2,820 % fällig am 25.11.2035 ^	45	40	0,00	5,500 % fällig am 25.07.2036	3.949	3.057	0,01	5,750 % fällig am 25.08.2035 ^	1.553	1.115	0,00
2,837 % fällig am 25.12.2035	4.868	4.388	0,01	5,750 % fällig am 25.01.2036 ^	1.145	782	0,00	6,500 % fällig am 25.05.2034	87	90	0,00
2,875 % fällig am 25.07.2037	8.677	8.597	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2022 ^	27	28	0,00	MASTR Asset Securitization Trust			
2,894 % fällig am 25.09.2037	16.160	14.764	0,02	6,000 % fällig am 25.08.2037	3.147	2.356	0,00	5,000 % fällig am 25.07.2019	0	0	0,00
2,906 % fällig am 25.09.2036 ^	182	169	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	5.778	4.326	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	2.326	2.000	0,00
2,931 % fällig am 25.03.2036 ^	4.805	4.310	0,01	6,250 % fällig am 25.08.2037	5.413	2.509	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2036	882	879	0,00
2,933 % fällig am 25.06.2037 ^	7.932	6.541	0,01	6,500 % fällig am 25.01.2035	1.916	2.096	0,00	MASTR Reperforming Loan Trust			
2,948 % fällig am 25.08.2034	103	105	0,00	6,500 % fällig am 25.07.2036 ^	242	146	0,00	0,452 % fällig am 25.07.2035 ^	3.665	1.708	0,00
2,962 % fällig am 25.07.2036	4.495	4.000	0,01	6,500 % fällig am 25.08.2036	4.796	2.712	0,00	7,000 % fällig am 25.08.2034	12	10	0,00
2,986 % fällig am 25.08.2035	85	78	0,00	JPMorgan Resecuritization Trust				MASTR Seasoned Securitization Trust			
2,994 % fällig am 25.08.2036	202	192	0,00	3,086 % fällig am 26.09.2036	503	498	0,00	0,492 % fällig am 25.10.2032	32	30	0,00
3,009 % fällig am 25.06.2036	8.626	6.933	0,01	5,304 % fällig am 26.09.2037	1.492	1.188	0,00	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust			
3,017 % fällig am 25.05.2037 ^	2.012	1.897	0,00	5,750 % fällig am 26.04.2037	1.724	1.215	0,00	2,916 % fällig am 25.06.2037 ^	3.431	2.570	0,00
3,025 % fällig am 25.09.2036	2.092	1.752	0,00	5,750 % fällig am 26.05.2037	153	101	0,00	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
3,043 % fällig am 25.03.2037 ^	24	23	0,00	6,000 % fällig am 26.09.2036	799	681	0,00	0,552 % fällig am 25.04.2029	806	802	0,00
3,100 % fällig am 25.05.2037 ^	2.462	1.883	0,00	Kirky RBMS PLC				0,752 % fällig am 25.06.2028	1	1	0,00
3,110 % fällig am 25.04.2037	9.033	8.642	0,01	0,000 % fällig am 22.02.2045	€ 1	3.530	0,01	0,812 % fällig am 25.08.2035	3.354	3.292	0,01
3,114 % fällig am 25.04.2037	4.810	4.577	0,01	0,882 % fällig am 22.02.2045	42.831	58.208	0,08	0,917 % fällig am 25.11.2029	1.116	1.059	0,00
3,143 % fällig am 25.01.2037 ^	210	192	0,00	2,082 % fällig am 22.02.2045	13.150	17.322	0,03	0,924 % fällig am 25.09.2029	215	210	0,00
3,145 % fällig am 25.05.2036 ^	254	217	0,00	2,250 % fällig am 22.02.2045	4.258	4.256	0,01	0,996 % fällig am 25.01.2029 (a)	1.068	9	0,00
3,166 % fällig am 25.08.2037	3.295	2.626	0,00	Landmark Mortgage Securities PLC				1,037 % fällig am 25.08.2036	4.745	4.047	0,01
3,222 % fällig am 25.08.2037 ^	5.652	4.900	0,01	0,000 % fällig am 17.06.2038	€ 70	83	0,00	2,249 % fällig am 25.11.2035	133	134	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	861	820	0,00	0,282 % fällig am 17.06.2039	€ 7.081	9.512	0,01	2,427 % fällig am 25.01.2037	147	142	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	207	121	0,00	0,302 % fällig am 17.06.2038	184	254	0,00	2,671 % fällig am 25.12.2035	3.309	3.266	0,01
6,000 % fällig am 25.08.2037	833	488	0,00	Lanebrook Mortgage Transaction PLC				2,842 % fällig am 25.05.2036	5	5	0,00
6,500 % fällig am 25.07.2037 ^	370	190	0,00	1,149 % fällig am 12.06.2057	23.605	32.891	0,05	3,078 % fällig am 25.12.2034	170	182	0,00
6,500 % fällig am 25.09.2037 ^	1.956	1.485	0,00	Lansdowne Mortgage Securities PLC				MetLife Securitization Trust			
6,500 % fällig am 25.10.2037	2.928	2.234	0,00	0,000 % fällig am 15.06.2045	€ 4.840	5.391	0,01	3,750 % fällig am 25.03.2057	8.153	8.520	0,01
InTown Hotel Portfolio Trust				LB-UBS Commercial Mortgage Trust				Miravet SARL			
1,373 % fällig am 15.01.2033	6.700	6.224	0,01	5,407 % fällig am 15.11.2038 ^	\$ 2.522	845	0,00	0,307 % fällig am 26.05.2065	€ 46.812	55.675	0,08
1,573 % fällig am 15.01.2033	9.480	9.508	0,01	5,562 % fällig am 15.02.2040 ^	2.913	1.435	0,00	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust			
2,373 % fällig am 15.01.2033	20.900	21.012	0,03	Lehman Mortgage Trust				1,159 % fällig am 15.02.2047 (a)	\$ 5.702	116	0,00
Jepson Residential				0,592 % fällig am 25.07.2037 ^	605	500	0,00	3,046 % fällig am 15.04.2048	40.000	41.791	0,06
1,150 % fällig am 24.11.2057	€ 7.568	8.994	0,01	0,992 % fällig am 25.12.2035 ^	848	577	0,00	Morgan Stanley Capital Trust			
JPMorgan Alternative Loan Trust				5,750 % fällig am 25.01.2037	377	306	0,00	6,215 % fällig am 11.06.2042	16.400	16.741	0,02
0,372 % fällig am 25.06.2037	\$ 20.764	10.985	0,02	6,000 % fällig am 25.01.2036	2.489	955	0,00	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
0,372 % fällig am 25.04.2047	5.144	5.091	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2036	775	548	0,00	0,412 % fällig am 25.06.2036	4.078	1.311	0,00
0,612 % fällig am 25.01.2036	62	62	0,00	6,000 % fällig am 25.12.2036	1.591	1.582	0,00	0,432 % fällig am 25.08.2036	6.713	2.648	0,00
2,806 % fällig am 25.10.2036	5.654	5.211	0,01	Lehman XS Trust				1,217 % fällig am 25.09.2035	4.063	4.110	0,01
3,093 % fällig am 25.03.2036	974	905	0,00	0,282 % fällig am 25.12.2036	9.060	7.916	0,01	2,043 % fällig am 25.06.2036	1.537	1.619	0,00
3,254 % fällig am 25.03.2037 ^	1.269	1.301	0,00	0,282 % fällig am 25.09.2046	170	172	0,00	2,072 % fällig am 25.09.2035	1.483	1.516	0,00
3,297 % fällig am 25.01.2036	438	345	0,00	0,292 % fällig am 25.11.2046 ^	1.016	1.007	0,00	2,608 % fällig am 25.10.2037 ^	109	86	0,00
5,692 % fällig am 26.05.2037	3.840	3.261	0,01	0,292 % fällig am 25.03.2047	18.669	18.712	0,03	2,751 % fällig am 25.08.2034	91	91	0,00
6,000 % fällig am 27.12.2036	1.330	992	0,00	0,292 % fällig am 25.06.2047 ^	7.980	7.073	0,01	2,825 % fällig am 25.05.2036 ^	1.956	1.464	0,00
6,180 % fällig am 25.03.2036	7.043	6.951	0,01	0,292 % fällig am 25.08.2046	11.905	11.754	0,02	2,888 % fällig am 25.11.2037	8.557	7.394	0,01
6,210 % fällig am 25.12.2036 ^	366	372	0,00	0,312 % fällig am 25.06.2047	7.950	7.639	0,01	3,020 % fällig am 25.03.2036 ^	61	50	0,00
6,460 % fällig am 25.12.2036 ^	2.003	2.009	0,00	0,332 % fällig am 25.08.2036 ^	70	79	0,00	5,500 % fällig am 25.10.2037 ^	367	370	0,00
6,550 % fällig am 25.05.2036	247	251	0,00	0,342 % fällig am 25.08.2037	5.613	5.458	0,01	5,750 % fällig am 25.02.2036 ^	662	652	0,00
6,620 % fällig am 25.08.2036 ^	534	534									

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
6,000 % fällig am 25.10.2037	\$ 8.804	\$ 6.507	0,01	Pretium Mortgage Credit Partners LLC	\$ 19.541	\$ 19.556	0,03	6,500 % fällig am 25.11.2036 ^	\$ 320	\$ 315	0,00
6,354 % fällig am 25.08.2036 ^	1.374	416	0,00	2,240 % fällig am 27.09.2060				6,500 % fällig am 25.02.2037	6.513	6.514	0,01
6,500 % fällig am 25.02.2036 ^	110	79	0,00	Prime Mortgage Trust				6,548 % fällig am 25.01.2037 (a)	2.628	662	0,00
Morgan Stanley Re-REMIC Trust				5,500 % fällig am 25.06.2036 ^	18	18	0,00	6,559 % fällig am 25.12.2036 (a)	1.049	189	0,00
3,050 % fällig am 26.12.2036	3.895	3.621	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	154	152	0,00	7,109 % fällig am 25.12.2036 (a)	1.597	380	0,00
5,500 % fällig am 26.11.2034	36	36	0,00	Proteus RMBS DAC				Residential Asset Securitization Trust			
Morgan Stanley Resecuritization Trust				0,000 % fällig am 29.10.2054 (b)(f)	€ 13.990	12.291	0,02	0,542 % fällig am 25.03.2035	2.064	1.556	0,00
0,712 % fällig am 26.01.2051	250	250	0,00	0,000 % fällig am 29.10.2054	200	1.710	0,00	0,642 % fällig am 25.11.2035 ^	138	74	0,00
0,968 % fällig am 26.11.2046	4.184	3.233	0,01	0,000 % fällig am 29.10.2054	81.002	96.084	0,13	5,500 % fällig am 25.08.2034	1.061	1.104	0,00
1,088 % fällig am 26.06.2047	7.349	6.286	0,01	0,365 % fällig am 29.10.2054	8.681	10.288	0,02	5,500 % fällig am 25.09.2035	3.100	2.256	0,00
Mortgage Equity Conversion Asset Trust				0,565 % fällig am 29.10.2054	6.313	7.468	0,01	5,750 % fällig am 25.02.2036	2.003	2.054	0,00
0,550 % fällig am 25.02.2042	9.732	9.326	0,01	1,215 % fällig am 29.10.2054	4.735	5.592	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2035 ^	1.672	1.508	0,00
MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust				2,465 % fällig am 29.10.2054	3.946	4.638	0,01	6,000 % fällig am 25.02.2036	4.841	2.922	0,00
0,322 % fällig am 25.06.2047	11.706	11.579	0,02	RBSGC Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 25.04.2036 ^	3.274	2.275	0,00
0,592 % fällig am 25.09.2037	5.082	4.666	0,01	0,542 % fällig am 25.01.2037 ^	\$ 669	255	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2036	959	612	0,00
MortgageIT Trust				RBSGC Structured Trust				6,000 % fällig am 25.09.2036 ^	7.537	3.956	0,01
0,652 % fällig am 25.10.2035	169	169	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	99	96	0,00	6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	10.134	4.789	0,01
0,692 % fällig am 25.08.2035	204	206	0,00	RBSSP Resecuritization Trust				6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	1.111	640	0,00
0,712 % fällig am 25.12.2035	2.948	2.969	0,00	0,572 % fällig am 27.06.2036	1.400	1.226	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2037	2.514	2.018	0,00
0,977 % fällig am 25.02.2035	669	673	0,00	2,717 % fällig am 26.01.2036	9.817	9.061	0,01	6,000 % fällig am 25.01.2046	1.582	1.003	0,00
1,342 % fällig am 25.02.2035	4	4	0,00	3,050 % fällig am 26.12.2036	4.151	4.203	0,01	6,250 % fällig am 25.08.2036	921	584	0,00
Mortimer BTL PLC				6,000 % fällig am 26.05.2036	1.833	1.198	0,00	6,250 % fällig am 25.10.2036 ^	1.356	1.139	0,00
1,349 % fällig am 20.06.2051	€ 16.695	23.242	0,03	6,000 % fällig am 26.08.2037	756	751	0,00	6,250 % fällig am 25.12.2036 ^	497	485	0,00
Mulcair Securities DAC				6,000 % fällig am 26.10.2037	3.157	3.084	0,01	6,500 % fällig am 25.07.2036	1.054	532	0,00
0,461 % fällig am 24.04.2071	€ 26.008	30.955	0,04	Ready Capital Mortgage Financing LLC				6,500 % fällig am 25.04.2037 ^	11.500	4.916	0,01
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust				2,242 % fällig am 25.02.2035	22.199	22.330	0,03	6,500 % fällig am 25.06.2037	6.808	2.758	0,00
0,823 % fällig am 15.02.2033	\$ 7.970	7.974	0,01	Residential Accredited Loans, Inc. Trust				6,609 % fällig am 25.02.2037	12.684	6.015	0,01
1,173 % fällig am 15.02.2033	6.710	6.529	0,01	0,192 % fällig am 25.05.2037	139	135	0,00	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
New Century Alternative Mortgage Loan Trust				0,262 % fällig am 25.12.2036	3.233	3.214	0,01	2,930 % fällig am 25.06.2035	61	61	0,00
5,023 % fällig am 25.10.2036 ^	6.911	2.448	0,00	0,262 % fällig am 25.01.2037	2.977	2.770	0,00	3,101 % fällig am 25.06.2035	335	248	0,00
New Residential Mortgage Loan Trust				0,282 % fällig am 25.07.2037	5.802	5.786	0,01	3,136 % fällig am 25.08.2035 ^	53	32	0,00
4,500 % fällig am 25.05.2058	25.763	27.975	0,04	0,342 % fällig am 25.03.2037 ^	2.944	2.250	0,00	3,371 % fällig am 25.04.2037	136	125	0,00
Newgate Funding PLC				0,392 % fällig am 25.08.2035	225	195	0,00	3,371 % fällig am 25.04.2037 ^	532	489	0,00
0,052 % fällig am 15.12.2050	€ 8.710	10.282	0,02	0,392 % fällig am 25.12.2036	4.914	3.418	0,01	3,496 % fällig am 25.04.2037	166	110	0,00
0,241 % fällig am 15.12.2050	€ 11.932	15.923	0,02	0,392 % fällig am 25.06.2037 ^	1.439	1.318	0,00	3,523 % fällig am 25.11.2035 ^	14	13	0,00
0,254 % fällig am 01.12.2050	1.827	2.461	0,00	0,412 % fällig am 25.01.2037	6.729	6.490	0,01	4,142 % fällig am 25.09.2036 ^	92	51	0,00
1,081 % fällig am 15.12.2050	3.561	4.869	0,01	0,442 % fällig am 25.12.2036	2.797	2.205	0,00	4,340 % fällig am 27.07.2037 ^	488	426	0,00
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				0,452 % fällig am 25.07.2036	1.403	1.363	0,00	4,460 % fällig am 25.08.2036 ^	1.474	1.216	0,00
0,342 % fällig am 25.06.2037	\$ 752	632	0,00	0,452 % fällig am 25.07.2036 ^	6.743	3.607	0,01	4,500 % fällig am 25.10.2018	13	6	0,00
0,612 % fällig am 25.12.2035	826	294	0,00	0,452 % fällig am 25.01.2037 ^	2.626	1.854	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	426	26	0,00
1,092 % fällig am 25.05.2035	1.513	1.310	0,00	0,472 % fällig am 25.07.2036	1.826	1.776	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2036 ^	277	274	0,00
1,112 % fällig am 25.08.2034	498	537	0,00	0,472 % fällig am 25.09.2036 ^	2.656	2.590	0,00	6,000 % fällig am 25.09.2036	1.066	1.012	0,00
2,240 % fällig am 25.02.2036 ^	46	41	0,00	0,472 % fällig am 25.12.2036	1.853	1.783	0,00	6,250 % fällig am 25.08.2036	1.583	1.561	0,00
3,607 % fällig am 25.06.2036	403	357	0,00	0,472 % fällig am 25.05.2047	1.333	1.288	0,00	Residential Mortgage Securities PLC			
5,034 % fällig am 25.05.2035	1.968	1.289	0,00	0,492 % fällig am 25.08.2036 ^	210	164	0,00	0,881 % fällig am 20.03.2050	€ 24.415	33.802	0,05
5,688 % fällig am 25.07.2035	1.178	1.202	0,00	0,492 % fällig am 25.05.2037 ^	4.130	3.089	0,01	1,031 % fällig am 20.12.2046	28.115	38.914	0,06
6,408 % fällig am 25.05.2036 ^	790	257	0,00	0,522 % fällig am 25.05.2046	3.671	3.454	0,01	1,281 % fällig am 20.09.2065	14.555	20.145	0,03
Nomura Resecuritization Trust				0,632 % fällig am 25.02.2046 ^	97	69	0,00	1,299 % fällig am 20.06.2070	8.655	12.083	0,02
0,992 % fällig am 25.07.2036	25.816	25.376	0,04	0,632 % fällig am 25.05.2046 ^	3.626	3.203	0,01	RESIMAC Bastille Trust			
2,087 % fällig am 26.03.2037	3.150	2.859	0,00	0,692 % fällig am 25.04.2036	2.595	2.443	0,00	0,930 % fällig am 05.12.2059	\$ 3.810	3.815	0,01
NovaStar Mortgage Funding Trust				0,692 % fällig am 25.03.2037 ^	6.706	4.816	0,01	1,310 % fällig am 05.09.2057	AUD 22.496	17.067	0,02
0,476 % fällig am 25.09.2046	13.968	5.982	0,01	1,023 % fällig am 25.10.2037	6.746	6.505	0,01	RESIMAC Premier			
NRPL Trust				1,402 % fällig am 25.11.2037	586	561	0,00	1,130 % fällig am 07.02.2052	\$ 5.768	5.795	0,01
4,250 % fällig am 25.07.2067	17.957	18.024	0,03	1,476 % fällig am 25.09.2045	620	607	0,00	1,310 % fällig am 07.02.2052	AUD 24.074	18.321	0,03
OBX Trust				1,616 % fällig am 25.08.2035	2.474	2.290	0,00	Ripon Mortgages PLC			
0,742 % fällig am 25.06.2057	3.347	3.354	0,01	3,021 % fällig am 25.07.2035 ^	1.320	1.301	0,00	1,281 % fällig am 20.08.2056	€ 167.565	232.341	0,32
0,942 % fällig am 25.04.2048	4.210	4.243	0,01	3,090 % fällig am 25.08.2035 ^	179	176	0,00	1,581 % fällig am 20.08.2056	44.206	61.294	0,09
Paragon Mortgages PLC				3,284 % fällig am 25.02.2035 ^	489	290	0,00	1,881 % fällig am 20.08.2056	13.026	18.058	0,03
1,099 % fällig am 15.05.2045	€ 32.114	44.740	0,06	3,544 % fällig am 25.02.2035 ^	600	521	0,00	River Green Finance DAC			
Pepper Residential Securities Trust				5,445 % fällig am 25.02.2036 ^	2.541	2.145	0,00	0,700 % fällig am 22.01.2032	€ 13.529	16.066	0,02
0,983 % fällig am 18.11.2060	\$ 11.181	11.193	0,02	5,500 % fällig am 25.06.2035 ^	1.526	1.519	0,00	RiverView HECM Trust			
PHH Alternative Mortgage Trust				5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	1.889	1.827	0,00	0,362 % fällig am 25.05.2047	\$ 8.178	7.444	0,01
0,572 % fällig am 25.05.2037	4.174	4.093	0,01	5,500 % fällig am 25.02.2036	788	771	0,00	RMAC PLC			
0,792 % fällig am 25.07.2037	1.728	1.696	0,00	5,750 % fällig am 25.01.2037	449	425	0,00	0,784 % fällig am 12.06.2046	€ 23.605	32.649	0,05
Polaris PLC				6,000 % fällig am 25.09.2035 ^	3.173	3.106	0,01	RMAC Securities PLC			
1,300 % fällig am 27.05.2057	€ 28.424	39.603	0,06	6,000 % fällig am 25.12.2035	1.405	1.420	0,00	0,000 % fällig am 12.06.2044	€ 6.653	7.670	0,01
Polaris RMBS				6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	687	657	0,00	0,234 % fällig am 12.06.2044	€ 2.135	2.876	0,00
1,300 % fällig am 27.04.2057	7.340	10.170	0,02	6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	3.882	3.690	0,01	0,254 % fällig am 12.06.2044	871	1.168	0,00
Precise Mortgage Funding PLC				6,000 % fällig am 25.07.2036 ^	395	377	0,00	0,269 % fällig am 12.06.2044	\$ 384	364	0,00
0,000 % fällig am 12.12.2055 (f)	0	19.483	0,03	6,000 % fällig am 25.08.2036 ^	6.857	6.727	0,01	Roundstone Securities DAC			
0,734 % fällig am 12.12.2054	11.123	15.381	0,02	6,000 % fällig am 25.09.2036 ^	1.367	1.299	0,00	0,000 % fällig am 28.09.2055	€ 19.776	13.334	0,02
0,764 % fällig am 12.03.2055	15.130	20.935	0,03	6,000 % fällig am 25.11.2036 ^	259	248	0,00	0,062 % fällig am 28.09.2055	166.169	196.465	0,27
0,980 % fällig am 16.10.2056	21.202	29.474	0,04	6,000 % fällig am 25.01.2037	600	576	0,00	0,212 % fällig am 28.09.2055	15.538	18.167	0,03
1,500 % fällig am 16.10.2056	1.200	1.669	0,00	6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	588	566	0,00	0,462 % fällig am 28.09.2055	10.594	12.317	0,02
1,750 % fällig am 16.10.2056	1.000	1.390	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	477						

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS		
Sequoia Mortgage Trust				Terwin Mortgage Trust				1,593 % fällig am 25.07.2047 ^	\$	2.228	\$ 2.106	0,00	
0,733 % fällig am 20.11.2034	\$ 1.089	\$ 1.079	0,00	0,652 % fällig am 25.10.2037	\$ 5.910	\$ 2.570	0,00	1,843 % fällig am 25.08.2046			\$ 2.719	0,00	
0,836 % fällig am 20.02.2034	404	374	0,00	Tharaldson Hotel Portfolio Trust				1,843 % fällig am 25.09.2046			3.097	3.209	0,01
2,677 % fällig am 20.06.2037 ^	5.194	4.811	0,01	1,330 % fällig am 11.11.2034	27.138	27.182	0,04	1,843 % fällig am 25.10.2046			2.757	2.691	0,00
2,947 % fällig am 20.07.2037	2.371	2.180	0,00	1,580 % fällig am 11.11.2034	13.609	13.629	0,02	1,843 % fällig am 25.11.2046			2.147	2.112	0,00
Sestante Finance SRL				2,230 % fällig am 11.11.2034	22.601	22.448	0,03	1,877 % fällig am 25.05.2046			61	60	0,00
0,000 % fällig am 23.07.2046	€ 20.226	22.108	0,03	Thornburg Mortgage Securities Trust				2,491 % fällig am 25.12.2036 ^			1.003	958	0,00
Shamrock Residential DAC				1,494 % fällig am 25.06.2037	142	141	0,00	2,611 % fällig am 25.11.2036 ^			4.069	4.050	0,01
0,300 % fällig am 24.12.2059	33.461	39.720	0,06	1,497 % fällig am 25.03.2044	1.207	1.213	0,00	2,621 % fällig am 25.01.2037 ^			1.152	1.046	0,00
Southern Pacific Financing PLC				2,224 % fällig am 25.09.2037	1.052	1.064	0,00	2,646 % fällig am 25.07.2034			264	168	0,00
0,264 % fällig am 10.06.2043	£ 25	34	0,00	2,342 % fällig am 25.09.2037	1.895	1.893	0,00	2,654 % fällig am 25.05.2037			2.032	1.889	0,00
Stanlington PLC				2,374 % fällig am 25.04.2036	1.537	1.524	0,00	2,662 % fällig am 25.05.2037 ^			2.034	1.861	0,00
1,084 % fällig am 12.06.2046	7.169	9.927	0,01	2,756 % fällig am 25.10.2046	87	88	0,00	2,705 % fällig am 25.06.2037 ^			1.381	1.348	0,00
Stratton Mortgage Funding PLC				2,970 % fällig am 25.07.2036	2.304	2.128	0,00	2,725 % fällig am 25.03.2035			3.085	3.200	0,01
0,901 % fällig am 25.09.2034	40.000	55.412	0,08	Towd Point Mortgage Funding PLC				2,730 % fällig am 25.12.2036 ^			7.699	7.604	0,01
0,948 % fällig am 20.07.2060	143.969	199.679	0,28	0,049 % fällig am 20.05.2045	£ 67.139	93.139	0,13	2,776 % fällig am 25.06.2037 ^			1.972	1.924	0,00
0,949 % fällig am 12.03.2052	18.012	24.995	0,04	0,881 % fällig am 20.02.2045	26.593	36.820	0,05	2,793 % fällig am 25.01.2035			2.579	2.617	0,00
1,249 % fällig am 25.05.2051	13.435	18.660	0,03	0,949 % fällig am 20.07.2045	53.228	73.783	0,10	2,827 % fällig am 25.03.2037			176	173	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				1,111 % fällig am 20.10.2051	10.143	14.087	0,02	2,830 % fällig am 25.03.2037 ^			1.243	1.151	0,00
0,392 % fällig am 25.09.2034	\$ 395	377	0,00	1,249 % fällig am 20.02.2054	51.158	71.140	0,10	2,846 % fällig am 25.04.2035			2.308	2.332	0,00
0,512 % fällig am 25.10.2035	2.923	2.765	0,00	1,486 % fällig am 20.10.2051	21.200	29.337	0,04	2,858 % fällig am 25.06.2037 ^			1.735	1.705	0,00
0,532 % fällig am 25.05.2037	1.089	1.062	0,00	2,586 % fällig am 20.10.2051	34.793	48.207	0,07	2,888 % fällig am 25.12.2035			8.313	8.421	0,01
0,572 % fällig am 25.05.2037 ^	647	660	0,00	Tower Bridge Funding No. 3 PLC				2,930 % fällig am 25.09.2036 ^			152	148	0,00
0,642 % fällig am 25.09.2034	5.674	5.586	0,01	1,281 % fällig am 20.12.2061	27.298	37.808	0,05	2,941 % fällig am 25.02.2037 ^			2.081	1.972	0,00
1,067 % fällig am 25.08.2035	2.366	2.301	0,00	Tower Bridge Funding PLC				2,997 % fällig am 25.01.2037 ^			4.179	4.018	0,01
1,671 % fällig am 25.11.2037 ^	407	394	0,00	1,419 % fällig am 20.09.2063	28.833	40.257	0,06	3,000 % fällig am 25.02.2037 ^			5.627	5.663	0,01
2,439 % fällig am 25.12.2034	12	12	0,00	Trinidad Mortgage Securities PLC				3,029 % fällig am 25.08.2036 ^			1.198	1.153	0,00
2,452 % fällig am 25.01.2035	84	84	0,00	0,888 % fällig am 24.01.2059	8.162	11.289	0,02	3,031 % fällig am 25.02.2037 ^			2.233	2.214	0,00
2,485 % fällig am 25.09.2034	5	5	0,00	Trinity Square PLC				3,066 % fällig am 25.12.2036			1.878	1.888	0,00
2,673 % fällig am 25.02.2035	4.472	4.491	0,01	1,449 % fällig am 15.07.2059	34.300	47.524	0,07	3,066 % fällig am 25.10.2036 ^			3.535	3.554	0,01
2,701 % fällig am 25.01.2035	333	339	0,00	1,749 % fällig am 15.07.2059	11.400	15.797	0,02	3,076 % fällig am 25.08.2046 ^			1.167	1.162	0,00
2,706 % fällig am 25.04.2036	377	352	0,00	2,049 % fällig am 15.07.2059	8.600	11.885	0,02	3,082 % fällig am 25.09.2036			5.745	5.542	0,01
2,850 % fällig am 25.08.2036	4.082	3.279	0,01	2,799 % fällig am 15.07.2059	5.700	7.905	0,01	3,103 % fällig am 25.12.2036			279	270	0,00
2,853 % fällig am 25.10.2035 ^	141	133	0,00	Tudor Rose Mortgages PLC				3,103 % fällig am 25.12.2036			679	657	0,00
2,909 % fällig am 25.02.2036 ^	4.039	3.745	0,01	1,299 % fällig am 20.06.2048	24.183	33.542	0,05	3,107 % fällig am 25.07.2037 ^			5.991	6.077	0,01
2,976 % fällig am 25.07.2035 ^	227	171	0,00	Twin Bridges PLC				3,143 % fällig am 25.02.2037 ^			14.509	14.546	0,02
2,978 % fällig am 25.07.2035 ^	923	864	0,00	0,864 % fällig am 12.09.2044	16.208	22.441	0,03	3,185 % fällig am 25.08.2046 ^			233	230	0,00
3,029 % fällig am 25.11.2037 ^	307	257	0,00	0,964 % fällig am 12.09.2050	25.605	35.574	0,05	3,233 % fällig am 25.07.2037 ^			5.293	5.347	0,01
3,138 % fällig am 25.11.2035	61	56	0,00	1,034 % fällig am 12.12.2052	26.504	36.798	0,05	Warwick Finance Residential Mortgages PLC					
3,148 % fällig am 25.10.2036	3.353	3.290	0,01	1,199 % fällig am 12.06.2053	23.224	32.317	0,05	0,000 % fällig am 21.12.2049 (f)	£	2	4.132	0,01	
Structured Asset Mortgage Investments Trust				1,299 % fällig am 12.12.2054	29.240	40.931	0,06	0,999 % fällig am 21.12.2049	€	93.581	129.680	0,18	
0,212 % fällig am 25.08.2036	17.206	16.159	0,02	UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust				1,699 % fällig am 21.12.2049			12.810	17.803	0,03
0,212 % fällig am 25.10.2036	8.098	7.735	0,01	1,045 % fällig am 10.03.2046 (a)	\$ 92.056	932	0,00	2,199 % fällig am 21.12.2049			6.405	8.910	0,01
0,252 % fällig am 25.01.2037	4.765	4.612	0,01	1,243 % fällig am 10.04.2046 (a)	9.257	128	0,00	2,699 % fällig am 21.12.2049			3.660	5.086	0,01
0,262 % fällig am 25.02.2036	4.036	3.786	0,01	Uropa Securities PLC				3,199 % fällig am 21.12.2049			3.660	5.066	0,01
0,272 % fällig am 25.01.2037	933	895	0,00	0,284 % fällig am 10.06.2059	£ 9.527	12.868	0,02	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
0,272 % fällig am 25.09.2047	273	276	0,00	0,434 % fällig am 10.06.2059	3.497	4.685	0,01	0,252 % fällig am 25.02.2037 ^	\$	1.021	921	0,00	
0,302 % fällig am 25.09.2047 ^	17.682	19.365	0,03	0,436 % fällig am 10.10.2040	8.590	11.239	0,02	0,442 % fällig am 25.02.2036 ^			1.974	1.576	0,00
0,312 % fällig am 25.09.2047	13.453	12.256	0,02	0,634 % fällig am 10.06.2059	2.734	3.669	0,01	0,542 % fällig am 25.05.2035 ^			4.260	3.599	0,01
0,452 % fällig am 25.07.2046	5.988	5.334	0,01	0,834 % fällig am 10.06.2059	2.914	3.928	0,01	0,612 % fällig am 25.12.2035			3.750	3.607	0,01
0,492 % fällig am 25.02.2036	439	386	0,00	Vericrest Opportunity Loan Transferee				0,876 % fällig am 25.04.2047 ^			5.667	5.288	0,01
0,512 % fällig am 25.05.2036	4.320	3.783	0,01	2,116 % fällig am 25.04.2051	\$ 2.025	2.028	0,00	0,946 % fällig am 25.11.2046			125	115	0,00
0,532 % fällig am 25.05.2036	12.625	12.359	0,02	Verus Securitization Trust				1,036 % fällig am 25.09.2046 ^			4.677	4.136	0,01
0,552 % fällig am 25.05.2045	84	84	0,00	1,977 % fällig am 25.03.2060	2.873	2.913	0,00	1,056 % fällig am 25.07.2046 ^			6.883	4.805	0,01
0,573 % fällig am 19.04.2035	5	4	0,00	3,035 % fällig am 25.03.2060	700	724	0,00	1,076 % fällig am 25.08.2046			4.716	3.192	0,01
0,593 % fällig am 19.07.2035	52	52	0,00	3,889 % fällig am 25.03.2060	1.000	1.047	0,00	1,593 % fällig am 25.04.2047			24.597	23.891	0,03
0,642 % fällig am 25.09.2047 ^	7.666	6.720	0,01	Wachovia Mortgage Loan Trust LLC				2,539 % fällig am 25.01.2035			254	255	0,00
0,652 % fällig am 25.02.2036 ^	157	151	0,00	2,483 % fällig am 20.08.2035 ^	375	382	0,00	4,146 % fällig am 25.09.2036 ^			665	302	0,00
0,693 % fällig am 19.07.2034	158	160	0,00	2,510 % fällig am 20.10.2035 ^	336	310	0,00	4,217 % fällig am 25.10.2036 ^			10.932	5.668	0,01
1,218 % fällig am 19.12.2033	643	616	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				4,475 % fällig am 25.10.2036 ^			4.265	1.743	0,00
1,516 % fällig am 25.12.2035 ^	1.701	1.683	0,00	0,712 % fällig am 25.01.2045	1.307	1.304	0,00	5,500 % fällig am 25.07.2035 ^			1.418	1.410	0,00
2,023 % fällig am 19.10.2034	484	468	0,00	0,792 % fällig am 25.12.2045	2.161	2.095	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035 ^			109	110	0,00
2,608 % fällig am 27.12.2035 ^	196	204	0,00	0,816 % fällig am 25.02.2047 ^	3.075	2.942	0,00	5,750 % fällig am 25.01.2036 ^			2.728	2.596	0,00
2,927 % fällig am 25.05.2047 ^	3.785	3.401	0,01	0,816 % fällig am 25.03.2047 ^	688	659	0,00	5,750 % fällig am 25.02.2036 ^			195	188	0,00
Structured Asset Securities Corp.				0,832 % fällig am 25.01.2045	3.667	3.664	0,01	6,000 % fällig am 25.11.2035 ^			3.718	3.826	0,01
0,342 % fällig am 25.07.2035	2.314	2.200	0,00	0,866 % fällig am 25.06.2047	14.913	14.247	0,02	6,000 % fällig am 25.07.2036			6.071	5.705	0,01
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				0,876 % fällig am 25.04.2047	324	312	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2037			3.352	3.362	0,01
0,342 % fällig am 25.05.2036	2.537	2.080	0,00	0,886 % fällig am 25.04.2047 ^	2.495	2.300	0,00	6,312 % fällig am 25.07.2036 ^			11.769	4.199	0,01
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				0,886 % fällig am 25.05.20									

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
2,827 % fällig am 25.04.2036	\$ 3.048	\$ 2.991	0,01	Ameritrust Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust	\$ 1.853	\$ 1.850	0,00
2,843 % fällig am 25.08.2035	1.308	1.327	0,00	0,767 % fällig am 25.01.2036	\$ 14.730	\$ 14.662	0,02	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
2,844 % fällig am 25.11.2037 ^	452	450	0,00	0,797 % fällig am 25.01.2036	8.475	8.471	0,01	0,232 % fällig am 25.11.2036	988	973	0,00
2,968 % fällig am 25.08.2036 ^	1.451	1.431	0,00	0,832 % fällig am 25.12.2033	370	367	0,00	0,262 % fällig am 25.05.2035	42	41	0,00
3,003 % fällig am 25.10.2036	3.886	3.834	0,01	0,842 % fällig am 25.01.2036	4.850	4.773	0,01	0,342 % fällig am 25.04.2037 ^	3.354	3.941	0,01
3,086 % fällig am 25.09.2036 ^	2.129	2.172	0,00	0,857 % fällig am 25.05.2035	2.820	2.824	0,00	0,352 % fällig am 25.09.2036 ^	2.950	2.524	0,00
3,104 % fällig am 25.10.2036 ^	194	187	0,00	0,857 % fällig am 25.10.2035	2.408	2.405	0,00	0,392 % fällig am 25.06.2047	1.241	1.183	0,00
3,118 % fällig am 25.10.2037 ^	133	131	0,00	0,887 % fällig am 25.03.2035	3.944	3.946	0,01	0,432 % fällig am 25.12.2036	15.035	14.996	0,02
5,500 % fällig am 25.12.2021	6	6	0,00	0,962 % fällig am 25.11.2035	10.622	10.383	0,02	0,442 % fällig am 25.06.2047	10.414	9.047	0,01
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	1.330	1.348	0,00	1,052 % fällig am 25.10.2035	6.196	6.002	0,01	0,542 % fällig am 25.01.2047	3.256	3.190	0,01
Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust				1,067 % fällig am 25.07.2035	14.991	14.899	0,02	0,592 % fällig am 25.08.2036	7.340	6.844	0,01
0,581 % fällig am 15.03.2047 (a)	83.200	1.019	0,00	1,067 % fällig am 25.09.2035	5.750	5.731	0,01	0,592 % fällig am 25.05.2037	3.512	3.393	0,01
0,741 % fällig am 15.03.2047 (a)	65.193	1.002	0,00	1,112 % fällig am 25.01.2035 ^	2.410	2.400	0,00	0,632 % fällig am 25.04.2036	3.821	3.798	0,01
1,281 % fällig am 15.03.2045 (a)	72.357	1.011	0,00	1,187 % fällig am 25.09.2034	6.574	6.490	0,01	0,632 % fällig am 25.06.2036	1.850	1.850	0,00
				1,652 % fällig am 25.01.2035	1.907	1.904	0,00	0,692 % fällig am 25.02.2036	2.944	2.939	0,00
				1,742 % fällig am 25.11.2034	1.399	1.431	0,00	0,722 % fällig am 25.12.2035	2.667	2.668	0,00
				1,817 % fällig am 25.08.2035	2.000	1.960	0,00	0,737 % fällig am 25.02.2036 ^	649	650	0,00
				1,967 % fällig am 25.07.2034	2.327	2.333	0,00	0,767 % fällig am 25.11.2035 ^	1.435	1.436	0,00
				2,042 % fällig am 25.06.2034	2.367	2.365	0,00	0,827 % fällig am 25.09.2035	225	225	0,00
				2,942 % fällig am 25.07.2034	1.529	1.533	0,00	0,892 % fällig am 25.06.2036	1.591	1.593	0,00
				3,119 % fällig am 25.06.2033 ^	1.797	1.785	0,00	1,067 % fällig am 25.08.2035	656	657	0,00
				Ares European CLO DAC				1,092 % fällig am 25.10.2037	1.570	1.571	0,00
				1,120 % fällig am 21.10.2033	€ 25.000	29.692	0,04	1,097 % fällig am 25.06.2035	4.431	4.405	0,01
				Argent Mortgage Loan Trust				1,142 % fällig am 25.11.2035 ^	2.471	2.430	0,00
				0,332 % fällig am 25.05.2035	\$ 10.409	9.754	0,01	1,142 % fällig am 25.08.2037	13.597	12.938	0,02
				Argent Securities Trust				1,172 % fällig am 25.12.2035	2.332	1.900	0,00
				0,202 % fällig am 25.09.2036	16.595	7.120	0,01	1,217 % fällig am 25.02.2035	851	852	0,00
				0,312 % fällig am 25.05.2036	4.351	1.580	0,00	1,487 % fällig am 25.01.2035	1.066	1.070	0,00
				0,332 % fällig am 25.09.2036	13.005	5.709	0,01	1,847 % fällig am 25.09.2034	2.140	2.164	0,00
				0,392 % fällig am 25.06.2036	18.702	14.809	0,02	2,042 % fällig am 25.11.2039	1.571	1.576	0,00
				0,392 % fällig am 25.07.2036	37.237	33.853	0,05	2,192 % fällig am 25.09.2034	402	408	0,00
				0,412 % fällig am 25.05.2036	12.474	4.594	0,01	2,267 % fällig am 25.01.2035	2.399	2.412	0,00
				0,442 % fällig am 25.04.2036	1.834	1.219	0,00	2,342 % fällig am 25.08.2034	807	792	0,00
				0,472 % fällig am 25.03.2036	22.006	19.218	0,03	3,054 % fällig am 25.10.2036	174	176	0,00
				0,632 % fällig am 25.05.2036	737	280	0,00	3,092 % fällig am 25.02.2034	258	265	0,00
				Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				3,242 % fällig am 25.12.2042	1.976	2.061	0,00
				0,562 % fällig am 25.01.2036	14.815	14.721	0,02	6,500 % fällig am 25.10.2036 ^	2.290	1.563	0,00
				0,752 % fällig am 25.11.2035	13.994	13.756	0,02	Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust			
				0,852 % fällig am 25.02.2036	11.397	10.436	0,02	2,092 % fällig am 25.03.2037	3.251	3.288	0,01
				0,857 % fällig am 25.10.2035	5.750	5.631	0,01	Black Diamond CLO DAC			
				0,992 % fällig am 25.05.2034	313	303	0,00	0,650 % fällig am 03.10.2029	€ 11.454	13.590	0,02
				1,217 % fällig am 25.11.2034	3.569	3.591	0,01	1,244 % fällig am 03.10.2029	\$ 11.847	11.845	0,02
				1,967 % fällig am 25.04.2034	722	727	0,00	BNC Mortgage Loan Trust			
				2,267 % fällig am 25.02.2034	154	159	0,00	0,252 % fällig am 25.03.2037	11.553	11.240	0,02
				Aspen Funding Ltd.				0,342 % fällig am 25.07.2037	14.750	12.742	0,02
				1,788 % fällig am 10.07.2037	22	22	0,00	0,402 % fällig am 25.05.2037	7.878	7.522	0,01
				Asset-Backed Funding Certificates Trust				0,412 % fällig am 25.11.2036	2.190	2.164	0,00
				0,222 % fällig am 25.01.2037	615	486	0,00	0,452 % fällig am 25.10.2036	6.815	5.583	0,01
				0,232 % fällig am 25.10.2036	336	323	0,00	BNPP AM Euro CLO BV			
				0,252 % fällig am 25.01.2037	13.621	9.659	0,01	0,650 % fällig am 15.10.2031	€ 11.850	13.995	0,02
				0,312 % fällig am 25.10.2036	11.252	10.362	0,02	Bombardier Capital Mortgage Securitization Corp.			
				0,372 % fällig am 25.11.2036	11.248	7.805	0,01	7,180 % fällig am 15.12.2029	\$ 980	220	0,00
				0,512 % fällig am 25.09.2036 ^	8.516	8.272	0,01	7,440 % fällig am 15.12.2029	10.148	2.362	0,00
				0,632 % fällig am 25.11.2034	684	685	0,00	7,575 % fällig am 15.06.2030	936	228	0,00
				0,752 % fällig am 25.03.2035	5.484	5.395	0,01	Brookside Mill CLO Ltd.			
				0,792 % fällig am 25.06.2034	3.552	3.500	0,01	1,010 % fällig am 17.01.2028	10.059	10.054	0,01
				0,872 % fällig am 25.11.2033	1.154	1.139	0,00	BSPRT Issuer Ltd.			
				Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				1,123 % fällig am 15.03.2028	4.681	4.684	0,01
				0,242 % fällig am 25.12.2036	763	744	0,00	Cairn CLO BV			
				0,262 % fällig am 25.03.2036	9	9	0,00	0,670 % fällig am 31.01.2030	€ 30.000	35.596	0,05
				0,312 % fällig am 25.12.2036	6.784	6.210	0,01	Camber PLC			
				0,592 % fällig am 25.03.2036	1.062	980	0,00	0,362 % fällig am 09.11.2053	\$ 30.714	701	0,00
				0,672 % fällig am 25.03.2036	2.345	2.141	0,00	Capitalsource Real Estate Loan Trust			
				0,767 % fällig am 25.11.2035	3.208	3.211	0,01	0,578 % fällig am 20.01.2037	370	370	0,00
				0,992 % fällig am 25.11.2035	3.597	3.542	0,01	0,838 % fällig am 20.01.2037	15.000	13.767	0,02
				1,067 % fällig am 25.05.2035	2.666	2.673	0,00	0,938 % fällig am 20.01.2037	5.400	4.586	0,01
				1,067 % fällig am 25.06.2035 ^	3.310	3.211	0,01	1,038 % fällig am 20.01.2037	3.000	1.784	0,00
				1,112 % fällig am 25.07.2035	3.500	3.510	0,01	Carlyle Euro CLO DAC			
				1,937 % fällig am 25.05.2035	307	315	0,00	1,110 % fällig am 15.08.2032	€ 8.900	10.560	0,02
				2,267 % fällig am 25.09.2034	2.461	2.584	0,00	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC			
				2,792 % fällig am 25.09.2034	799	805	0,00	0,730 % fällig am 21.09.2029	2.966	3.519	0,01
				Atlas Senior Loan Fund Ltd.				1,200 % fällig am 21.09.2029	775	920	0,00
				1,058 % fällig am 20.04.2028	10.386	10.386	0,02	Carrington Mortgage Loan Trust			
				Aurium CLO DAC				0,352 % fällig am 25.02.2037	\$ 16.419	15.875	0,02
				0,670 % fällig am 16.04.2030	€ 30.000	35.579	0,05	0,842 % fällig am 25.10.2035	8.186	8.054	0,01
				Basic Asset-Backed Securities Trust				0,887 % fällig am 25.09.2035	4.252	4.216	0,01
				0,712 % fällig am 25.04.2036	\$ 411	411	0,00	1,067 % fällig am 25.05.2035	1.709	1.711	0,00
				Bastille Euro CLO DAC				1,082 % fällig am 25.06.2035	8.800	8.779	0,01
				1,150 % fällig am 15.01.2034	€ 20.000	23.902	0,03	Castle Park CLO DAC			
								0,462 % fällig am 15.01.2028	€ 1.698	2.014	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Catamaran CLO Ltd.				CoreVest American Finance Trust				0,812 % fällig am 25.08.2035	\$ 1.794	\$ 1.699	0,00
1,031 % fällig am 27.01.2028	\$ 21.870	\$ 21.859	0,03	2,968 % fällig am 15.10.2049	€ 1.498	\$ 1.501	0,00	0,812 % fällig am 25.05.2036	12.406	8.615	0,01
Cavendish Square Funding PLC				Cork Street CLO DAC				0,832 % fällig am 25.08.2047	19.829	19.512	0,03
0,321 % fällig am 11.02.2055	€ 391	464	0,00	0,590 % fällig am 27.11.2028	€ 3.448	4.090	0,01	0,932 % fällig am 25.10.2047	1.682	1.666	0,00
Centex Home Equity Loan Trust				Countrywide Asset-Backed Certificates				0,947 % fällig am 25.05.2036	726	727	0,00
0,392 % fällig am 25.06.2036	\$ 4.945	4.933	0,01	0,222 % fällig am 25.09.2046	\$ 398	398	0,00	0,992 % fällig am 25.05.2036	350	347	0,00
0,812 % fällig am 25.01.2035	3.108	3.092	0,01	0,232 % fällig am 25.06.2035	17.375	16.414	0,02	1,082 % fällig am 25.02.2036 ^	4.000	3.631	0,01
1,052 % fällig am 25.03.2035	3.157	3.087	0,00	0,232 % fällig am 25.05.2037	8.386	8.196	0,01	1,097 % fällig am 25.10.2035	10.000	10.016	0,01
6,060 % fällig am 25.09.2034	666	705	0,00	0,232 % fällig am 25.06.2037	16.306	15.452	0,02	1,142 % fällig am 25.11.2035	2.832	2.836	0,00
Chase Funding Trust				0,232 % fällig am 25.07.2037	4.743	4.499	0,01	1,157 % fällig am 25.10.2035	7.500	7.384	0,01
0,842 % fällig am 25.09.2033	107	107	0,00	0,232 % fällig am 25.07.2037 ^	2.799	2.747	0,00	1,187 % fällig am 25.12.2034	922	923	0,00
CIT Mortgage Loan Trust				0,232 % fällig am 25.08.2037 ^	2.177	2.057	0,00	1,187 % fällig am 25.04.2036 ^	2.700	2.637	0,00
1,442 % fällig am 25.10.2037	19.492	19.702	0,03	0,232 % fällig am 25.08.2037	707	700	0,00	1,292 % fällig am 25.11.2035 ^	7.978	7.846	0,01
1,592 % fällig am 25.10.2037	86.966	88.471	0,12	0,232 % fällig am 25.06.2047 ^	1.624	1.548	0,00	1,442 % fällig am 25.04.2035	3.578	3.589	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				0,242 % fällig am 25.05.2037	99	99	0,00	1,667 % fällig am 25.03.2035	2.000	1.974	0,00
0,162 % fällig am 25.05.2037	2.395	1.897	0,00	0,242 % fällig am 25.04.2047 ^	6.380	6.313	0,01	1,742 % fällig am 25.12.2034	2.351	2.383	0,00
0,232 % fällig am 25.12.2036	2.393	2.383	0,00	0,242 % fällig am 25.06.2047 ^	4.119	4.100	0,01	2,042 % fällig am 25.08.2035	5.071	5.091	0,01
0,232 % fällig am 25.01.2037	14.059	13.036	0,02	0,272 % fällig am 25.06.2047	6.333	6.294	0,01	2,192 % fällig am 25.08.2035	1.364	1.316	0,00
0,242 % fällig am 25.12.2036	1.076	564	0,00	0,272 % fällig am 25.11.2047 ^	5.101	5.202	0,01	5,115 % fällig am 25.10.2035	1.250	1.296	0,00
0,252 % fällig am 25.12.2036	22.159	14.962	0,02	0,282 % fällig am 25.11.2037	9.039	8.993	0,01	5,171 % fällig am 25.03.2035	7.258	7.430	0,01
0,267 % fällig am 25.05.2037	586	574	0,00	0,292 % fällig am 25.06.2047 ^	12.051	11.286	0,02	5,348 % fällig am 25.02.2036	5.000	5.136	0,01
0,272 % fällig am 25.01.2037	17.364	14.871	0,02	0,302 % fällig am 25.05.2047 ^	8.688	8.352	0,01	5,633 % fällig am 25.06.2035	6.897	7.239	0,01
0,292 % fällig am 25.05.2037	5.211	4.195	0,01	0,312 % fällig am 25.05.2037	10.514	10.188	0,01	5,989 % fällig am 25.10.2046 ^	356	355	0,00
0,302 % fällig am 25.12.2036	4.406	4.259	0,01	0,312 % fällig am 25.08.2037	20.000	18.781	0,03	6,270 % fällig am 25.10.2046 ^	10.194	8.831	0,01
0,352 % fällig am 25.07.2045	5.305	4.671	0,01	0,312 % fällig am 25.09.2037 ^	10.340	10.388	0,02	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.			
0,362 % fällig am 25.05.2037	32.434	30.835	0,04	0,312 % fällig am 25.06.2047	17.960	17.425	0,02	0,592 % fällig am 25.10.2034	4.004	3.922	0,01
0,372 % fällig am 25.12.2036	5.921	5.825	0,01	0,312 % fällig am 25.06.2047 ^	11.245	10.797	0,02	0,632 % fällig am 25.12.2034	6.297	6.146	0,01
0,372 % fällig am 25.01.2037	3.728	3.584	0,01	0,322 % fällig am 25.05.2037	17.052	16.260	0,02	0,812 % fällig am 25.07.2034	1.396	1.382	0,00
0,382 % fällig am 25.09.2036	10.019	9.714	0,01	0,322 % fällig am 25.07.2037 ^	20.458	17.662	0,03	0,947 % fällig am 25.08.2034	1.362	1.359	0,00
0,392 % fällig am 25.01.2037	503	475	0,00	0,322 % fällig am 25.10.2047	13.309	13.138	0,02	Countrywide Asset-Backed Securities Notes Trust			
0,412 % fällig am 25.09.2036	1.802	1.529	0,00	0,332 % fällig am 25.04.2037	1.044	958	0,00	1,092 % fällig am 25.08.2047	686	690	0,00
0,492 % fällig am 25.03.2037	3.518	3.510	0,01	0,342 % fällig am 25.01.2037	12.261	12.062	0,02	Countrywide Revolving Home Equity Loan Trust			
0,492 % fällig am 25.11.2046	7.367	7.269	0,01	0,342 % fällig am 25.01.2046 ^	20.056	19.403	0,03	0,253 % fällig am 15.05.2036	2.550	2.501	0,00
0,542 % fällig am 25.11.2045	753	751	0,00	0,342 % fällig am 25.06.2047 ^	19.800	19.174	0,03	0,273 % fällig am 15.05.2036	1.203	1.146	0,00
0,592 % fällig am 25.08.2036	684	673	0,00	0,352 % fällig am 25.12.2036 ^	9.552	9.240	0,01	0,313 % fällig am 15.12.2035	2.605	2.581	0,00
0,612 % fällig am 25.03.2036	5.431	5.262	0,01	0,352 % fällig am 25.09.2046 ^	3.189	3.108	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Asset-Backed Trust			
0,692 % fällig am 25.12.2035 ^	2.728	2.672	0,00	0,382 % fällig am 25.06.2047 ^	6.121	4.983	0,01	0,692 % fällig am 25.09.2037	236	235	0,00
5,775 % fällig am 25.10.2036	1.198	993	0,00	0,382 % fällig am 25.01.2037	13.000	11.718	0,02	Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
6,352 % fällig am 25.05.2036	429	220	0,00	0,422 % fällig am 25.03.2037 ^	9.984	10.169	0,01	3,134 % fällig am 25.02.2056	198.216	187.037	0,26
7,250 % fällig am 25.05.2036	14.632	10.374	0,02	0,432 % fällig am 25.03.2037	362	362	0,00	Credit-Based Asset Servicing & Securitization CBO Ltd.			
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				0,527 % fällig am 25.01.2045 ^	2.700	2.509	0,00	0,426 % fällig am 16.02.2041	54.641	2.152	0,00
1,022 % fällig am 25.05.2035	482	483	0,00	0,562 % fällig am 25.04.2036	3.927	3.830	0,01	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
1,067 % fällig am 25.05.2035	948	943	0,00	0,617 % fällig am 25.08.2036	4.759	4.841	0,01	0,392 % fällig am 25.05.2036	4.481	3.662	0,01
1,097 % fällig am 25.10.2034	5.169	5.028	0,01	0,647 % fällig am 25.07.2036	2.908	2.584	0,00	0,392 % fällig am 25.10.2036	3.862	3.566	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				0,652 % fällig am 25.09.2036	465	464	0,00	0,872 % fällig am 25.03.2034	561	558	0,00
0,342 % fällig am 25.06.2037	862	861	0,00	0,672 % fällig am 25.07.2036	1.041	1.042	0,00	3,114 % fällig am 25.12.2036 ^	4.869	4.857	0,01
0,352 % fällig am 25.03.2037	7.308	6.926	0,01	0,677 % fällig am 25.06.2036 ^	3.260	3.187	0,01	3,359 % fällig am 25.12.2035	1.465	1.472	0,00
0,497 % fällig am 25.08.2036	2.310	2.303	0,00	0,692 % fällig am 25.06.2036	3.964	3.934	0,01	3,467 % fällig am 25.01.2033 ^	355	357	0,00
0,527 % fällig am 25.11.2036	6.812	6.693	0,01	0,752 % fällig am 25.04.2036	9.821	9.827	0,01	3,723 % fällig am 25.04.2037	4.765	4.180	0,01
0,542 % fällig am 25.10.2036	10.326	10.298	0,02	0,782 % fällig am 25.04.2036	17.721	17.348	0,02	4,875 % fällig am 25.12.2037	1.489	1.669	0,00
0,587 % fällig am 25.10.2036	400	391	0,00	0,792 % fällig am 25.03.2036 ^	7.717	7.303	0,01	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust			
0,707 % fällig am 25.10.2035	344	360	0,00	0,797 % fällig am 25.09.2035	1.175	1.165	0,00	3,457 % fällig am 25.03.2037 ^	123	63	0,00
0,722 % fällig am 25.02.2035	2.511	2.463	0,00	0,842 % fällig am 25.05.2034	945	944	0,00	3,742 % fällig am 25.02.2037 ^	847	684	0,00
0,767 % fällig am 25.10.2035 ^	3.982	3.986	0,01	0,992 % fällig am 25.02.2036	2.655	2.653	0,00	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
1,772 % fällig am 25.07.2035	5.266	5.273	0,01	0,992 % fällig am 25.02.2036 ^	5.955	6.001	0,01	0,202 % fällig am 25.11.2036	12.290	7.323	0,01
Colony American Finance Ltd.				1,022 % fällig am 25.12.2035	502	503	0,00	0,242 % fällig am 25.07.2036	1.986	1.980	0,00
2,554 % fällig am 15.11.2048	726	726	0,00	1,067 % fällig am 25.12.2035	1.500	1.503	0,00	0,242 % fällig am 25.11.2036	2.885	1.731	0,00
Commonbond Student Loan Trust				1,067 % fällig am 25.01.2036	8.946	9.014	0,01	0,322 % fällig am 25.11.2036	1.000	609	0,00
0,942 % fällig am 25.05.2041	207	207	0,00	1,157 % fällig am 25.07.2035	7.812	7.788	0,01	0,332 % fällig am 25.10.2036	2.188	1.880	0,00
2,550 % fällig am 25.05.2041	3.862	3.938	0,01	1,232 % fällig am 25.01.2036	3.000	2.967	0,00	0,342 % fällig am 25.07.2036	2.601	2.553	0,00
Conseco Finance Corp.				1,592 % fällig am 25.10.2034	795	801	0,00	3,264 % fällig am 25.01.2037 ^	4.623	2.126	0,00
6,280 % fällig am 01.09.2030	4.142	4.328	0,01	1,592 % fällig am 25.02.2035	13.110	13.163	0,02	CSAB Mortgage-Backed Trust			
6,560 % fällig am 01.11.2028	2.887	3.022	0,00	1,742 % fällig am 25.06.2035	2.577	2.595	0,00	0,552 % fällig am 25.11.2036	8.439	1.735	0,00
6,760 % fällig am 01.03.2030	85	86	0,00	2,042 % fällig am 25.08.2035	1.800	1.806	0,00	5,858 % fällig am 25.05.2037	6.073	2.280	0,00
6,920 % fällig am 01.12.2030	4.769	5.180	0,01	2,492 % fällig am 25.10.2034	534	557	0,00	5,898 % fällig am 25.05.2037 ^	912	343	0,00
7,060 % fällig am 01.02.2031	2.151	2.091	0,00	4,471 % fällig am 25.10.2046 ^	13.961	13.965	0,02	6,580 % fällig am 25.09.2036	2.474	1.184	0,00
7,500 % fällig am 01.03.2030	14.329	8.042	0,01	4,558 % fällig am 25.07.2036	5.717	5.746	0,01	CVC Cordatus Loan Fund DAC			
7,850 % fällig am 15.11.2026	312	331	0,00	5,430 % fällig am 25.02.2033 ^	22	21	0,00	0,650 % fällig am 21.07.2030	€ 40.000	47.461	0,07
7,860 % fällig am 01.03.2030	5.292	3.085	0,00	5,805 % fällig am 25.04.2036 ^	749	735	0,00	ECMC Group Student Loan Trust			
Conseco Finance Securitizations Corp.				5,971 % fällig am 25.09.2046 ^	3.359	3.260	0,01	1,142 % fällig am 25.05.2067	\$ 17.887	18.227	0,03
1,850 % fällig am 01.09.2033	2.878	2.882	0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				EFS Volunteer LLC			
7,100 % fällig am 01.02.2033	122	127	0,00	0,242 % fällig am 25.09.2046	387	383	0,00	1,026 % fällig am 25.10.2			

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
EquiFirst Loan Securitization Trust				GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates				0,572 % fällig am 25.10.2036	\$	5.000	\$ 3.488	0,01
0,262 % fällig am 25.04.2037	1.923	\$ 1.829	0,00	0,752 % fällig am 25.12.2035	\$	1.640	\$ 1.618	0,00		2.526	2.491	0,00
EquiFirst Mortgage Loan Trust				GE-WMC Mortgage Securities Trust				0,797 % fällig am 25.01.2036		4.685	4.534	0,01
1,892 % fällig am 25.04.2035	2.091	2.079	0,00	0,352 % fällig am 25.08.2036	9.718	9.286	0,01	0,887 % fällig am 25.11.2035		2.103	2.097	0,00
2,717 % fällig am 25.12.2034	657	659	0,00	Goodgreen Trust				0,932 % fällig am 25.01.2035		840	826	0,00
3,467 % fällig am 25.10.2034	1.104	1.171	0,00	3,930 % fällig am 15.10.2053	16.759	17.828	0,03	0,992 % fällig am 25.12.2034		521	522	0,00
FAB CBO BV				Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				1,037 % fällig am 25.11.2035		409	405	0,00
0,482 % fällig am 20.08.2080	€	879	905	1,253 % fällig am 15.09.2037	49.950	49.972	0,07	1,187 % fällig am 25.01.2035		110	109	0,00
FBR Securitization Trust				GSAA Home Equity Trust				1,337 % fällig am 25.05.2035		1.764	1.830	0,00
0,827 % fällig am 25.11.2035	\$	11.731	10.436	0,172 % fällig am 25.02.2037	6.974	2.910	0,00	1,592 % fällig am 25.03.2035		867	878	0,00
Fieldstone Mortgage Investment Trust				0,192 % fällig am 25.09.2036	4.481	1.450	0,00	1,742 % fällig am 25.12.2034		894	908	0,00
0,332 % fällig am 25.11.2036	3.760	2.754	0,00	0,192 % fällig am 25.03.2037	8.984	3.662	0,01	1,792 % fällig am 25.11.2034		646	660	0,00
0,372 % fällig am 25.11.2036	12.984	12.246	0,02	0,192 % fällig am 25.12.2046	3.191	2.003	0,00	1,842 % fällig am 25.11.2034		501	504	0,00
0,472 % fällig am 25.05.2036	8.792	7.168	0,01	0,212 % fällig am 25.11.2036	5.741	2.143	0,00	Home Equity Loan Trust				
0,572 % fällig am 25.11.2036	3.005	2.209	0,00	0,232 % fällig am 25.12.2046	8.129	3.320	0,01	0,322 % fällig am 25.04.2037	841	812	0,00	
0,737 % fällig am 25.02.2036	13.482	12.298	0,02	0,262 % fällig am 25.03.2047	22.007	8.851	0,01	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
2,117 % fällig am 25.02.2035	2.488	2.434	0,00	0,272 % fällig am 25.07.2036	1.440	483	0,00	0,212 % fällig am 25.04.2037	7.008	5.775	0,01	
Finance America Mortgage Loan Trust				0,412 % fällig am 25.06.2036	4.847	1.652	0,00	0,232 % fällig am 25.11.2036	7.326	6.900	0,01	
1,037 % fällig am 25.11.2034	629	615	0,00	0,432 % fällig am 25.09.2036	6.098	2.018	0,00	0,252 % fällig am 25.11.2036	5.303	5.038	0,01	
1,112 % fällig am 25.11.2034	459	448	0,00	0,452 % fällig am 25.03.2036	13.462	6.384	0,01	0,262 % fällig am 25.04.2037	3.740	3.102	0,00	
First Franklin Mortgage Loan Trust				0,452 % fällig am 25.12.2036	14.580	5.696	0,01	0,282 % fällig am 25.04.2037	11.435	8.709	0,01	
0,202 % fällig am 25.12.2037	852	824	0,00	0,472 % fällig am 25.03.2036	6.937	3.459	0,01	0,282 % fällig am 25.07.2037	8.948	4.941	0,01	
0,212 % fällig am 25.12.2036	10.916	10.392	0,02	0,572 % fällig am 25.11.2036	5.300	2.622	0,00	0,332 % fällig am 25.08.2036	6.588	5.870	0,01	
0,232 % fällig am 25.09.2036	39	39	0,00	0,692 % fällig am 25.03.2036	4.172	2.821	0,00	0,332 % fällig am 25.11.2036	602	518	0,00	
0,232 % fällig am 25.12.2036	15.291	8.945	0,01	0,692 % fällig am 25.05.2047	156	122	0,00	0,332 % fällig am 25.04.2037	12.441	9.540	0,01	
0,242 % fällig am 25.03.2037	744	457	0,00	0,812 % fällig am 25.10.2035	4.498	4.257	0,01	0,452 % fällig am 25.06.2036	4.604	4.457	0,01	
0,252 % fällig am 25.11.2036	15.107	14.936	0,02	0,827 % fällig am 25.06.2035	2.485	2.479	0,00	0,472 % fällig am 25.06.2036	150	149	0,00	
0,252 % fällig am 25.12.2037	10.794	10.072	0,01	0,852 % fällig am 25.01.2036	465	54	0,00	0,752 % fällig am 25.03.2036	6.346	6.131	0,01	
0,302 % fällig am 25.12.2037	15.943	14.930	0,02	1,037 % fällig am 25.08.2035	1.604	1.564	0,00	1,157 % fällig am 25.08.2035	1.000	997	0,00	
0,392 % fällig am 25.08.2036	239	234	0,00	5,558 % fällig am 25.05.2035	453	449	0,00	1,337 % fällig am 25.03.2035	3.990	3.997	0,01	
0,402 % fällig am 25.07.2036	5.830	5.734	0,01	5,676 % fällig am 25.09.2035	4.231	3.632	0,01	HSI Asset Securitization Corp. Trust				
0,412 % fällig am 25.04.2036	6.691	6.527	0,01	5,788 % fällig am 25.05.2037 ^	6.761	4.141	0,01	0,242 % fällig am 25.12.2036	3.454	3.222	0,01	
0,412 % fällig am 25.06.2036	8.548	8.410	0,01	5,917 % fällig am 25.03.2037 ^	2.494	682	0,00	0,272 % fällig am 25.02.2036	227	227	0,00	
0,572 % fällig am 25.08.2036	10.024	9.885	0,01	6,000 % fällig am 25.08.2047 ^	236	232	0,00	0,282 % fällig am 25.01.2037	15.956	13.643	0,02	
0,572 % fällig am 25.10.2036	17.032	14.060	0,02	6,300 % fällig am 25.03.2037 ^	6.176	1.950	0,00	0,312 % fällig am 25.12.2036	17.356	9.512	0,01	
0,652 % fällig am 25.03.2036	6.195	6.161	0,01	6,376 % fällig am 25.09.2036	774	308	0,00	0,342 % fällig am 25.05.2037	7.190	7.022	0,01	
0,692 % fällig am 25.02.2036	4.939	4.752	0,01	6,459 % fällig am 25.09.2036 ^	5.180	2.065	0,00	0,352 % fällig am 25.04.2037	13.561	8.912	0,01	
0,737 % fällig am 25.11.2035	1.696	1.696	0,00	6,483 % fällig am 25.03.2037 ^	5.907	2.386	0,00	0,442 % fällig am 25.02.2036	2.065	1.958	0,00	
0,767 % fällig am 25.11.2035	356	354	0,00	6,500 % fällig am 25.08.2047	1.261	883	0,00	0,452 % fällig am 25.12.2035	2.514	2.498	0,00	
0,767 % fällig am 25.11.2036	352	353	0,00	6,599 % fällig am 25.03.2037	2.285	762	0,00	0,532 % fällig am 25.12.2036	17.308	6.788	0,01	
0,782 % fällig am 25.01.2036	3.874	3.707	0,01	6,705 % fällig am 25.03.2046 ^	102	102	0,00	0,707 % fällig am 25.01.2036	10.616	10.442	0,02	
0,797 % fällig am 25.05.2036	2.541	2.534	0,00	GSAMP Trust				Humboldt Americas LLC				
0,812 % fällig am 25.10.2035	1.043	1.042	0,00	0,142 % fällig am 25.12.2046	361	233	0,00	0,000 % fällig am 31.07.2022	COP	20.000.000	4.905	0,01
0,812 % fällig am 25.11.2035	3.378	3.308	0,01	0,172 % fällig am 25.08.2036	2.865	2.539	0,00	7,078 % fällig am 30.11.2021	CLP	4.120.528	5.182	0,01
0,827 % fällig am 25.07.2035	1.481	1.482	0,00	0,192 % fällig am 25.12.2046	1.623	1.058	0,00	IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
0,842 % fällig am 25.12.2035	5.000	4.919	0,01	0,212 % fällig am 25.09.2036	19.877	9.377	0,01	2,267 % fällig am 25.11.2034	\$	262	263	0,00
0,917 % fällig am 25.06.2034	1.820	1.819	0,00	0,212 % fällig am 25.12.2036	5.646	3.501	0,01	IndyMac Manufactured Housing Contract Pass-Through Certificates				
1,037 % fällig am 25.03.2035	1.444	1.440	0,00	0,232 % fällig am 25.11.2036	5.707	3.514	0,01	6,750 % fällig am 25.02.2028	13	13	0,00	
1,037 % fällig am 25.09.2035	6.361	5.999	0,01	0,232 % fällig am 25.03.2047	8.081	7.759	0,01	IXIS Real Estate Capital Trust				
1,517 % fällig am 25.10.2034	650	655	0,00	0,242 % fällig am 25.08.2036	4.136	4.085	0,01	0,152 % fällig am 25.05.2037	22.829	7.957	0,01	
1,892 % fällig am 25.09.2034	1.708	1.736	0,00	0,242 % fällig am 25.12.2046	547	360	0,00	0,242 % fällig am 25.01.2037	15.096	7.404	0,01	
First NLC Trust				0,252 % fällig am 25.01.2037	18.347	13.495	0,02	Jamestown CLO Ltd.				
0,162 % fällig am 25.08.2037	7.122	4.606	0,01	0,262 % fällig am 25.12.2036	8.266	5.163	0,01	1,410 % fällig am 17.01.2027	2.115	2.118	0,00	
0,232 % fällig am 25.08.2037	218	143	0,00	0,262 % fällig am 25.01.2037	8.622	8.443	0,01	JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				
0,272 % fällig am 25.08.2037	3.941	2.589	0,00	0,322 % fällig am 25.12.2046	807	538	0,00	0,602 % fällig am 25.02.2036 ^	4.343	4.312	0,01	
0,372 % fällig am 25.08.2037	55	36	0,00	0,342 % fällig am 25.10.2046	6.000	5.159	0,01	0,632 % fällig am 25.02.2036 ^	2.711	2.519	0,00	
0,827 % fällig am 25.02.2036	6.351	5.667	0,01	0,352 % fällig am 25.02.2046	803	778	0,00	0,632 % fällig am 25.03.2036	8.356	7.822	0,01	
Fremont Home Loan Trust				0,362 % fällig am 25.03.2047	9.214	8.735	0,01	0,672 % fällig am 25.01.2036	458	459	0,00	
0,192 % fällig am 25.08.2036	7.589	3.238	0,01	0,372 % fällig am 25.06.2036	3.058	3.011	0,00	0,707 % fällig am 25.10.2035 ^	1.005	991	0,00	
0,227 % fällig am 25.10.2036	14.433	13.282	0,02	0,392 % fällig am 25.12.2036	1.938	1.889	0,00	0,722 % fällig am 25.05.2035 ^	8.299	8.054	0,01	
0,232 % fällig am 25.01.2037	25.980	17.369	0,02	0,412 % fällig am 25.04.2036	5.899	4.596	0,01	0,737 % fällig am 25.10.2035	4.786	4.424	0,01	
0,242 % fällig am 25.10.2036	14.044	7.745	0,01	0,412 % fällig am 25.05.2046	1.545	1.539	0,00	0,842 % fällig am 25.06.2035	7.869	7.827	0,01	
0,312 % fällig am 25.11.2036	7.448	3.689	0,01	0,462 % fällig am 25.03.2047	3.302	2.844	0,00	1,112 % fällig am 25.07.2035	1.767	1.770	0,00	
0,372 % fällig am 25.02.2037	16.973	14.011	0,02	0,677 % fällig am 25.01.2036	3.286	3.289	0,00	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
0,412 % fällig am 25.05.2036	9.839	7.392	0,01	0,707 % fällig am 25.01.2036	2.504	2.460	0,00	0,172 % fällig am 25.12.2036	3.541	2.257	0,00	
0,432 % fällig am 25.02.2036	5.639	5.500	0,01	0,737 % fällig am 25.11.2035 ^	5.685	5.416	0,01	0,232 % fällig am 25.07.2036	215	215	0,00	
0,452 % fällig am 25.04.2036	1.081	1.078	0,00	0,962 % fällig am 25.11.2034	1.592	1.583	0,00	0,242 % fällig am 25.12.2036	6.468	4.171	0,01	
0,632 % fällig am 25.02.2036	300	279	0,00	0,977 % fällig am 25.07.2045 ^	8.023	7.967	0,01	0,252 % fällig am 25.01.2036	119	120	0,00	
0,707 % fällig am 25.11.2035	5.829	5.603	0,01	0,992 % fällig am 25.11.2035 ^	5.789	5.690	0,01	0,272 % fällig am 25.07.2036	593	343	0,00	
0,752 % fällig am 25.01.2036	1.987	1.950	0,00	1,067 % fällig am 25.04.2035 ^	2.738	2.723	0,00	0,282 % fällig am 25.03.2046	6.833	6.802	0,01	
0,767 % fällig am 25.01.2036	6.546	5.974	0,01	1,142 % fällig am 25.06.2034	455	447	0,00	0,302 % fällig am 25.10.2036	10.300	10.143	0,01	
0,772 % fällig am 25.11.2035	893	891										

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
0,382 % fällig am 25.07.2036	\$ 3.250	\$ 3.239	0,01	MASTR Asset-Backed Securities Trust				0,767 % fällig am 25.12.2034	\$ 1.127	\$ 1.105	0,00
0,392 % fällig am 25.07.2036	3.786	3.133	0,01	0,142 % fällig am 25.10.2036	\$ 4.418	\$ 1.923	0,00	0,767 % fällig am 25.09.2035	633	623	0,00
0,392 % fällig am 25.01.2037	336	327	0,00	0,192 % fällig am 25.08.2036	9.408	4.356	0,01	0,797 % fällig am 25.12.2034	532	504	0,00
0,392 % fällig am 25.03.2037	7.347	7.100	0,01	0,192 % fällig am 25.10.2036	6.488	4.240	0,01	0,832 % fällig am 25.01.2034	2.762	2.728	0,00
0,497 % fällig am 25.05.2036	3.567	3.512	0,01	0,222 % fällig am 25.10.2036	600	364	0,00	1,007 % fällig am 25.07.2034	582	580	0,00
0,572 % fällig am 25.05.2036	1.067	1.068	0,00	0,227 % fällig am 25.08.2036	8.467	4.339	0,01	1,007 % fällig am 25.03.2035	1.292	1.293	0,00
0,572 % fällig am 25.11.2036	5.325	4.978	0,01	0,237 % fällig am 25.01.2037	24.568	9.988	0,01	1,022 % fällig am 25.11.2034	2.323	2.322	0,00
0,602 % fällig am 25.04.2036	8.083	7.027	0,01	0,242 % fällig am 25.10.2036	1.039	462	0,00	1,022 % fällig am 25.02.2035	3.151	3.143	0,01
1,092 % fällig am 25.11.2036	5.085	5.095	0,01	0,252 % fällig am 25.10.2036	8.493	5.619	0,01	1,037 % fällig am 25.01.2035	5.546	5.327	0,01
4,541 % fällig am 25.01.2037 ^	3.202	2.225	0,00	0,262 % fällig am 25.10.2036	2.294	2.275	0,00	1,067 % fällig am 25.04.2035	1.585	1.615	0,00
6,630 % fällig am 25.07.2036 ^	11.182	4.838	0,01	0,302 % fällig am 25.05.2037	1.977	1.926	0,00	1,092 % fällig am 25.07.2037	15.795	15.667	0,02
Kodiak CDO Ltd.				0,312 % fällig am 25.11.2036	11.310	8.428	0,01	1,112 % fällig am 25.08.2034	358	359	0,00
2,222 % fällig am 07.08.2037	6.790	6.518	0,01	0,332 % fällig am 25.08.2036	4.561	2.172	0,00	1,142 % fällig am 25.04.2035	292	290	0,00
KVK CLO Ltd.				0,392 % fällig am 25.04.2036	2.383	882	0,00	1,142 % fällig am 25.06.2035 ^	3.750	3.635	0,01
1,086 % fällig am 14.01.2028	11.603	11.612	0,02	0,392 % fällig am 25.06.2036	2.436	1.342	0,00	1,247 % fällig am 25.12.2034	582	579	0,00
Legacy Mortgage Asset Trust				0,392 % fällig am 25.08.2036	15.888	7.802	0,01	1,892 % fällig am 25.05.2034	1.205	1.222	0,00
0,000 % fällig am 25.12.2056 (a)	149.447	886	0,00	0,572 % fällig am 25.03.2036	3.882	3.136	0,01	2,717 % fällig am 25.03.2034	794	804	0,00
0,125 % fällig am 26.12.2057 (a)	95.855	308	0,00	0,592 % fällig am 25.11.2035	2.073	1.508	0,00	Morgan Stanley Capital, Inc. Trust			
1,287 % fällig am 26.12.2057 (a)	46.797	613	0,00	0,662 % fällig am 25.01.2036	4.496	4.455	0,01	0,632 % fällig am 25.03.2036	11.468	10.368	0,02
3,086 % fällig am 25.12.2056	149.442	140.670	0,20	0,782 % fällig am 25.03.2035	3.533	3.538	0,01	0,647 % fällig am 25.01.2036	2.869	2.501	0,00
3,504 % fällig am 26.08.2058	17.864	17.564	0,03	0,792 % fällig am 25.09.2034	2.852	2.803	0,00	0,672 % fällig am 25.01.2036	2.452	2.417	0,00
4,000 % fällig am 25.02.2058	5.067	5.364	0,01	0,842 % fällig am 25.10.2035 ^	5.870	5.817	0,01	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
4,000 % fällig am 26.08.2058	44.146	45.947	0,06	1,097 % fällig am 25.03.2035	2.600	2.606	0,00	0,262 % fällig am 25.04.2037	20.057	13.288	0,02
4,050 % fällig am 25.01.2058	29.758	30.223	0,04	1,242 % fällig am 25.08.2037	8.334	8.018	0,01	0,412 % fällig am 25.04.2036	8.515	7.004	0,01
4,250 % fällig am 25.02.2058	1.575	1.746	0,00	1,817 % fällig am 25.06.2035	941	942	0,00	0,602 % fällig am 25.02.2036	7.308	6.982	0,01
4,250 % fällig am 26.08.2058	35.727	39.564	0,06	2,627 % fällig am 25.06.2035	2.496	2.598	0,00	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust			
4,275 % fällig am 25.02.2058	1.575	1.310	0,00	MASTR Specialized Loan Trust				0,162 % fällig am 25.11.2036	7.705	3.523	0,01
4,500 % fällig am 25.02.2058	1.575	1.722	0,00	0,352 % fällig am 25.06.2046	2.495	2.417	0,00	0,242 % fällig am 25.11.2036	6.336	2.932	0,00
4,537 % fällig am 26.12.2057	48.475	50.747	0,07	0,462 % fällig am 25.01.2037	4.396	2.506	0,00	0,392 % fällig am 25.07.2036	15.487	8.394	0,01
Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust				3,092 % fällig am 25.07.2035	745	788	0,00	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
6,630 % fällig am 15.04.2040	5.290	5.623	0,01	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust				0,172 % fällig am 25.11.2036	1.542	615	0,00
Lehman XS Trust				0,272 % fällig am 25.06.2037	852	772	0,00	0,212 % fällig am 25.04.2037	17.467	7.436	0,01
0,292 % fällig am 25.02.2037	13.364	13.099	0,02	1,092 % fällig am 25.10.2037	9.447	9.175	0,01	0,262 % fällig am 25.11.2036	1.645	666	0,00
0,402 % fällig am 25.03.2037	3.710	3.228	0,01	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0,262 % fällig am 25.01.2047 ^	4.152	1.587	0,00
0,412 % fällig am 25.05.2036	5.049	5.593	0,01	0,202 % fällig am 25.07.2037	7.084	3.763	0,01	0,332 % fällig am 25.04.2037	4.189	1.824	0,00
0,432 % fällig am 25.10.2036	2.493	2.453	0,00	0,212 % fällig am 25.02.2037	4.387	1.884	0,00	0,432 % fällig am 25.10.2036	9.102	3.952	0,01
0,432 % fällig am 25.12.2036	5.439	4.963	0,01	0,232 % fällig am 25.05.2037	6.022	3.869	0,01	0,632 % fällig am 25.04.2037	17.639	7.942	0,01
0,452 % fällig am 25.06.2036	16	16	0,00	0,242 % fällig am 25.08.2037	18.295	14.474	0,02	5,577 % fällig am 25.10.2046 ^	4.650	1.770	0,00
0,512 % fällig am 25.06.2046	6.889	7.099	0,01	0,282 % fällig am 25.04.2047	533	306	0,00	5,763 % fällig am 25.01.2047	1.376	617	0,00
0,552 % fällig am 25.02.2037	7.870	6.402	0,01	0,352 % fällig am 25.07.2037	2.512	1.391	0,00	5,988 % fällig am 25.11.2036 ^	6.702	2.414	0,00
0,612 % fällig am 25.05.2046 ^	2.111	2.023	0,00	0,412 % fällig am 25.03.2037	8.585	8.017	0,01	6,250 % fällig am 25.02.2037	4.483	3.752	0,01
0,612 % fällig am 25.02.2047	3.885	3.862	0,01	0,542 % fällig am 25.02.2047	259	185	0,00	6,298 % fällig am 25.10.2036 ^	9.747	3.370	0,01
0,672 % fällig am 25.09.2036	5.641	5.380	0,01	0,592 % fällig am 25.07.2037	413	142	0,00	Morgan Stanley Structured Trust			
5,077 % fällig am 25.01.2036 ^	2.654	2.654	0,00	0,612 % fällig am 25.03.2037	2.939	1.297	0,00	0,322 % fällig am 25.06.2037	7.382	7.319	0,01
6,390 % fällig am 25.04.2036 ^	81	99	0,00	0,692 % fällig am 25.12.2036	2.861	2.729	0,00	Mountain View CLO Ltd.			
6,790 % fällig am 24.06.2046	2.186	2.227	0,00	0,692 % fällig am 25.01.2037	7.173	6.764	0,01	0,984 % fällig am 15.10.2026	755	755	0,00
Long Beach Mortgage Loan Trust				0,812 % fällig am 25.10.2035	1.945	1.857	0,00	1,274 % fällig am 16.10.2029	50.000	50.000	0,07
0,182 % fällig am 25.09.2036	14.919	5.944	0,01	1,172 % fällig am 25.10.2035	332	332	0,00	Nassau Ltd.			
0,202 % fällig am 25.11.2036	359	156	0,00	1,217 % fällig am 25.08.2036	7.311	7.311	0,01	1,334 % fällig am 15.10.2029	21.000	20.968	0,03
0,212 % fällig am 25.08.2036	22.259	12.016	0,02	METAL Cayman Ltd.				National Collegiate Student Loan Trust			
0,242 % fällig am 25.11.2036	17.859	13.467	0,02	4,581 % fällig am 15.10.2042	29.430	26.366	0,04	0,402 % fällig am 25.05.2032	12.449	12.101	0,02
0,252 % fällig am 25.08.2036	2.827	1.537	0,00	MMcapS Funding Ltd.				0,412 % fällig am 27.10.2031	22.303	21.984	0,03
0,252 % fällig am 25.09.2036	11.186	4.533	0,01	0,485 % fällig am 01.12.2035	3.046	2.939	0,00	0,442 % fällig am 25.03.2033	14.823	14.464	0,02
0,252 % fällig am 25.10.2036	31.819	13.932	0,02	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				0,462 % fällig am 25.06.2033	5.674	5.542	0,01
0,252 % fällig am 25.12.2036	28.883	22.602	0,03	0,162 % fällig am 25.10.2036	3.277	2.129	0,00	Nationstar Home Equity Loan Trust			
0,292 % fällig am 25.07.2036	7.013	3.660	0,01	0,182 % fällig am 25.01.2037	18.473	11.274	0,02	0,372 % fällig am 25.09.2036	150	150	0,00
0,322 % fällig am 25.12.2036	1.624	838	0,00	0,192 % fällig am 25.07.2036	7.245	3.656	0,01	Navient Private Education Loan Trust			
0,332 % fällig am 25.08.2036	3.485	1.922	0,00	0,192 % fällig am 25.10.2036	1.580	938	0,00	2,223 % fällig am 15.12.2045	10.951	11.274	0,02
0,382 % fällig am 25.07.2036	6.171	5.046	0,01	0,202 % fällig am 25.10.2036	4.452	2.908	0,00	2,650 % fällig am 15.12.2028	7.302	7.437	0,01
0,392 % fällig am 25.05.2036	11.489	7.866	0,01	0,202 % fällig am 25.12.2036	4.339	2.884	0,00	2,740 % fällig am 15.02.2029	2.940	2.990	0,00
0,392 % fällig am 25.07.2036	2.727	1.438	0,00	0,202 % fällig am 25.02.2037	3.586	1.582	0,00	New Century Home Equity Loan Trust			
0,412 % fällig am 25.05.2036	12.385	5.329	0,01	0,222 % fällig am 25.02.2037	109	97	0,00	0,767 % fällig am 25.03.2035	59	59	0,00
0,412 % fällig am 25.05.2046	18.710	17.511	0,03	0,232 % fällig am 25.10.2036	16.263	9.710	0,01	0,812 % fällig am 25.03.2035	4.567	4.546	0,01
0,452 % fällig am 25.03.2046	26.434	23.393	0,03	0,232 % fällig am 25.05.2037	31.659	28.042	0,04	0,827 % fällig am 25.10.2035	10.000	9.435	0,01
0,472 % fällig am 25.03.2046	2.927	1.430	0,00	0,242 % fällig am 25.12.2036	12.829	8.562	0,01	0,857 % fällig am 25.02.2035	5.241	5.185	0,01
0,612 % fällig am 25.08.2045	733	729	0,00	0,242 % fällig am 25.02.2037	5.730	3.445	0,01	1,037 % fällig am 25.06.2035	1.425	1.412	0,00
0,652 % fällig am 25.10.2034	5.002	4.880	0,01	0,292 % fällig am 25.05.2037	8.874	6.373	0,01	1,037 % fällig am 25.09.2035	9.200	9.212	0,01
0,692 % fällig am 25.01.2036	15.835	14.879	0,02	0,302 % fällig am 25.01.2037	5.888	3.645	0,01	1,067 % fällig am 25.11.2034	369	368	0,00
0,692 % fällig am 25.02.2036	13.622	12.535	0,02	0,332 % fällig am 25.09.2036	26.945	13.251	0,02	1,067 % fällig am 25.06.2035	8.002	7.836	0,01
0,852 % fällig am 25.08.2045	840	840	0,00	0,342 % fällig am 25.07.2036	10.848	9.671	0,01	1,097 % fällig am 25.07.2035	12.000	11.855	0,02
0,872 % fällig am 25.08.2035	11.492	11.372	0,02	0,342 % fällig am 25.12.2036	0	0	0,00	1,157 % fällig am 25.03.2035	342	340	0,00
1,142 % fällig am 25.06.2035	7.875	7.911	0,01	0,352 % fällig am 25.02.2037	990	604	0,00	2,492 % fällig am 25.01.2034	24	26	0,00
1,242 % fällig am 25.09.2034	1.647	1.688	0,00	0,392 % fällig am 25.06.2036	3.769	2.491	0,00	2,822 % fällig am 25.10.2033	12	12	0,00
1,517 % fällig am 25.02.2035	9.828	9.825	0,01	0,392 % fällig am 25.07.2036	3.835	1.977	0,00	Newcastle Mortgage Securities Trust			
LP Credit Card ABS Master Trust											

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
0,492 % fällig am 25.02.2037 ^	\$ 10.788	\$ 4.059	0,01	0,352 % fällig am 25.11.2036	\$ 3.425	\$ 3.395	0,01	0,782 % fällig am 25.11.2035	\$ 2.008	\$ 2.005	0,00
0,572 % fällig am 25.03.2036	3.843	3.686	0,01	0,402 % fällig am 25.06.2047	565	529	0,00	0,797 % fällig am 25.10.2035	3.047	2.778	0,00
0,752 % fällig am 25.11.2035	5.042	4.837	0,01	0,422 % fällig am 25.07.2036	3.334	3.257	0,01	0,797 % fällig am 25.11.2035	476	466	0,00
0,827 % fällig am 25.05.2035	727	727	0,00	0,482 % fällig am 25.02.2036	2.113	2.101	0,00	0,812 % fällig am 25.01.2036	7.093	6.938	0,01
0,857 % fällig am 25.05.2035	1.900	1.865	0,00	3,693 % fällig am 25.11.2035	1.055	1.071	0,00	0,842 % fällig am 25.04.2034	671	666	0,00
5,992 % fällig am 25.02.2037 ^	5.771	2.303	0,00	Project Silver				0,872 % fällig am 25.06.2034	2.739	2.605	0,00
6,032 % fällig am 25.10.2036 ^	2.852	1.069	0,00	3,967 % fällig am 15.07.2044	20.328	19.972	0,03	1,052 % fällig am 25.08.2035	3.494	3.481	0,01
NovaStar Mortgage Funding Trust				RAAC Trust				1,067 % fällig am 25.07.2035	949	950	0,00
0,242 % fällig am 25.03.2037	3.485	1.703	0,00	0,362 % fällig am 25.05.2036	1.468	1.458	0,00	1,127 % fällig am 25.10.2035	2.813	2.791	0,00
0,262 % fällig am 25.01.2037	25.165	11.180	0,02	0,472 % fällig am 25.10.2046	2.811	2.765	0,00	1,337 % fällig am 25.03.2035	1.010	996	0,00
0,272 % fällig am 25.03.2037	29.961	14.716	0,02	0,592 % fällig am 25.02.2037	3.210	3.091	0,00	1,892 % fällig am 25.04.2035	1.475	1.522	0,00
0,272 % fällig am 25.09.2037	3.655	3.341	0,01	0,602 % fällig am 25.08.2036	1.652	1.178	0,00	Residential Funding Mortgage Securities Home Equity Loan Trust			
0,292 % fällig am 25.09.2037	16.912	16.630	0,02	0,692 % fällig am 25.06.2044	1.703	1.560	0,00	5,400 % fällig am 25.12.2035 ^	1.587	432	0,00
0,392 % fällig am 25.06.2036	3.564	2.985	0,00	0,742 % fällig am 25.06.2047	3.333	3.363	0,01	S-Jets Ltd.			
0,392 % fällig am 25.09.2036	6.067	3.568	0,01	0,782 % fällig am 25.11.2036	1.441	1.442	0,00	3,967 % fällig am 15.08.2042	36.807	36.490	0,05
0,412 % fällig am 25.05.2036	6.425	6.343	0,01	0,947 % fällig am 25.03.2037	2.735	2.753	0,00	Sapphire Aviation Finance Ltd.			
0,752 % fällig am 25.01.2036	579	576	0,00	1,292 % fällig am 25.10.2045	1.376	1.389	0,00	4,250 % fällig am 15.03.2040	43.115	42.296	0,06
0,782 % fällig am 25.01.2036	8.000	7.760	0,01	1,842 % fällig am 25.06.2035	194	194	0,00	Saranac CLO Ltd.			
0,797 % fällig am 25.01.2036	3.033	3.026	0,00	Raptor Aircraft Finance LLC				1,735 % fällig am 22.06.2030	35.921	35.938	0,05
0,812 % fällig am 25.10.2035	6.311	6.309	0,01	4,213 % fällig am 23.08.2044	53.144	50.957	0,07	Saxon Asset Securities Trust			
0,827 % fällig am 25.01.2036	5.000	4.852	0,01	Renaissance Home Equity Loan Trust				0,272 % fällig am 25.05.2037	3.084	2.658	0,00
0,917 % fällig am 25.06.2034	836	824	0,00	0,852 % fällig am 25.12.2032	49	47	0,00	0,292 % fällig am 25.05.2047	11.783	10.988	0,02
1,817 % fällig am 25.12.2034	3.328	3.325	0,01	5,285 % fällig am 25.01.2037	2.837	1.370	0,00	0,392 % fällig am 25.09.2036 ^	10.255	9.670	0,01
1,967 % fällig am 25.03.2035	5.115	5.145	0,01	5,294 % fällig am 25.01.2037	18.606	8.999	0,01	0,402 % fällig am 25.09.2037	15.548	15.314	0,02
OAK Hill European Credit Partners DAC				5,357 % fällig am 25.05.2035	2.352	2.346	0,00	0,492 % fällig am 25.09.2047	4.997	4.856	0,01
0,720 % fällig am 21.02.2030	€ 26.602	31.586	0,04	5,512 % fällig am 25.04.2037	8.724	3.566	0,01	0,582 % fällig am 25.09.2047	5.418	4.885	0,01
Oakwood Mortgage Investors, Inc.				5,545 % fällig am 25.01.2037	2.376	1.204	0,00	0,752 % fällig am 25.10.2035	3.710	3.672	0,01
5,050 % fällig am 15.11.2019	\$ 191	190	0,00	5,612 % fällig am 25.04.2037	5.992	2.495	0,00	0,812 % fällig am 25.05.2035	2.085	2.060	0,00
6,990 % fällig am 15.12.2026	386	397	0,00	5,675 % fällig am 25.06.2037 ^	421	163	0,00	0,812 % fällig am 25.11.2037	2.500	2.396	0,00
OCP CLO Ltd.				5,731 % fällig am 25.11.2036	4.936	2.669	0,00	0,842 % fällig am 25.11.2035	8.000	7.917	0,01
0,984 % fällig am 15.07.2027	5.516	5.517	0,01	5,742 % fällig am 25.04.2037	8.089	3.447	0,01	0,962 % fällig am 25.08.2035 ^	4.188	4.177	0,01
Option One Mortgage Loan Trust				5,744 % fällig am 25.06.2037 ^	5.934	2.321	0,00	1,842 % fällig am 25.12.2037	8.985	8.908	0,01
0,212 % fällig am 25.03.2037	9.467	9.117	0,01	5,762 % fällig am 25.08.2036	8.460	4.720	0,01	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
0,222 % fällig am 25.07.2037	5.543	4.467	0,01	5,797 % fällig am 25.08.2036	13.154	7.439	0,01	0,172 % fällig am 25.08.2036	3.062	1.320	0,00
0,232 % fällig am 25.01.2037	20.428	15.305	0,02	5,812 % fällig am 25.11.2036	8.929	4.893	0,01	0,262 % fällig am 25.08.2036 ^	13.544	5.980	0,01
0,232 % fällig am 25.02.2037	24.448	18.754	0,03	5,879 % fällig am 25.06.2037 ^	2.974	1.192	0,00	0,292 % fällig am 25.05.2037 ^	6.368	4.528	0,01
0,232 % fällig am 25.03.2037	16.976	11.557	0,02	5,893 % fällig am 25.06.2037 ^	28.633	11.505	0,02	0,312 % fällig am 25.01.2037	1.035	826	0,00
0,262 % fällig am 25.05.2037	23.182	15.847	0,02	6,120 % fällig am 25.11.2036	12.149	6.837	0,01	0,372 % fällig am 25.05.2036	8.772	5.982	0,01
0,272 % fällig am 25.04.2037	747	471	0,00	6,511 % fällig am 25.07.2034	1.807	1.814	0,00	0,372 % fällig am 25.06.2036	770	599	0,00
0,272 % fällig am 25.07.2037	5.534	4.492	0,01	6,998 % fällig am 25.09.2037 ^	2.504	1.416	0,00	0,372 % fällig am 25.09.2036	6.086	5.914	0,01
0,282 % fällig am 25.07.2037	2.358	2.193	0,00	7,238 % fällig am 25.09.2037 ^	10.393	5.876	0,01	0,392 % fällig am 25.03.2036	2.979	2.266	0,00
0,312 % fällig am 25.01.2037	8.840	6.258	0,01	Residential Asset Mortgage Products Trust				0,392 % fällig am 25.09.2036	6.569	3.232	0,01
0,312 % fällig am 25.04.2037	42.328	34.206	0,05	0,342 % fällig am 25.08.2046	497	497	0,00	0,412 % fällig am 25.09.2036	2.121	1.900	0,00
0,312 % fällig am 25.05.2037	6.168	4.582	0,01	0,442 % fällig am 25.10.2036	8.153	7.865	0,01	0,572 % fällig am 25.07.2036	9.244	4.529	0,01
0,342 % fällig am 25.03.2037	2.931	1.874	0,00	0,522 % fällig am 25.11.2035	783	783	0,00	0,632 % fällig am 25.03.2036	626	600	0,00
0,632 % fällig am 25.01.2036	23.247	22.690	0,03	0,552 % fällig am 25.12.2035	511	463	0,00	0,672 % fällig am 25.11.2035	336	336	0,00
0,827 % fällig am 25.05.2035	1.000	989	0,00	0,632 % fällig am 25.02.2036	5.646	5.448	0,01	0,677 % fällig am 25.10.2035	2.669	2.668	0,00
0,827 % fällig am 25.08.2035	2.765	2.771	0,00	0,652 % fällig am 25.07.2036	4.859	4.830	0,01	0,692 % fällig am 25.11.2035	4.017	3.663	0,01
0,887 % fällig am 25.05.2034	2.528	2.512	0,00	0,772 % fällig am 25.12.2035	6.605	6.369	0,01	0,737 % fällig am 25.10.2035	1.830	1.690	0,00
Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates				0,872 % fällig am 25.07.2035	400	399	0,00	0,767 % fällig am 25.01.2035	693	673	0,00
0,677 % fällig am 25.12.2035	155	155	0,00	0,872 % fällig am 25.09.2035	1.533	1.485	0,00	0,812 % fällig am 25.10.2035	1.750	1.636	0,00
0,782 % fällig am 25.11.2035	4.101	4.070	0,01	1,037 % fällig am 25.10.2035	4.137	3.471	0,01	0,977 % fällig am 25.10.2035	2.927	2.742	0,00
Ownit Mortgage Loan Trust				1,067 % fällig am 25.07.2035	2.213	2.169	0,00	1,052 % fällig am 25.01.2036 ^	1.076	964	0,00
3,015 % fällig am 25.12.2035 ^	1.193	852	0,00	1,112 % fällig am 25.05.2035	1.188	1.184	0,00	SG Mortgage Securities Trust			
Park Place Securities, Inc.				1,142 % fällig am 25.08.2035	3.413	3.409	0,01	0,412 % fällig am 25.07.2036	24.345	7.428	0,01
0,827 % fällig am 25.09.2035	10.114	10.048	0,01	1,157 % fällig am 25.05.2035	3.000	2.972	0,00	0,452 % fällig am 25.02.2036	4.475	2.860	0,00
1,037 % fällig am 25.09.2035	2.506	2.466	0,00	1,217 % fällig am 25.06.2035	2.600	2.584	0,00	0,632 % fällig am 25.02.2036	2.354	1.533	0,00
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				1,292 % fällig am 25.01.2035 ^	3.173	2.982	0,00	0,797 % fällig am 25.10.2035	1.586	1.530	0,00
0,827 % fällig am 25.08.2035	8.729	8.771	0,01	Residential Asset Securities Corp. Trust				0,977 % fällig am 25.10.2035	1.865	1.750	0,00
0,827 % fällig am 25.09.2035	12.049	11.966	0,02	0,252 % fällig am 25.11.2036 ^	1.684	1.833	0,00	Shackleton CLO Ltd.			
0,887 % fällig am 25.07.2035	8.644	8.649	0,01	0,299 % fällig am 25.01.2037	8.830	8.278	0,01	1,318 % fällig am 20.10.2028	32.080	32.109	0,05
1,037 % fällig am 25.06.2035	4.910	4.943	0,01	0,312 % fällig am 25.01.2037	5.000	4.789	0,01	SLM Student Loan Trust			
1,142 % fällig am 25.09.2034	5.003	5.000	0,01	0,312 % fällig am 25.02.2037	11.951	11.444	0,02	0,000 % fällig am 25.10.2039	€ 3.122	3.651	0,01
1,142 % fällig am 25.06.2035	1.992	1.891	0,00	0,342 % fällig am 25.04.2037	2.030	2.026	0,00	0,002 % fällig am 15.12.2033	2.876	3.261	0,01
1,412 % fällig am 25.01.2036 ^	8.536	8.561	0,01	0,352 % fällig am 25.07.2036	174	173	0,00	0,011 % fällig am 25.07.2039	18.482	21.724	0,03
1,667 % fällig am 25.02.2035	13.672	13.800	0,02	0,362 % fällig am 25.05.2037	90	90	0,00	0,011 % fällig am 25.01.2040	24.600	28.121	0,04
1,862 % fällig am 25.10.2034	5.729	5.940	0,01	0,372 % fällig am 25.07.2036	5.512	5.307	0,01	1,676 % fällig am 25.04.2023	\$ 20.878	21.044	0,03
1,892 % fällig am 25.12.2034	11.176	11.282	0,02	0,372 % fällig am 25.09.2036	5.234	5.102	0,01	1,876 % fällig am 25.01.2036	10.678	10.788	0,02
1,967 % fällig am 25.12.2034	9.269	9.504	0,01	0,432 % fällig am 25.05.2037	2.600	2.577	0,00	SoFi Alternative Trust			
2,192 % fällig am 25.09.2034	121	122	0,00	0,512 % fällig am 25.06.2036	1.270	1.269	0,00	4,164 % fällig am 15.06.2050	32.119	34.562	0,05
People's Choice Home Loan Securities Trust				0,527 % fällig am 25.06.2036	3.422	3.311	0,01	4,381 % fällig am 16.05.2050	32.937	35.158	0,05
0,772 % fällig am 25.12.2035 ^	13.087	12.857	0,02	0,602 % fällig am 25.04.2036	6.000	5.387	0,01	SoFi Professional Loan Program LLC			
0,887 % fällig am 25.08.2035	131	131	0,00	0,632 % fällig am 25.07.2036	3.919	3.605	0,01	1,042 % fällig am 25.01.2039	193	194	0,00
0,947 % fällig am 25.08.2035	11.764	11.382	0,02	0,652 % fällig am 25.04.2036	3.113	3.078	0,00	Soloso CDO Ltd.			
1,037 % fällig am 25.05.2035 ^	1.199	1.172	0,00	0,677 % fällig am 25.03.2036	6.214	6.195	0,01	0,460 % fällig am 07.10.2037	4.228	3.794	0,01
People's Financial Realty Mortgage Securities Trust				0,692 % fällig am 25.02.2036	2.041	2.011	0,00	Sorrento Park CLO DAC			

BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES		
	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VER-MÖGENS		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VER-MÖGENS		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VER-MÖGENS
0,172 % fällig am 25.06.2037	\$ 4.059	\$ 3.280	0,01	0,322 % fällig am 25.01.2037	\$ 18.049	\$ 13.244	0,02	2,192 % fällig am 25.11.2035	\$ 2.810	\$ 2.917	0,00
0,242 % fällig am 25.07.2036	459	455	0,00	0,322 % fällig am 25.02.2037	15.453	14.547	0,02	2,492 % fällig am 25.12.2034	817	845	0,00
0,242 % fällig am 25.03.2037	8.049	7.792	0,01	0,322 % fällig am 25.05.2047	10.680	10.473	0,02	2,642 % fällig am 25.04.2035	1.585	1.675	0,00
0,242 % fällig am 25.06.2037	17.817	14.512	0,02	0,342 % fällig am 25.09.2036	5.754	5.736	0,01	3,842 % fällig am 25.04.2035	2.197	2.298	0,00
0,252 % fällig am 25.01.2037	11.171	9.654	0,01	0,362 % fällig am 25.07.2036	4.287	4.269	0,01	Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
0,262 % fällig am 25.07.2037	1.028	958	0,00	0,382 % fällig am 25.07.2036 ^	8.561	8.683	0,01	0,832 % fällig am 25.04.2034	328	316	0,00
0,262 % fällig am 25.08.2037	10.361	9.625	0,01	0,402 % fällig am 25.02.2037	7.500	6.999	0,01	WhiteHorse Ltd.			
0,272 % fällig am 25.07.2037	8.580	8.273	0,01	0,402 % fällig am 25.08.2046	5.946	5.443	0,01	1,120 % fällig am 17.04.2027	4.577	4.583	0,01
0,292 % fällig am 25.02.2037	36.108	14.888	0,02	0,592 % fällig am 25.11.2037	26.170	23.556	0,03				
0,292 % fällig am 25.06.2037	27.906	23.118	0,03	0,617 % fällig am 25.07.2036	2.000	1.944	0,00				
0,332 % fällig am 25.07.2036	31.455	29.746	0,04	0,712 % fällig am 25.12.2036	17.890	10.968	0,02				
0,342 % fällig am 25.06.2036	11.482	11.454	0,02	0,992 % fällig am 25.08.2037	2.098	2.105	0,00				
0,342 % fällig am 25.10.2036	15.982	15.580	0,02	1,232 % fällig am 25.02.2035	584	566	0,00				
0,392 % fällig am 25.01.2037	3.400	3.246	0,01	2,117 % fällig am 25.07.2035	1.430	1.520	0,00				
0,402 % fällig am 25.06.2036 ^	7.697	7.403	0,01	2,192 % fällig am 25.11.2035	129	134	0,00				
0,437 % fällig am 25.03.2036	10.000	9.123	0,01	2,492 % fällig am 25.08.2034	165	166	0,00				
0,497 % fällig am 25.12.2036	9.016	8.848	0,01	Structured Asset Securities Corp. Trust							
0,512 % fällig am 25.06.2036 ^	8.378	7.981	0,01	0,362 % fällig am 25.05.2031	453	332	0,00				
0,557 % fällig am 25.02.2036	4.879	4.730	0,01	6,762 % fällig am 25.05.2031	1.715	1.636	0,00				
0,592 % fällig am 25.11.2036	3.795	3.675	0,01	Student Loan Consolidation Center Student Loan Trust							
0,652 % fällig am 25.10.2036	6.027	5.953	0,01	1,312 % fällig am 25.10.2027	2.666	2.680	0,00				
0,782 % fällig am 25.12.2035	10.183	9.819	0,01	Symphony CLO Ltd.							
0,932 % fällig am 25.08.2035 ^	5.450	5.251	0,01	1,064 % fällig am 15.04.2028	13.260	13.283	0,02				
0,992 % fällig am 25.10.2037	21.364	18.864	0,03	Taberna Preferred Funding Ltd.							
1,022 % fällig am 25.11.2035	100	100	0,00	0,516 % fällig am 05.05.2038	15.621	14.528	0,02				
1,042 % fällig am 25.09.2037	2.109	1.946	0,00	0,536 % fällig am 05.12.2036	25.049	21.542	0,03				
1,067 % fällig am 25.03.2036	4.961	4.605	0,01	0,606 % fällig am 05.11.2035	18.554	16.512	0,02				
1,092 % fällig am 25.09.2037	5.232	4.223	0,01	0,606 % fällig am 05.07.2035	12.573	11.190	0,02				
1,127 % fällig am 25.05.2035	900	898	0,00	Terwin Mortgage Trust							
1,172 % fällig am 25.07.2035	1.000	990	0,00	0,432 % fällig am 25.07.2037	6.480	6.295	0,01				
1,192 % fällig am 25.09.2037	1.905	1.765	0,00	0,892 % fällig am 25.09.2036	3.729	2.041	0,00				
Southern Pacific Secured Asset Corp.				0,992 % fällig am 25.08.2036	2.417	412	0,00				
0,492 % fällig am 25.03.2028	105	98	0,00	TICP CLO Ltd.							
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				1,028 % fällig am 20.04.2028	19.003	19.002	0,03				
0,212 % fällig am 25.04.2037	991	770	0,00	Tikehau CLO BV							
0,242 % fällig am 25.11.2037	10.516	7.483	0,01	0,880 % fällig am 07.12.2029	€ 19.020	22.575	0,03				
0,312 % fällig am 25.09.2037	3.624	1.822	0,00	Toro European CLO DAC							
0,372 % fällig am 25.09.2037	10.010	9.555	0,01	0,650 % fällig am 15.04.2030	30.000	35.575	0,05				
0,442 % fällig am 25.03.2037	1.926	1.387	0,00	Towd Point Mortgage Trust							
0,842 % fällig am 25.06.2036	198	198	0,00	2,750 % fällig am 25.06.2057	\$ 12.861	13.250	0,02				
0,917 % fällig am 25.05.2035	187	186	0,00	2,750 % fällig am 25.10.2057	21.868	22.411	0,03				
1,067 % fällig am 25.12.2035	2.100	2.103	0,00	Trapeza CDO Ltd.							
Springleaf Funding Trust				0,442 % fällig am 09.11.2042	691	630	0,00				
2,680 % fällig am 15.07.2030	5.689	5.702	0,01	0,484 % fällig am 06.04.2042	8.126	7.475	0,01				
START Ireland PLC				0,528 % fällig am 10.10.2041	6.277	5.885	0,01				
4,089 % fällig am 15.03.2044	16.204	16.399	0,02	0,534 % fällig am 06.07.2041	9.546	8.854	0,01				
Starwood Commercial Mortgage Trust				0,594 % fällig am 06.07.2041	9.000	7.425	0,01				
1,204 % fällig am 15.07.2038	27.810	27.822	0,04	Tricon American Homes Trust							
1,524 % fällig am 15.07.2038	14.830	14.849	0,02	2,716 % fällig am 17.09.2034	26.337	26.441	0,04				
1,724 % fällig am 15.07.2038	5.930	5.936	0,01	Tropic CDO Ltd.							
Structured Asset Investment Loan Trust				0,504 % fällig am 15.07.2036	14.208	13.071	0,02				
0,242 % fällig am 25.07.2036	3.816	3.765	0,01	0,934 % fällig am 15.04.2034	117	117	0,00				
0,264 % fällig am 25.07.2036	19.388	14.173	0,02	Truman Capital Mortgage Loan Trust							
0,412 % fällig am 25.05.2036	2.738	2.709	0,00	0,572 % fällig am 25.03.2036	1.694	1.607	0,00				
0,452 % fällig am 25.04.2036	1.751	1.745	0,00	TruPS Financials Note Securitization Ltd.							
0,472 % fällig am 25.03.2036	5.048	4.872	0,01	1,317 % fällig am 30.03.2039	35.652	33.691	0,05				
0,642 % fällig am 25.09.2034	4.484	4.390	0,01	3,580 % fällig am 20.09.2039	13.142	12.419	0,02				
0,712 % fällig am 25.01.2036	3.998	3.873	0,01	Tymon Park CLO DAC							
0,722 % fällig am 25.11.2035	10.973	10.837	0,02	0,590 % fällig am 21.01.2029	€ 3.669	4.354	0,01				
0,812 % fällig am 25.04.2033	517	511	0,00	Utah State Board of Regents							
0,812 % fällig am 25.04.2035	5.647	5.652	0,01	0,842 % fällig am 25.09.2056	\$ 6.750	6.747	0,01				
0,812 % fällig am 25.05.2035	712	712	0,00	0,842 % fällig am 25.01.2057	17.791	17.703	0,03				
0,812 % fällig am 25.01.2036	2.530	2.533	0,00	Venture CLO Ltd.							
0,842 % fällig am 25.07.2035	2.615	2.590	0,00	1,004 % fällig am 15.04.2027	17.113	17.113	0,02				
0,992 % fällig am 25.05.2035	5.973	6.004	0,01	1,064 % fällig am 15.04.2027	33.449	33.392	0,05				
1,022 % fällig am 25.06.2035	6.834	6.734	0,01	1,064 % fällig am 15.07.2027	20.068	20.093	0,03				
1,092 % fällig am 25.09.2034	4.607	4.656	0,01	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust							
1,217 % fällig am 25.07.2033	635	634	0,00	0,222 % fällig am 25.07.2047	6.167	4.592	0,01				
1,292 % fällig am 25.12.2034	1.016	1.018	0,00	0,242 % fällig am 25.01.2037	23.038	21.411	0,03				
1,367 % fällig am 25.12.2034	1.470	1.497	0,00	0,282 % fällig am 25.04.2037	27.557	13.727	0,02				
1,472 % fällig am 25.04.2033	13	13	0,00	0,342 % fällig am 25.07.2047	6.882	5.201	0,01				
Structured Asset Securities Corp.				Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust							
1,217 % fällig am 25.02.2035	2.391	2.388	0,00	0,302 % fällig am 25.03.2037	2.985	2.860	0,00				
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				0,322 % fällig am 25.04.2037	3.849	3.771	0,01				
0,222 % fällig am 25.05.2036	5.201	4.887	0,01	0,412 % fällig am 25.07.2036	6.000	5.769	0,01				
0,222 % fällig am 25.02.2037	1.950	1.928	0,00	0,437 % fällig am 25.01.2037	4.100	3.970	0,01				
0,247 % fällig am 25.09.2036	11.584	9.084	0,01	0,512 % fällig am 25.05.2036	1.375	1.375	0,00				
0,252 % fällig am 25.01.2037	10.009	9.844	0,01	0,602 % fällig am 25.05.2036	3.877	3.756	0,01				
0,262 % fällig am 25.01.2037	2.723	2.713	0,00	1,817 % fällig am 25.11.2035	3.950	3.987	0,01				
0,262 % fällig am 25.06.2037	3.806	3.797	0,01								
0,272 % fällig am 25.03.2036	2.496	2.473	0,00								
0,312 % fällig am 25.10.2037	22.319	16.774	0,02								

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS		
8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN	302.870	\$ 98.307	0,14	11,750 % fällig am 21.10.2026 ^	\$ 3.990	\$ 425	0,00	Sequa Corp. 15,000 %	4.842	\$ 5.186	0,01	
Provincia de Buenos Aires 37,854 % fällig am 12.04.2025	ARS	3.331.617	16.854	0,02	12,750 % fällig am 23.08.2022 ^	6.170	632	0,00	Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	12.927	4.016	0,01	
37,954 % fällig am 31.05.2022		724.056	4.083	0,01		5.194.888	7,23			232.548	0,32		
Qatar Government International Bond 4,400 % fällig am 16.04.2050	\$	23.610	28.792	0,04	AKTIEN								
5,103 % fällig am 23.04.2048		9.800	13.035	0,02	KOMMUNIKATIONSDIENSTE								
Republic of Greece Government International Bond 3,500 % fällig am 30.01.2023	€	4.304	5.418	0,01	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (e)	26.868.244	70.932	0,10	REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS				
3,750 % fällig am 30.01.2028 (n)		4.618	6.697	0,01	iHeartMedia, Inc. 'A' (e)	6.332.872	170.544	0,24	Uniti Group, Inc.	979.763	10.376	0,02	
3,900 % fällig am 30.01.2033 (n)		9.948	15.750	0,02	iHeartMedia, Inc. 'B' (e)	4.913.662	119.093	0,16	VICI Properties, Inc.	5.793.243	179.706	0,25	
4,000 % fällig am 30.01.2037 (n)		6.211	10.524	0,01		360.569	0,50			190.082	0,27		
4,200 % fällig am 30.01.2042 (n)		3.488	6.410	0,01	BASISKONSUMGÜTER								
Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033		26.263	30.967	0,04	Neiman Marcus Group Ltd. LLC (e)(m)	1.179.713	130.358	0,18	PARI (000S)				
2,750 % fällig am 14.04.2041		34.000	40.165	0,06	ENERGIE								
Russia Government International Bond 0,000 % fällig am 24.04.2024	RUB	18.336.201	249.549	0,35	Noble Corp. (e)	222.136	5.493	0,01	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
7,150 % fällig am 12.11.2025		20.520.713	284.144	0,39	Noble Corp. (e)(m)	2.719.988	67.265	0,09	KURZFRISTIGE SCHULDITTEL				
7,950 % fällig am 07.10.2026		7.973.492	114.129	0,16	Valaris Ltd. (e)	164.386	4.748	0,01	Credit Suisse Group Guernsey Ltd. 3,000 % fällig am 12.11.2021 (m)	CHF	24.600	29.819	0,04
Saudi Government International Bond 5,000 % fällig am 17.04.2049	\$	8.300	10.507	0,01		77.506	0,11		ARGENTINA TREASURY BILLS				
Serbia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.05.2027	€	12.767	16.870	0,02	FINANZWERTE								
South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029	\$	39.300	41.789	0,06	Cairo Mezz PLC (e)	3.408.327	484	0,00	0,146 % fällig am 08.07.2021 (f)(g)	CAD	320.000	258.411	0,36
5,750 % fällig am 30.09.2049		22.800	23.378	0,03	Eurobank Ergasias Services and Holdings S.A. 'A' (e)	40.899.918	41.288	0,06	U.S. TREASURY BILLS				
8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	372.700	24.759	0,03	Stearns Holdings LLC 'B' (e)(m)	1.114.539	1.605	0,00	0,015 % fällig am 29.07.2021 (f)(g)	\$	1.500.000	1.499.950	2,09
8,250 % fällig am 31.03.2032		451.300	28.850	0,04	Voyager Aviation Holdings LLC (e)	2.155	0	0,00	0,025 % fällig am 16.09.2021 (f)(g)(o)		929.100	929.021	1,29
8,750 % fällig am 28.02.2048		212.700	12.606	0,02		43.377	0,06		0,030 % fällig am 16.09.2021 (f)(g)(o)		70.900	70.894	0,10
8,875 % fällig am 28.02.2035		322.800	20.530	0,03	INDUSTRIEWERTE								
10,500 % fällig am 21.12.2026		12.158.400	967.741	1,35	Sierra Hamilton Holder LLC (e)(m)	2.210.032	1	0,00	0,035 % fällig am 19.10.2021 (f)(g)(o)		300.000	299.954	0,42
Turkey Government International Bond 4,250 % fällig am 13.03.2025	\$	274.600	269.965	0,38	Westmoreland Mining Holdings LLC (e)(m)	82.938	0	0,00	0,046 % fällig am 27.07.2021 (f)(g)(o)		10.000	10.000	0,01
4,625 % fällig am 31.03.2025	€	68.800	85.004	0,12		611.811	0,85			2.809.819	3,91		
5,250 % fällig am 13.03.2030	\$	155.000	147.551	0,21	OPTIONSSCHEINE								
5,600 % fällig am 14.11.2024		111.200	114.532	0,16	Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31. Dezember 2060	5.339	646	0,00	INVESTMENTFONDS				
5,750 % fällig am 22.03.2024		26.000	27.030	0,04	Sequa Corp. - Exp. 28. April 2024	174.000	118	0,00	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
6,350 % fällig am 10.08.2024		79.700	83.799	0,12	Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21. September 2055	2.022.886	45.141	0,06	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (j)	264.385.709	2.633.546	3,66	
7,250 % fällig am 23.12.2023		95.400	103.115	0,14		45.905	0,06		BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
7,625 % fällig am 26.04.2029		122.900	134.914	0,19	VORZUGSWERTPAPIERE								
Venezuela Government International Bond 6,000 % fällig am 09.12.2020 ^		9.289	920	0,00	Nationwide Building Society 10,250 % (i)	859.974	223.346	0,30	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (j)	2.903.000	294.795	0,41	
7,000 % fällig am 31.03.2038 ^		14.228	1.522	0,00						2.928.341	4,07		
7,650 % fällig am 21.04.2025 ^		28.167	2.887	0,00	PENSIONSGESCHÄFTE								
7,750 % fällig am 13.10.2019 ^		5.850	629	0,00									
8,250 % fällig am 13.10.2024 ^		35.331	3.727	0,01									
9,000 % fällig am 07.05.2023 ^		13.516	1.379	0,00									
9,250 % fällig am 15.09.2027 ^		34.519	3.676	0,01									
9,250 % fällig am 07.05.2028 ^		39.817	4.181	0,01									

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BOS	0,030 %	30.06.2021	01.07.2021	\$ 164.200	U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	\$ (168.528)	\$ 164.200	\$ 164.200	0,23
	0,030	30.06.2021	01.07.2021	53.900	U.S. Treasury Bonds 3,125 % - 4,750 % fällig am 15.02.2037 - 15.02.2043	(54.951)	53.900	53.900	0,07
BRC	0,010	28.06.2021	02.07.2021	£ 250.000	United Kingdom Gilt 3,500 % - 4,250 % fällig am 07.12.2046 - 22.07.2068	(347.951)	345.363	345.363	0,48
FICC	0,000	30.06.2021	01.07.2021	\$ 74.020	U.S. Treasury Bonds 0,125 % fällig am 15.11.2040	(75.500)	74.020	74.020	0,10

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
MBC	0,040 %	30.06.2021	01.07.2021	\$ 953.900	U.S. Treasury Notes 0,625 % – 2,750 % fällig am 15.02.2024 – 15.02.2030	\$ (883.203)	\$ 953.900	\$ 953.901	1,33
					U.S. Treasury Floating Rate Note 0,084 % fällig am 30.04.2023	(101.559)			
	0,040	30.06.2021	07.07.2021	250.000	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % - 3,875 % fällig am 15.04.2022 – 15.04.2029	(257.415)	250.000	250.000	0,35
SOG	0,060	22.06.2021	13.07.2021	377.805	United Kingdom Gilt 0,750 % - 3,750 % fällig am 22.03.2034 – 22.07.2052	(383.599)	377.804	377.810	0,53
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (2.272.706)	\$ 2.219.187	\$ 2.219.194	3,09

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	230	\$ (102)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	9.535	13.428	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	3.863	(4.907)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	2	8	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	325	(113)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	44.480	(32.948)	(0,05)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	5.270	(25.180)	(0,03)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	6.949	(60.064)	(0,08)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	330	(723)	0,00
				\$ (110.601)	(0,15)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (110.601)	(0,15)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2025	\$ 9.500	\$ 62	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	19.100	66	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2021	6.900	8	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2022	21.100	111	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	40.200	76	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20.06.2024	4.100	228	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20.12.2024	4.900	346	0,00
Energy Transfer Operating LP	1,000	20.06.2026	2.900	86	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.09.2021	6.400	1	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2022	13.900	29	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2022	600	(75)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2023	3.400	(4)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	109.900	7.391	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	15.800	554	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	84.300	534	0,00
Hess Corp.	1,000	20.06.2026	3.400	73	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 23.100	(734)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	8.800	960	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	36.300	1.600	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2026	20.500	561	0,00
Sprint Communications, Inc.	5,000	20.12.2021	\$ 2.100	(212)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2026	€ 2.600	26	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	18.500	145	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	17.900	76	0,00
				\$ 11.908	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2025	\$ 107.200	\$ (117)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-28 5-Year Index	1,000 %	20.12.2022	\$ 219.575	\$ 8.846	0,01
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000	20.06.2023	121.110	2.745	0,00
CDX.EM-30 5-Year Index	1,000	20.12.2023	418.300	20.061	0,03
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000	20.06.2024	108.852	4.053	0,01
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	78.678	3.263	0,01
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	327.800	990	0,00
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	243.400	2.481	0,00
CDX.HY-34 5-Year Index	5,000	20.06.2025	82.340	7.298	0,01
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000	20.12.2025	629.500	8.626	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	3.390.400	43.098	0,06
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 452.000	2.915	0,00
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	519.500	756	0,00
				\$ 105.132	0,14

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.09.2030	£ 254.700	\$ (3.929)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	1.041.200	(12.055)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,830	02.01.2023	BRL 1.005.200	4.872	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,836	02.01.2023	782.600	3.834	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,855	02.01.2023	260.500	1.301	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2047	CAD 2.600	378	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month CAD-Bank Bill	1,300	16.06.2047	2.500	307	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	3,400	20.06.2029	6.300	88	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,250	30.03.2023	\$ 492.700	189	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	3.590.600	16.567	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	2.458.201	19.293	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,550	15.01.2031	4.567.800	346.256	0,49
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,674	05.08.2030	62.900	4.292	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,678	29.07.2030	65.200	4.378	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,711	28.07.2030	69.000	4.433	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,715	27.07.2030	200.000	12.781	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	30.03.2031	963.600	52.509	0,07
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	3.358.883	95.774	0,13
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,800	15.01.2051	1.479.300	354.326	0,49
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,928	06.05.2026	150.100	132	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	120.615	4.011	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,144	04.11.2050	49.600	(6.632)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,150	30.03.2051	191.500	(16.540)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,215	13.10.2050	83.500	(10.546)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,235	12.05.2028	75.400	(90)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	1.456.600	(97.849)	(0,14)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,280	24.03.2028	423.400	4.544	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,317	16.12.2050	33.800	(2.929)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,485	13.01.2051	78.100	(4.669)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,595	13.01.2051	82.600	(2.612)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,945	23.06.2051	127.800	(3.988)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,848	11.01.2026	ZAR 942.000	(2.193)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,850	07.01.2026	310.300	(788)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,915	01.02.2026	1.053.900	(2.458)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,020	11.02.2026	39.300	(89)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,065	09.02.2026	1.992.900	(4.016)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,970	10.03.2026	42.600	(14)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	19.09.2028	1.510.200	6.527	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,250	15.03.2024	10.200	(26)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,300	15.03.2027	187.600	858	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD 72.880	5.296	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	1.179.040	88.046	0,12
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024	197.200	7.715	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025	361.600	14.277	0,02
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024	97.200	1.076	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	18.06.2024	124.400	(1.420)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 989.500	766	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	18.03.2030	907.700	1.862	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	17.06.2030	244.000	(1.073)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,294	30.06.2026	6.200	14	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	13.200	42	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	20.500	35	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	10.800	30	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024	24.600	25	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,453	29.12.2023	25.200	59	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050	126.900	2.992	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	17.09.2024	149.000	1.544	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,000	20.09.2026	¥ 48.830.000	(6.552)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,000	15.03.2029	344.670.000	5.698	0,01
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,020	20.09.2028	395.820.000	2.227	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,120 %	06.05.2025	MXN 957.400	\$ (2.124)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,160	06.06.2025	825.300	(1.884)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,280	23.05.2025	323.500	(664)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,280	30.05.2025	798.900	(1.633)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,535	04.05.2027	1.634.200	(4.640)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,795	02.06.2023	245.200	706	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,950	30.01.2026	752.200	2.215	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,990	30.01.2026	816.500	2.350	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	10.03.2026	1.660.900	4.606	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,350	01.09.2023	351.400	678	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,490	08.09.2026	1.322.100	2.793	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,150	11.06.2027	2.193.600	3.333	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,165	06.09.2032	266.600	90	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,360	21.08.2037	285.500	520	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,380	04.11.2026	36.300	25	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,380	14.08.2037	111.200	(455)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,480	18.06.2037	337.300	232	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,498	19.06.2037	810.000	598	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,520	18.04.2023	1.819.700	2.563	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,530	18.04.2023	2.360.500	3.346	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,545	18.04.2023	2.167.800	3.087	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,603	14.04.2025	1.995.300	4.242	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	23.01.2023	4.957.600	8.164	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	15.04.2025	288.800	609	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,640	03.01.2023	214.500	290	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,645	03.01.2023	466.500	633	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,670	05.03.2025	5.616.000	12.090	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,700	02.05.2023	713.700	1.238	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,710	26.02.2025	1.873.400	3.956	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,710	07.03.2025	347.300	800	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,715	07.03.2025	345.200	799	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,805	06.02.2023	760.000	1.134	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,818	17.02.2027	816.800	43	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,820	06.02.2023	870.300	1.487	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,865	02.02.2027	1.026.600	(102)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,880	27.12.2022	7.579.800	8.302	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,010	04.02.2027	448.800	(88)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,090	15.01.2027	1.435.600	(533)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,103	04.01.2038	3.750.800	(17.176)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,120	15.01.2027	293.600	(123)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,280	28.11.2036	690.000	(251)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,310	28.11.2036	1.066.400	(514)	0,00
					\$ 929.628	1,30
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 1.046.551	1,46

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
JPM	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,700 %	20.10.2021	771.700	\$ 1.212	\$ 708	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,975 %	15.06.2022	26.100	\$ 2.836	\$ 245	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,975	15.06.2022	26.100	2.836	5.752	0,01
BPS	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,306	29.10.2021	48.000	3.520	341	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,306	29.10.2021	48.000	3.520	6.245	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
DUB	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,990 %	22.06.2022	75.000	\$ 8.130	\$ 750	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,990	22.06.2022	75.000	8.200	16.322	0,02
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,035	24.06.2022	25.900	2.844	292	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,035	24.06.2022	25.900	2.845	5.392	0,01
MYC	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,975	15.06.2022	26.100	2.819	245	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,975	15.06.2022	26.100	2.819	5.752	0,01
							\$ 40.369	\$ 41.336	0,06

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	29.000	\$ 163	\$ 4	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,156	05.08.2021	17.500	164	55	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	17.000	159	68	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	34.000	194	127	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,641	07.07.2021	8.500	47	1	0,00
					\$ 727	\$ 255	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000 %	20.10.2021	21.800	\$ (98)	\$ (61)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	101.600	(99)	(19)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	86.400	(89)	(6)	0,00
BPS	Put – OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	21.900	(136)	(5)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	89.000	(104)	(17)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	46.200	(63)	(18)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	104.900	(130)	(99)	0,00
BRC	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	178.100	(134)	(129)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	178.100	(221)	(61)	0,00
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	159.600	(89)	(103)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	159.600	(210)	(7)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	93.100	(103)	(8)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	90.400	(95)	(7)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	379.951	(532)	(104)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	188.800	(216)	(43)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	88.100	(96)	(17)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	88.300	(97)	(16)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	102.200	(139)	(40)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	104.800	(102)	(71)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	317.600	(341)	(191)	0,00
CBK	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	27.700	(125)	(77)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	101.700	(110)	(16)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,950	15.09.2021	105.200	(101)	(23)	0,00
DUB	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	108.000	(86)	(78)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	108.000	(130)	(37)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	305.100	(312)	(76)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	89.400	(100)	(18)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	90.000	(97)	(16)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	91.600	(120)	(36)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	101.300	(114)	(95)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	15.09.2021	21.100	(123)	(47)	0,00
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	20.10.2021	33.300	(196)	(142)	0,00
	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	53.600	(43)	(37)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	92.300	(93)	(17)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	155.300	(148)	(24)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	92.500	(91)	(27)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	202.200	(213)	(50)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	108.600	(106)	(6)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	105.800	(136)	(4)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	100.300	(101)	(16)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	108.100	(108)	(15)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	213.100	(226)	(140)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	190.500	(201)	(108)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	89.100	(118)	(4)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	89.000	(91)	(7)	0,00
JPM	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	60.300	(78)	(3)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	109.100	(133)	(72)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.10.2021	771.700	(733)	(382)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	100.800	(124)	(61)	0,00
						\$ (7.451)	\$ (2.656)	0,00

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC USD versus INR	INR 81,000	27.04.2022	37.853	\$ (624)	\$ (372)	0,00
GLM	Call – OTC USD versus CAD	CAD 1,265	11.02.2022	358.763	(3.588)	(4.452)	(0,01)
JPM	Call – OTC USD versus INR	INR 80,000	27.01.2022	16.116	(218)	(107)	0,00
MYI	Call – OTC USD versus INR	81,500	22.04.2022	142.205	(2.500)	(1.227)	0,00
UAG	Call – OTC USD versus INR	81,000	02.05.2022	37.789	(572)	(384)	0,00
					\$ (7.502)	\$ (6.542)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015 %	14.07.2021	137.000	\$ (596)	\$ (622)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	14.07.2021	137.000	(596)	(14)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,013	11.08.2021	60.000	(231)	(165)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	11.08.2021	60.000	(231)	(153)	0,00
BPS	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	16.07.2021	91.400	(208)	(170)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	16.07.2021	91.400	(208)	(82)	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	26.07.2021	31.900	(209)	(234)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	26.07.2021	31.900	(209)	(150)	0,00
BRC	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	26.07.2021	31.900	(209)	(234)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	26.07.2021	31.900	(209)	(150)	0,00
FAR	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	02.09.2021	154.300	(756)	(1.160)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	02.09.2021	154.300	(756)	(267)	0,00
GLM	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	11.08.2021	22.500	(230)	(298)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	11.08.2021	22.500	(230)	(95)	0,00
MYC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	27.800	(211)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	15.07.2021	61.300	(140)	(119)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	15.07.2021	61.300	(140)	(44)	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	10.08.2021	76.100	(1.037)	(1.705)	(0,01)
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	10.08.2021	76.100	(1.037)	(63)	0,00
							\$ (7.443)	\$ (5.725)	(0,01)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	40.000	\$ (175)	\$ (36)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	05.08.2021	32.000	(114)	(47)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,797	05.08.2021	32.000	(96)	(40)	0,00
GSC	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,227	07.07.2021	16.000	(82)	(25)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,367	05.08.2021	21.600	(72)	(60)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,023	07.09.2021	31.500	(197)	(114)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,102	07.09.2021	500	(3)	(2)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,023	07.09.2021	31.500	(138)	(172)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,102	07.09.2021	500	(2)	(3)	0,00
JPM	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	12.08.2021	60.500	(194)	(99)	0,00
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	61.500	(207)	(105)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	35.000	(219)	(55)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	34.000	(211)	(66)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,313	07.09.2021	19.500	(61)	(79)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,047	07.07.2021	12.000	(41)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	104,047	07.07.2021	12.000	(21)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	54.600	(188)	(61)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	68.000	(212)	(94)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	54.600	(111)	(41)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	22.000	(38)	(36)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,695	07.09.2021	23.000	(70)	(36)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	22.500	(69)	(53)	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,375	07.07.2021	5.500	(23)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,547	07.07.2021	16.300	(64)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,609	07.07.2021	49.500	(209)	(6)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,672	07.07.2021	16.500	(71)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	100,219	07.07.2021	12.500	(76)	(5)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,203	07.07.2021	49.000	(180)	(83)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,219	07.07.2021	12.500	(63)	(20)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,227	07.07.2021	2.500	(13)	(4)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,375	07.07.2021	5.500	(15)	(6)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,422	07.07.2021	12.000	(52)	(11)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,547	07.07.2021	5.900	(14)	(3)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,641	07.07.2021	29.600	(96)	(12)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,645	07.07.2021	32.300	(106)	(13)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,766	07.07.2021	12.000	(37)	(3)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,172	05.08.2021	32.000	(199)	(51)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,188	05.08.2021	15.500	(52)	(25)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,406	05.08.2021	64.500	(277)	(120)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,688	05.08.2021	32.500	(104)	(73)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,938	05.08.2021	8.500	(27)	(23)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,188	05.08.2021	15.500	(24)	(56)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,406	05.08.2021	64.500	(146)	(170)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,281	07.09.2021	29.750	(144)	(121)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	\$ 101,281	07.09.2021	52.000	\$(146)	\$(218)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,297	07.09.2021	19.100	(66)	(79)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,328	07.09.2021	34.000	(109)	(135)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,164	07.07.2021	15.500	(60)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,211	07.07.2021	16.200	(62)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,375	07.07.2021	16.000	(50)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,703	05.08.2021	15.500	(30)	(14)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,801	05.08.2021	12.000	(53)	(12)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,078	05.08.2021	13.000	(57)	(16)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,102	05.08.2021	6.000	(26)	(7)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,344	05.08.2021	15.500	(53)	(24)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,586	05.08.2021	9.000	(32)	(17)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,609	05.08.2021	30.000	(94)	(58)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	101,844	07.09.2021	9.900	(29)	(26)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	103,844	07.09.2021	9.900	(14)	(16)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,258	05.08.2021	9.000	(27)	(19)	0,00
					\$ (5.421)	\$(2.678)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	HSBC Holdings PLC	(1,000) %	20.06.2024	€ 1.300	\$ 22	\$(46)	\$(24)	0,00
	UBS AG	(1,000)	20.06.2024	\$ 19.300	1.254	(1.584)	(330)	0,00
BPS	UBS AG	(1,000)	20.06.2024	7.000	458	(578)	(120)	0,00
					\$ 1.734	\$(2.208)	\$(474)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2022	\$ 22.300	\$(732)	\$ 843	\$ 111	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	2.400	(94)	104	10	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	2.700	(275)	316	41	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	6.300	(316)	341	25	0,00
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	22.900	(1.062)	1.169	107	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	56.800	(1.200)	2.016	816	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2021	400	(61)	62	1	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	31.500	(1.413)	1.173	(240)	0,00
BRC	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	57.900	(2.291)	2.578	287	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	8.750	(538)	584	46	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2022	675	2	5	7	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	4.500	29	8	37	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.12.2021	3.000	(272)	266	(6)	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2022	47.000	237	405	642	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	74.450	(2.101)	2.402	301	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	22.400	(429)	660	231	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	4.100	(414)	476	62	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.100	(289)	305	16	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.200	(73)	78	5	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	50.505	(1.969)	2.219	250	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	168.400	(2.908)	1.802	(1.106)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.000	(102)	143	41	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	29.600	116	(117)	(1)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2023	75.800	(1.119)	2.396	1.277	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	52.400	(847)	1.665	818	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	31.000	(203)	308	105	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	6.400	(555)	651	96	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2022	22.500	52	159	211	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	2.800	(141)	152	11	0,00
FBF	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	7.000	(270)	305	35	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	5.000	30	11	41	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	86.300	(1.084)	1.512	428	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.700	(441)	439	(2)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	176.800	(2.751)	1.590	(1.161)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	9.600	93	(31)	62	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	53.900	(807)	1.111	304	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	77.850	(714)	1.735	1.021	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	60.300	(502)	1.339	837	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2022	22.500	356	(177)	179	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2021	7.300	(1.251)	1.274	23	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2022	16.500	(1.498)	1.582	84	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2022	7.800	(443)	478	35	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.12.2021	1.400	(85)	82	(3)	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	13.500	(849)	746	(103)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	387.450	(8.475)	12.467	3.992	0,01
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2024	106.300	646	933	1.579	0,01
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	24.900	(1.425)	1.520	95	0,00

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
HUS	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	\$ 8.700	\$ (449)	\$ 441	\$ (8)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	10.200	(565)	260	(305)	0,00
	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV	1,000	20.06.2022	9.500	(536)	477	(59)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	30.100	(953)	1.029	76	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	255.100	(7.463)	7.432	(31)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	1.500	7	3	10	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	32.400	(94)	227	133	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	296.450	(4.732)	8.992	4.260	0,01
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2022	10.000	(568)	613	45	0,00
	Petrobras Mexicanos	1,000	20.12.2021	2.000	(183)	179	(4)	0,00
JPM	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	26.900	(122)	399	277	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	2.459	(336)	373	37	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	90.700	(1.766)	3.069	1.303	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	33.200	(259)	371	112	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2021	2.300	(373)	380	7	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2022	9.000	(703)	749	46	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	7.800	(304)	335	31	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2023	14.400	(434)	623	189	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.800	(339)	357	18	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	48.200	(2.857)	3.047	190	0,00
MYC	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	37.600	(2.111)	2.076	(35)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	19.000	(704)	798	94	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2022	7.100	(84)	125	41	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	47.400	(418)	1.076	658	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	79.200	(1.091)	1.702	611	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	200.100	(1.162)	1.838	676	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	4.500	19	18	37	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2022	7.000	33	63	96	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2023	54.900	(1.097)	1.816	719	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2022	67.700	156	478	634	0,00
UAG	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	2.100	(148)	156	8	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2022	29.900	(627)	777	150	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	200	(15)	16	1	0,00
					\$ (68.716)	\$ 90.380	\$ 21.664	0,03

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	ABX.HE.AA.6-1 Index	0,320 %	25.07.2045	\$ 1.227	\$ (423)	\$ 344	\$ (79)	0,00
	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	43.765	(9.453)	8.073	(1.380)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	2.000	(5)	2	(3)	0,00
BRC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	3.442	(741)	632	(109)	0,00
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	100.000	(1.840)	2.488	648	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	13.800	(464)	442	(22)	0,00
CBK	PRIMEX.ARM.2-AAA Index	4,580	25.12.2037	286	12	(8)	4	0,00
	CDX.HY-33 5-Year Index 35-100 %	5,000	20.12.2024	58.582	9.754	(87)	9.667	0,01
	DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	233.645	(4.705)	7.134	2.429
FBF	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	645.100	(3.371)	10.002	6.631	0,01
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	688.600	(4.427)	11.506	7.079	0,01
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	162.200	(1.133)	2.612	1.479	0,00
GST	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	1.130	(227)	191	(36)	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.176.350	(15.150)	27.381	12.231	0,02
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	90.500	(473)	1.403	930	0,00
JPS	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	436.500	(12.201)	16.181	3.980	0,01
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	49.500	(1.449)	1.770	321	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	171.400	(2.957)	4.739	1.782	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	171.700	(1.351)	3.116	1.765	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	45.500	(336)	751	415	0,00
	MYC	CDX.HY-33 5-Year Index 35-100 %	5,000	20.12.2024	118.545	19.753	(192)	19.561
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	66.700	(1.419)	2.113	694	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	364.800	(3.092)	6.842	3.750	0,01
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	923.900	(14.119)	22.543	8.424	0,01
UAG	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	114.300	472	269	741	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	1.200	(37)	35	(2)	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	810.495	(7.907)	16.334	8.427	0,01
UAG	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	152.400	(785)	2.352	1.567	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.386.500	(13.794)	26.436	12.642	0,02
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	15.500	(445)	606	161	0,00
				\$ (72.313)	\$ 176.010	\$ 103.697	0,14	

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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 Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,438 %	17.06.2025	CNY 674.600	\$ 0	\$ (1.132)	\$ (1.132)	0,00
CBK	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,448	17.06.2025	1.075.000	0	(1.741)	(1.741)	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,845	23.01.2025	247.000	0	232	232	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,850	23.01.2025	245.400	0	238	238	0,00
UAG	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,833	23.01.2025	255.000	0	222	222	0,00
						\$ 0	\$ (2.181)	\$ (2.181)	0,00

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 27.900	20.09.2021	\$ (9)	\$ 569	\$ 560	0,00

DEVISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€	1.536	\$ 1.870	\$ 48	\$ 0	48
	07.2021	£	2.270	\$ 3.215	79	0	79
	07.2021	\$	39.200	AUD 52.058	0	(117)	(117)
	07.2021		1.026	CAD 1.240	0	(25)	(25)
	07.2021		6.796	DKK 42.709	15	0	15
	07.2021		4.848	£ 3.488	0	(30)	(30)
	07.2021		7.613	PEN 29.008	29	(67)	(38)
	08.2021	AUD	52.058	\$ 39.205	116	0	116
	08.2021	NOK	5.965	709	16	0	16
	08.2021	\$	43.796	RUB 3.293.093	980	0	980
	09.2021	IDR	404.810.387	\$ 28.085	489	0	489
	09.2021	\$	176.765	IDR 2.547.718.102	0	(3.089)	(3.089)
	09.2021		273.449	INR 20.142.670	0	(4.892)	(4.892)
	09.2021		87.735	RUB 6.401.086	0	(1.069)	(1.069)
	02.2022	ZAR	118.059	\$ 7.307	0	(710)	(710)
	07.2021	AUD	206.836	160.740	5.457	0	5.457
	07.2021	€	79.458	96.362	2.132	0	2.132
	07.2021	£	5.790	8.035	37	0	37
	07.2021	TRY	76.016	8.865	141	0	141
	07.2021	\$	172.970	€ 144.878	0	(1.159)	(1.159)
07.2021		80.594	£ 57.839	0	(692)	(692)	
07.2021		1.724	MXN 34.196	0	(9)	(9)	
07.2021		1.341	NZD 1.847	0	(50)	(50)	
07.2021		3.681	RUB 274.586	68	0	68	
07.2021		41.486	TRY 349.631	0	(1.446)	(1.446)	
08.2021	PEN	247	\$ 67	2	0	2	
08.2021	SEK	15.910	1.904	43	0	43	
08.2021	\$	129.407	MXN 2.760.000	8.644	0	8.644	
09.2021	PEN	143.386	\$ 37.469	0	(73)	(73)	
11.2021	\$	145.680	MXN 2.940.810	0	(421)	(421)	
04.2022		25.200	INR 1.984.087	511	0	511	
07.2021	¥	3.571.541	\$ 32.655	476	0	476	
07.2021	TRY	211.232	24.567	325	0	325	
07.2021	\$	13.578	€ 11.147	0	(358)	(358)	
07.2021		355.203	£ 256.705	0	(577)	(577)	
07.2021		84.101	MXN 1.713.233	1.686	0	1.686	
07.2021		15.086	TRY 126.818	0	(518)	(518)	
08.2021	£	251.392	\$ 347.735	418	0	418	
10.2021	\$	242.857	MXN 4.957.688	2.438	0	2.438	
02.2022		37.315	ZAR 546.335	0	(182)	(182)	
07.2021		8.227	PEN 31.143	0	(97)	(97)	
08.2021	CLP	4.120.528	\$ 6.084	434	0	434	
07.2021	BRL	772.334	157.234	3.317	0	3.317	
07.2021	CHF	26.212	29.234	877	0	877	
07.2021	CLP	54.116.624	72.807	0	(1.504)	(1.504)	
07.2021	MXN	239.452	11.589	0	(420)	(420)	
07.2021	PEN	780.668	204.477	2.196	(1.604)	592	
07.2021	TRY	227.458	26.190	251	(187)	64	
07.2021	\$	198.816	BRL 1.060.476	12.524	0	12.524	
07.2021		28.472	CHF 26.212	0	(115)	(115)	
07.2021		75.651	CLP 54.116.624	0	(1.340)	(1.340)	
07.2021		5.252	DKK 33.116	29	0	29	
07.2021		440.887	PEN 1.720.885	8.759	(21)	8.738	
07.2021		32.277	RUB 2.493.132	1.760	0	1.760	
08.2021	CHF	26.212	\$ 28.496	115	0	115	
08.2021	PEN	722.961	193.658	5.234	(810)	4.424	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
	08.2021	\$	156.746	BRL	772.334	\$ 0	0,00		
	08.2021		17.996	MXN	376.347	828	0,00		
	08.2021		4.424	PEN	17.579	176	0,00		
	08.2021		39.946	RUB	3.002.160	874	0,00		
	09.2021	PEN	410.930	\$	109.870	2.282	0,00		
	09.2021	\$	72.729	CLP	54.116.624	1.459	0,00		
	09.2021		4.505	CNH	29.268	2	0,00		
	09.2021		365.059	IDR	5.259.399.958	0	(6.530)	(0,01)	
	09.2021		44.325	PEN	172.470	831	0,00		
	09.2021		114	ZAR	1.648	0	0,00		
	09.2021	ZAR	261.211	\$	19.063	943	0,00		
	11.2021	\$	229.088	MXN	4.654.142	509	0,00		
	12.2021	PEN	211.274	\$	56.420	1.170	0,00		
	12.2021	\$	129.703	INR	9.944.690	1.451	(41)	1,410	0,00
	02.2022	PEN	177.884	\$	46.794	310	0	310	0,00
	02.2022	\$	2.064	ZAR	31.183	88	(33)	55	0,00
	02.2022	ZAR	210.285	\$	13.427	0	(859)	(859)	0,00
	04.2022	\$	14.850	INR	1.169.223	302	0	302	0,00
	05.2022	PEN	5.382	\$	1.398	0	(6)	(6)	0,00
GLM	07.2021	€	1.881.477		2.290.254	59.010	0	59.010	0,08
	07.2021	MXN	2.608.892		128.643	377	(2.439)	(2.062)	0,00
	07.2021	PEN	231.249		58.139	0	(2.287)	(2.287)	0,00
	07.2021	TRY	24.516		2.775	0	(39)	(39)	0,00
	07.2021	\$	12.725	MXN	252.152	0	(79)	(79)	0,00
	07.2021		64.102	RUB	4.947.020	3.436	0	3.436	0,01
	07.2021		16.615	TRY	139.284	0	(618)	(618)	0,00
	08.2021	COP	20.255.902	\$	5.316	0	(98)	(98)	0,00
	08.2021	\$	82.409	MXN	1.700.000	2.414	0	2.414	0,00
	08.2021		58.195	PEN	231.249	2.351	0	2.351	0,00
	08.2021		59.486	RUB	4.450.445	1.051	(25)	1.026	0,00
	09.2021		15.929	HKD	123.572	0	(15)	(15)	0,00
	09.2021		111.373	RUB	8.158.558	0	(913)	(913)	0,00
	09.2021	ZAR	145.237	\$	10.551	475	0	475	0,00
	11.2021	PEN	119.911		31.991	616	0	616	0,00
	12.2021	SGD	8		6	0	0	0	0,00
	02.2022	CAD	84.150		69.702	1.742	0	1.742	0,00
	02.2022	\$	943	ZAR	13.905	2	0	2	0,00
	02.2022	ZAR	99.261	\$	6.348	0	(399)	(399)	0,00
HUS	04.2022	\$	2.612	INR	205.619	53	0	53	0,00
	07.2021	€	17.910	\$	21.508	268	0	268	0,00
	07.2021	£	37.888		53.749	1.409	0	1.409	0,00
	07.2021	\$	1.788	AUD	2.308	0	(55)	(55)	0,00
	07.2021		63.356	€	52.541	0	(1.048)	(1.048)	0,00
	07.2021		82.300	£	59.003	0	(790)	(790)	0,00
	07.2021		1	HKD	5	0	0	0	0,00
	07.2021		2.438	MXN	48.841	11	0	11	0,00
	07.2021		33.248	PEN	128.885	420	0	420	0,00
	07.2021		7.738	TRY	65.291	0	(252)	(252)	0,00
	08.2021		89.978	RUB	6.774.685	2.136	0	2.136	0,00
	09.2021		137.436	CNH	883.247	0	(1.408)	(1.408)	0,00
	09.2021		10.441	PEN	41.106	322	0	322	0,00
	09.2021		46.016	RUB	3.370.295	0	(384)	(384)	0,00
	10.2021	PEN	59.716	\$	16.159	528	0	528	0,00
	10.2021	\$	11.130	MXN	234.318	499	0	499	0,00
	12.2021		56.254	INR	4.329.284	825	0	825	0,00
IND	07.2021	BRL	2.999.585	\$	608.615	10.832	0	10.832	0,02
	08.2021	\$	606.719	BRL	2.999.585	0	(10.886)	(10.886)	(0,01)
	02.2022	ZAR	1.627.269	\$	105.373	0	(5.229)	(5.229)	(0,01)
JPM	07.2021	DKK	31.349		5.032	33	0	33	0,00
	07.2021	£	2.030		2.865	61	0	61	0,00
	07.2021	PEN	16.192		4.068	0	(158)	(158)	0,00
	07.2021	TRY	209.305		24.366	408	0	408	0,00
	07.2021	\$	5.856	DKK	36.919	32	0	32	0,00
	07.2021	€	3.379	€	2.780	0	(83)	(83)	0,00
	07.2021		12.871	£	9.276	0	(57)	(57)	0,00
	07.2021		28	PEN	109	0	0	0	0,00
	07.2021		28.917	TRY	242.587	0	(1.077)	(1.077)	0,00
	08.2021		4.072	PEN	16.192	165	0	165	0,00
	09.2021		113.705	IDR	1.638.150.656	0	(2.034)	(2.034)	0,00
	10.2021		5.041	DKK	31.349	0	(33)	(33)	0,00
	10.2021		514.989	MXN	10.471.453	3.909	0	3.909	0,01
	11.2021		106.599	CLP	77.129.441	0	(1.091)	(1.091)	0,00
	12.2021		37.570	INR	2.833.908	0	(207)	(207)	0,00
	02.2022		1.939	ZAR	28.693	11	0	11	0,00
	02.2022	ZAR	48.089	\$	3.149	0	(119)	(119)	0,00
MYI	07.2021	AUD	954		717	1	0	1	0,00
	07.2021	CAD	320.000		260.259	1.842	0	1.842	0,00
	07.2021	CHF	160		174	1	0	1	0,00
	07.2021	CNH	500		77	0	0	0	0,00
	07.2021	DKK	37.164		5.968	42	0	42	0,00
	07.2021	€	2.591.738		3.154.697	81.153	0	81.153	0,11
	07.2021	£	255.343		355.746	3.003	0	3.003	0,00
	07.2021	¥	20.001		181	1	0	1	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2021	PEN 94.146	\$ 25.804	\$ 1.218	\$ 0	\$ 1.218	0,00
	07.2021	SGD 6.254	4.652	1	(2)	(1)	0,00
	07.2021	\$ 33.796	AUD 44.674	0	(257)	(257)	0,00
	07.2021	507.531	BRL 2.711.444	32.829	0	32.829	0,05
	07.2021	10	CHF 9	0	0	0	0,00
	07.2021	25.233	€ 21.129	0	(176)	(176)	0,00
	07.2021	30.433	£ 21.853	0	(244)	(244)	0,00
	07.2021	1.061	NOK 9.076	0	(6)	(6)	0,00
	07.2021	774	PEN 3.065	27	0	27	0,00
	07.2021	32.026	RUB 2.453.491	1.470	0	1.470	0,00
	07.2021	35	SGD 47	0	0	0	0,00
	08.2021	AUD 38.690	\$ 29.269	218	0	218	0,00
	09.2021	\$ 4.979	PEN 19.767	197	0	197	0,00
	10.2021	5.979	DKK 37.164	0	(42)	(42)	0,00
	11.2021	12.053	CLP 8.711.648	0	(136)	(136)	0,00
	11.2021	162.802	MXN 3.300.000	0	(8)	(8)	0,00
	04.2022	INR 2.801.439	\$ 35.551	0	(752)	(752)	0,00
RYL	07.2021	£ 4.830	6.808	136	0	136	0,00
SCX	02.2022	ZAR 353.753	22.973	0	(1.071)	(1.071)	0,00
	07.2021	€ 6.953	8.507	260	0	260	0,00
	07.2021	£ 2.221.499	3.155.553	86.661	0	86.661	0,12
	07.2021	PEN 140.999	37.454	650	(17)	633	0,00
	07.2021	TRY 172.286	20.067	320	0	320	0,00
	07.2021	\$ 5.654	AUD 7.319	0	(159)	(159)	0,00
	07.2021	21.781	€ 17.905	0	(547)	(547)	0,00
	07.2021	2.033.807	£ 1.470.000	0	(3.076)	(3.076)	0,00
	07.2021	1.712	MXN 34.190	3	0	3	0,00
	07.2021	5.488	PEN 21.326	85	0	85	0,00
	08.2021	£ 1.454.147	\$ 2.011.744	2.735	0	2.735	0,00
	09.2021	\$ 440	PEN 1.749	18	0	18	0,00
	12.2021	PEN 13.449	\$ 3.624	106	0	106	0,00
	12.2021	\$ 28.222	INR 2.121.715	0	(249)	(249)	0,00
SOG	12.2021	5.064	SGD 6.704	0	(79)	(79)	0,00
	07.2021	DKK 44.231	\$ 7.103	49	0	49	0,00
	07.2021	\$ 36.661	RUB 2.847.754	2.217	0	2.217	0,00
	08.2021	49.917	3.764.867	1.273	0	1.273	0,00
	10.2021	7.115	DKK 44.231	0	(49)	(49)	0,00
SSB	07.2021	£ 1.881.381	\$ 2.665.909	66.874	0	66.874	0,09
	07.2021	\$ 2.421	€ 1.990	0	(61)	(61)	0,00
	07.2021	18.950	£ 13.478	0	(331)	(331)	0,00
	08.2021	£ 1.509.951	\$ 2.086.806	700	0	700	0,00
	08.2021	¥ 1.141.050	10.396	111	0	111	0,00
TOR	07.2021	HKD 1.324	171	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 309.798	CAD 374.282	0	(7.543)	(7.543)	(0,01)
	07.2021	161	HKD 1.249	0	0	0	0,00
	02.2022	ZAR 76.490	\$ 4.996	0	(203)	(203)	0,00
UAG	07.2021	AUD 87.068	67.198	1.832	0	1.832	0,00
	07.2021	\$ 142.263	AUD 187.546	0	(1.463)	(1.463)	0,00
	07.2021	10.182	€ 8.370	0	(256)	(256)	0,00
	07.2021	107.867	RUB 8.256.468	4.896	(43)	4.853	0,01
	08.2021	AUD 187.546	\$ 142.282	1.459	0	1.459	0,00
	08.2021	\$ 364.760	NOK 3.015.126	0	(14.296)	(14.296)	(0,02)
	09.2021	45.391	RUB 3.329.713	0	(309)	(309)	0,00
				\$ 456.655	\$ (95.580)	\$ 361.075	0,50

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional AUD (Hedged) thesaurierend, Investor AUD (Hedged) ausschüttend, Administrative AUD (Hedged) ausschüttend, Class E AUD (Hedged) ausschüttend und Class Z AUD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	AUD 1.423	\$ 1.091	\$ 22	\$ 0	\$ 22	0,00
	07.2021	\$ 616.363	AUD 797.819	0	(17.400)	(17.400)	(0,02)
BPS	07.2021	AUD 14.465	\$ 10.859	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	\$ 453.451	AUD 583.503	0	(15.385)	(15.385)	(0,02)
BRC	07.2021	887	1.168	0	(9)	(9)	0,00
CBK	07.2021	AUD 796.762	\$ 598.307	138	0	138	0,00
	07.2021	\$ 13.659	AUD 17.660	0	(401)	(401)	0,00
	08.2021	598.393	796.762	0	(129)	(129)	0,00
GLM	07.2021	AUD 6.311	\$ 4.872	134	0	134	0,00
HUS	07.2021	461	355	9	0	9	0,00
	07.2021	\$ 216	AUD 279	0	(7)	(7)	0,00
MYI	07.2021	AUD 338.183	\$ 255.804	1.913	0	1.913	0,00
	07.2021	\$ 1.777	AUD 2.342	0	(18)	(18)	0,00
	08.2021	255.743	338.056	0	(1.907)	(1.907)	0,00
RBC	07.2021	1.010	1.304	0	(31)	(31)	0,00
SCX	07.2021	AUD 1.161	\$ 900	28	0	28	0,00
	07.2021	\$ 3.324	AUD 4.311	0	(88)	(88)	0,00
SSB	07.2021	AUD 1.060	\$ 820	24	0	24	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
TOR	07.2021	\$ 607.648	AUD 785.006	\$ 0	\$ (18.304)	\$ (18.304)	(0,03)
UAG	07.2021	AUD 540.092	\$ 409.752	4.278	0	4.278	0,01
	07.2021	\$ 145.874	AUD 188.211	0	(4.575)	(4.575)	(0,01)
	08.2021	406.024	535.191	0	(4.165)	(4.165)	(0,01)
				\$ 6.546	\$ (62.420)	\$ (55.874)	(0,08)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	BRL 450.532	\$ 90.925	\$ 1.139	\$ 0	\$ 1.139	0,00
	07.2021	\$ 198.492	BRL 1.053.762	11.511	0	11.511	0,02
	08.2021	90.643	450.532	0	(1.150)	(1.150)	0,00
BPS	07.2021	BRL 9.315	\$ 1.844	0	(13)	(13)	0,00
	07.2021	\$ 4.060	BRL 21.149	154	0	154	0,00
GLM	07.2021	BRL 1.057.396	\$ 209.302	0	(1.425)	(1.425)	0,00
	08.2021	\$ 209.649	BRL 1.062.447	1.411	(17)	1.394	0,00
MYI	07.2021	BRL 1.055.140	\$ 210.397	119	0	119	0,00
	07.2021	\$ 197.903	BRL 1.059.127	13.169	0	13.169	0,02
	08.2021	209.728	1.055.140	0	(136)	(136)	0,00
SCX	07.2021	BRL 575.417	\$ 116.682	2.008	0	2.008	0,00
	08.2021	\$ 116.328	BRL 575.417	0	(2.028)	(2.028)	0,00
SSB	07.2021	BRL 40.000	\$ 8.039	67	0	67	0,00
	07.2021	\$ 198.602	BRL 1.053.762	11.401	0	11.401	0,01
	08.2021	8.014	40.000	0	(68)	(68)	0,00
				\$ 40.979	\$ (4.837)	\$ 36.142	0,05

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional CAD (Hedged) thesaurierend und Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	CAD 1.377	\$ 1.112	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	08.2021	\$ 1.112	CAD 1.377	0	0	0	0,00
BPS	07.2021	69.136	83.523	0	(1.686)	(1.686)	(0,01)
CBK	07.2021	CAD 81.669	\$ 66.408	456	0	456	0,00
	08.2021	\$ 66.407	CAD 81.669	0	(456)	(456)	0,00
HUS	07.2021	721	870	0	(18)	(18)	0,00
JPM	07.2021	44.442	53.806	0	(990)	(990)	0,00
MYI	07.2021	CAD 429	\$ 346	0	0	0	0,00
RBC	07.2021	\$ 617	CAD 746	0	(15)	(15)	0,00
SCX	07.2021	24.886	30.114	0	(567)	(567)	0,00
SSB	07.2021	CAD 417	\$ 344	8	0	8	0,00
	07.2021	\$ 1.775	CAD 2.197	0	(1)	(1)	0,00
TOR	07.2021	68.085	82.256	0	(1.658)	(1.658)	0,00
				\$ 464	\$ (5.391)	\$ (4.927)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 256.452	CHF 230.055	\$ 0	\$ (7.570)	\$ (7.570)	(0,01)
BPS	07.2021	101	93	0	(1)	(1)	0,00
BRC	07.2021	2.637	2.369	0	(74)	(74)	0,00
CBK	07.2021	CHF 232.160	\$ 252.176	1.016	0	1.016	0,00
	07.2021	\$ 255.058	CHF 228.691	0	(7.650)	(7.650)	(0,01)
	08.2021	252.389	232.160	0	(1.016)	(1.016)	0,00
GLM	07.2021	CHF 73	\$ 81	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 1.486	CHF 1.355	0	(20)	(20)	0,00
MYI	07.2021	CHF 114	\$ 128	4	0	4	0,00
	07.2021	\$ 250.391	CHF 225.598	0	(6.330)	(6.330)	(0,01)
SCX	07.2021	CHF 1.645	\$ 1.794	14	0	14	0,00
	07.2021	\$ 5.455	CHF 4.902	0	(153)	(153)	0,00
SSB	07.2021	CHF 5.474	\$ 5.966	44	0	44	0,00
	07.2021	\$ 815	CHF 734	0	(20)	(20)	0,00
UAG	07.2021	CHF 333	\$ 369	9	0	9	0,00
	07.2021	\$ 1.403	CHF 1.293	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 1.089	\$ (22.838)	\$ (21.749)	(0,03)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend A, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II Q, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, H Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€ 69.077	\$ 83.926	\$ 2.008	\$ 0	\$ 2.008	0,00
	07.2021	\$ 945.523	€ 772.920	0	(28.916)	(28.916)	(0,04)
BPS	07.2021	€ 208.798	\$ 248.733	1.120	0	1.120	0,00
	07.2021	\$ 2.288.159	€ 1.870.921	0	(69.432)	(69.432)	(0,10)
BRC	07.2021	€ 1.278	\$ 1.557	41	0	41	0,00
	07.2021	\$ 1.656.765	€ 1.354.266	0	(50.740)	(50.740)	(0,07)
GLM	07.2021	€ 6.165.474	\$ 5.065.034	0	(158.847)	(158.847)	(0,22)
HUS	07.2021	€ 68.277	\$ 82.820	1.850	0	1.850	0,00
	07.2021	\$ 69.192	€ 57.107	0	(1.468)	(1.468)	0,00
MYI	07.2021	€ 26.788	\$ 31.893	125	0	125	0,00
	07.2021	\$ 4.344.848	€ 3.569.308	0	(112.004)	(112.004)	(0,16)
RBC	07.2021	€ 3.385.074	\$ 2.767.014	0	(103.671)	(103.671)	(0,14)
SCX	07.2021	€ 4.332.333	\$ 3.541.640	0	(132.299)	(132.299)	(0,18)
UAG	07.2021	€ 1.198	\$ 985	0	(30)	(30)	0,00
				\$ 5.144	\$ (657.407)	\$ (652.263)	(0,91)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 4.637	\$ 6.530	\$ 124	\$ 0	\$ 124	0,00
	07.2021	\$ 20.694	£ 14.649	0	(457)	(457)	0,00
BRC	07.2021	£ 159	\$ 225	5	0	5	0,00
	07.2021	\$ 2.594	£ 1.858	0	(28)	(28)	0,00
GLM	07.2021	£ 464.794	\$ 328.772	0	(10.612)	(10.612)	(0,01)
HUS	07.2021	£ 359.046	\$ 496.947	942	0	942	0,00
	07.2021	\$ 9.982	£ 7.046	0	(249)	(249)	0,00
	08.2021	£ 496.987	\$ 359.046	0	(938)	(938)	0,00
MYI	07.2021	£ 9.453	\$ 13.156	97	0	97	0,00
	07.2021	\$ 364	£ 262	0	(2)	(2)	0,00
RYL	07.2021	£ 10.144	\$ 7.197	0	(202)	(202)	0,00
SCX	07.2021	£ 20.227	\$ 14.306	0	(464)	(464)	0,00
SSB	07.2021	£ 361.620	\$ 499.823	264	0	264	0,00
	07.2021	\$ 460.984	£ 325.329	0	(11.559)	(11.559)	(0,02)
	08.2021	£ 496.215	\$ 359.046	0	(166)	(166)	0,00
UAG	07.2021	£ 465.827	\$ 328.772	0	(11.644)	(11.644)	(0,02)
				\$ 1.432	\$ (36.321)	\$ (34.889)	(0,05)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional JPY (Hedged) thesaurierend und Class E JPY (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2021	\$ 2.775	¥ 303.535	\$ 0	\$ (40)	\$ (40)	0,00
HUS	07.2021	\$ 2.029	¥ 221.312	0	(35)	(35)	0,00
MYI	07.2021	\$ 1.632	¥ 178.136	0	(27)	(27)	0,00
SCX	07.2021	\$ 2.674	¥ 292.420	0	(39)	(39)	0,00
SSB	07.2021	\$ 53	¥ 5.779	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 0	\$ (142)	\$ (142)	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	NOK 758.283	\$ 88.446	\$ 327	\$ 0	\$ 327	0,00
	08.2021	\$ 88.459	NOK 758.283	0	(326)	(326)	0,00
CBK	07.2021	\$ 86.158	NOK 719.654	0	(2.528)	(2.528)	0,00
HUS	07.2021	NOK 6.116	\$ 719	8	0	8	0,00
MYI	07.2021	\$ 14.144	NOK 1.706	63	0	63	0,00
	07.2021	\$ 88.489	NOK 737.837	0	(2.746)	(2.746)	(0,01)
RYL	07.2021	\$ 62	NOK 514	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2021	NOK 5.472	\$ 651	16	0	16	0,00
	07.2021	\$ 710	NOK 6.090	0	(2)	(2)	0,00
SSB	07.2021	\$ 84.327	NOK 704.278	0	(2.484)	(2.484)	0,00
				\$ 414	\$ (8.088)	\$ (7.674)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Investor RMB (Hedged) thesaurierend und Class E RMB (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BPS	07.2021	CNH	6.073	\$	999	\$	2	(3)	(1)	0,00
	07.2021	\$	42.851	CNH	273.463		0	(525)	(525)	0,00
	08.2021		51.007		330.601		60	0	60	0,00
GLM	08.2021		46.795		303.310		57	0	57	0,00
HUS	07.2021		45.246		288.482		0	(595)	(595)	0,00
JPM	07.2021		222		1.420		0	(2)	(2)	0,00
MYI	07.2021	CNH	1.907	\$	295		0	0	0	0,00
	07.2021	\$	48.625	CNH	309.970		0	(648)	(648)	0,00
RYL	08.2021		77		500		0	0	0	0,00
SCX	07.2021		1.570		10.032		0	(17)	(17)	0,00
SOG	07.2021		134		856		0	(1)	(1)	0,00
UAG	07.2021	CNH	273.323	\$	42.282		0	(22)	(22)	0,00
	07.2021	\$	4.810	CNH	30.991		0	(14)	(14)	0,00
	08.2021		42.188		273.323		32	0	32	0,00
				\$	151	\$	(1.827)	\$	(1.676)	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) thesaurierend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	07.2021	SGD	1.288.809	\$	959.904	\$	1.112	0	1.112	0,00
	08.2021	\$	959.822	SGD	1.288.809		0	(1.103)	(1.103)	0,00
BPS	07.2021		969.863		1.283.029		0	(15.370)	(15.370)	(0,02)
GLM	07.2021	SGD	7.594	\$	5.700		51	(1)	50	0,00
	07.2021	\$	1.357	SGD	1.824		0	(1)	(1)	0,00
	08.2021		3.562		4.789		0	0	0	0,00
HUS	07.2021		1.010.699		1.337.225		0	(15.888)	(15.888)	(0,02)
JPM	07.2021		105.320		139.613		0	(1.457)	(1.457)	0,00
MYI	07.2021	SGD	1.332.458	\$	991.302		37	0	37	0,00
	08.2021	\$	991.228	SGD	1.332.458		0	(40)	(40)	0,00
SCX	07.2021		996.384		1.320.602		0	(13.939)	(13.939)	(0,02)
SSB	07.2021	SGD	42.002	\$	31.357		150	(39)	111	0,00
	07.2021	\$	49.708	SGD	66.046		1	(575)	(574)	0,00
UAG	07.2021		2.360		3.130		0	(31)	(31)	0,00
				\$	1.351	\$	(48.444)	\$	(47.093)	(0,06)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (281.106) (0,39)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Freddie Mac, TBA			
4,000 % fällig am 01.07.2051	\$	68.550	\$ (73.030) (0,10)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2051 (l)	497.694	(502.554)	(0,70)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (575.584)	(0,80)
Summe Anlagen		\$ 83.991.715	116,85
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (12.109.181)	(16,85)
Nettovermögen		\$ 71.882.534	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Reines Kapitalwertpapier.

(c) Wertpapier per Emissionstermin.

(d) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(e) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(f) Nullkuponwertpapier.

(g) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(h) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(i) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

- (j) Mit dem Fonds verbunden.
 (k) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (l) Zum 30. Juni 2021 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
 (m) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Chester A PLC 0,000 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	\$ 12.487	\$ 16.209	0,02
Chester A PLC 0,849 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	129.550	139.017	0,19
Chester A PLC 1,299 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	19.159	20.326	0,03
Chester A PLC 1,799 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	17.790	18.989	0,03
Chester A PLC 2,299 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	10.947	11.637	0,02
Chester A PLC 3,049 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	5.473	5.747	0,01
Credit Suisse Group Guernsey Ltd. 3,000 % fällig am 12.11.2021	23.04.2021	26.830	29.819	0,04
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	25.05.2021 - 21.06.2021	43.130	43.818	0,06
Export-Import Bank of India 1,166 % fällig am 28.03.2022	19.12.2019	56.343	56.720	0,08
Morgan Stanley 7,500 % fällig am 02.04.2032	11.02.2020	58.799	55.595	0,08
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	37.976	130.358	0,18
Noble Corp.	05.02.2021 - 25.02.2021	35.891	67.265	0,09
Oracle Corp. 3,950 % fällig am 25.03.2051	22.03.2021	19.695	21.560	0,03
Oracle Corp. 4,100 % fällig am 25.03.2061	22.03.2021 - 06.07.2021	17.729	19.334	0,03
Sierra Hamilton Holder LLC	31.07.2017	560	1	0,00
Stearns Holdings LLC 'B'	15.03.2021	1.956	1.605	0,00
Westmoreland Mining Holdings LLC	08.12.2014 - 19.12.2019	1.691	0	0,00
		\$ 496.006	\$ 638.000	0,89

- (n) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 65.740 und Barmittel in Höhe von USD 1.352 als Sicherheiten verpfändet.
 (o) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 238.214 und Barmittel in Höhe von USD 210.723 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2 und Barmittel in Höhe von USD 2.214 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 1.413.566 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 493.680	\$ 77.799.296	\$ 471.951	\$ 78.764.927
Investmentfonds	2.633.546	294.795	0	2.928.341
Pensionsgeschäfte	0	2.219.187	0	2.219.187
Finanzderivate ⁽³⁾	7.705	647.135	4	654.844
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(575.584)	0	(575.584)
Summen	\$ 3.134.931	\$ 80.384.829	\$ 471.955	\$ 83.991.715

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 223.463	\$ 93.348.476	\$ 686.127	\$ 94.258.066
Investmentfonds	2.232.009	295.197	0	2.527.206
Pensionsgeschäfte	0	14.587	0	14.587
Finanzderivate ⁽³⁾	32.344	1.875.740	(70)	1.908.014
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(318.991)	0	(318.991)
Summen	\$ 2.487.816	\$ 95.215.009	\$ 686.057	\$ 98.388.882

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	(2,500) %	14.04.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (1.068)	\$ (1.259)	0,00
	(2,500)	20.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(4.820)	(5.687)	(0,01)
	(1,400)	16.03.2021	TBD ⁽¹⁾	(10.663)	(12.592)	(0,02)
	(1,400)	05.05.2021	TBD ⁽¹⁾	(528)	(625)	0,00
	(1,250)	02.02.2021	TBD ⁽¹⁾	(5.531)	(6.525)	(0,01)

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften		% des Nettovermögens
					€	\$	
	(1,250) %	14.04.2021	TBD ⁽¹⁾	€ (3.462)	\$ (4.094)	(0,01)	
	(1,250)	20.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(858)	(1.015)	0,00	
	(1,250)	21.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.976)	(2.337)	0,00	
	(1,250)	22.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(8.298)	(9.816)	(0,01)	
	(1,250)	05.05.2021	TBD ⁽¹⁾	(883)	(1.046)	0,00	
BRC	(2,500)	28.08.2020	TBD ⁽¹⁾	(6.868)	(7.994)	(0,01)	
	(2,500)	22.10.2020	TBD ⁽¹⁾	(1.575)	(1.835)	0,00	
FBF	(2,500)	10.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(3.182)	(3.768)	(0,01)	
JML	(0,050)	11.06.2021	08.07.2021	\$ (4.372)	(4.372)	(0,01)	
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (62.965)	(0,09)	

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (45.617)	\$ 37.679	\$ (7.938)
BPS	(82.985)	73.150	(9.835)
BRC	(45.609)	37.763	(7.846)
BSS	337	(300)	37
CBK	28.898	(37.400)	(8.502)
DUB	31.460	(36.480)	(5.020)
FAR	(1.550)	1.390	(160)
FBF	8.290	(8.330)	(40)
GLM	(109.498)	93.474	(16.024)
GSC	(376)	170	(206)
GST	24.124	(24.210)	(86)
HUS	(9.105)	9.707	602
IND	(5.283)	5.050	(233)
JPM	(1.217)	540	(677)
JPS	3.547	(3.330)	217
MEI	415	(290)	125
MYC	40.958	(52.257)	(11.299)
MYI	10.822	(28.630)	(17.808)
RBC	(103.717)	91.480	(12.237)
RYL	(1.139)	1.059	(80)
SAL	21.184	(20.980)	204
SCX	(60.819)	49.268	(11.551)
SOG	3.489	(3.770)	(281)
SSB	64.339	(61.816)	2.523
TOR	(27.708)	27.430	(278)
UAG	(24.346)	20.777	(3.569)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	55,20	54,16
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	50,08	72,93
Sonstige übertragbare Wertpapiere	4,29	5,15
Investmentfonds	4,07	3,55
Pensionsgeschäfte	3,09	0,02
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,15)	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,46	1,35
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,39)	1,28
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,80)	(0,45)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,09)	(11,61)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,06)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	3,61	4,01
Unternehmensanleihen und Wechsel	35,71	39,29
Wandelanleihen & Wechsel	0,04	0,04
Kommunanleihen und Wechsel	0,47	0,41
US-Regierungsbehörden	20,91	41,37
US-Schatzobligationen	12,69	12,64
Non-Agency-MBS	12,78	13,84
Forderungsbesicherte Wertpapiere	10,21	11,83
Staatsemissionen	7,23	7,57
Stammaktien	0,85	0,29
Optionsscheine	0,06	0,23
Vorzugswertpapiere	0,32	0,30

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Real Estate Investment Trusts	0,27	0,22
Kurzfristige Instrumente	4,42	0,20
Investmentfonds	4,07	3,55
Pensionsgeschäfte	3,09	0,02
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,15)	0,05
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	(0,05)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,14	0,17
Zinsswaps	1,30	1,22
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	0,06	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Devisenoptionen	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,01)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,01
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	0,05
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,14	0,15
Zinsswaps	0,00	0,00
Total Return Swaps auf Indizes	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,50	0,08
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,10)	0,97
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,80)	(0,45)
Sonstige Aktiva und Passiva	(16,85)	(38,04)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG								FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
United Airlines, Inc. 4,500 % fällig am 21.04.2028	\$	250	1,00	Petroleos Mexicanos 5,950 % fällig am 28.01.2031 6,750 % fällig am 21.09.2047 6,840 % fällig am 23.01.2030 6,950 % fällig am 28.01.2060	\$	30 60 30 60	29 53 31 53	0,11 0,21 0,12 0,21	Trinity Square PLC 2,799 % fällig am 15.07.2059	£	500	693 2,74
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN								BANKEN UND FINANZEN				
AGFC Capital Trust 1,934 % fällig am 15.01.2067		440	289 1,14	T-Mobile USA, Inc. 3,500 % fällig am 15.04.2031		250	259 1,02	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,892 % fällig am 25.11.2034	\$	400	403 1,59	
Bank of Ireland Group PLC 6,000 % fällig am 01.09.2025 (e)(g)	€	200	264 1,04	U.S. Renal Care, Inc. 10,625 % fällig am 15.07.2027		240	253 1,00	Countrywide Asset-Backed Certificates 0,312 % fällig am 25.08.2037 0,312 % fällig am 25.06.2047 ^		270 260	253 250 0,99	
Credit Suisse Group AG 5,250 % fällig am 11.02.2027 (e)(g)	\$	250	265 1,05	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				Long Beach Mortgage Loan Trust 0,252 % fällig am 25.10.2036 0,322 % fällig am 25.12.2036 0,692 % fällig am 25.02.2036		847 727 416	371 375 1,48 1,51	
Deutsche Bank AG 3,547 % fällig am 18.09.2031 4,625 % fällig am 30.10.2027 (e)(g)	€	200 200	213 247 0,84 0,98	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 1,500 % fällig am 17.02.2027	€	250	296 1,17	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 0,602 % fällig am 25.02.2036		427	408 1,61	
Ford Motor Credit Co. LLC 2,386 % fällig am 17.02.2026		100	123 0,49	Pacific Gas & Electric Co. 3,000 % fällig am 15.06.2028 4,450 % fällig am 15.04.2042 ^	\$	300 250	302 248 0,98	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 1,262 % fällig am 25.12.2035		200	199 0,79	
Intesa Sanpaolo SpA 5,875 % fällig am 01.09.2031 (e)(g)		250	338 1,33	Petrobras Global Finance BV 6,850 % fällig am 05.06.2115 7,250 % fällig am 17.03.2044		45 42	51 52 0,20 0,21				2.642 10,43	
Nationwide Building Society 5,750 % fällig am 20.06.2027 (e)(g)	£	200	310 1,22	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			7.627 30,12	
Natwest Group PLC 8,625 % fällig am 15.08.2021 (e)(g)	\$	200	202 0,80	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051 4,000 % fällig am 01.08.2051		1.700 700	1.713 746 6,76 2,95					
Navient Corp. 5,000 % fällig am 15.03.2027		250	259 1,02	US-SCHATZOBIGATIONEN				Summe			2.459 9,71	
Sitka Holdings LLC 4,643 % fällig am 06.07.2026 (a)		250	250 0,99	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,250 % fällig am 15.07.2029 1,000 % fällig am 15.02.2049		417 106	465 143 1,84 0,56					
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL 9,850 % fällig am 16.07.2032	BRL	1.133	236 0,93	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030		300	285 1,13					
UBS Group AG 4,375 % fällig am 10.02.2031 (e)(g)	\$	250	256 1,01				893 3,53					
UniCredit SpA 5,459 % fällig am 30.06.2035		300	328 1,30	NON-AGENCY-MBS				Argentina Government International Bond 0,125 % fällig am 09.07.2030 0,125 % fällig am 09.07.2035 0,125 % fällig am 09.01.2038 0,125 % fällig am 09.07.2041		160 179 63 272	58 57 24 97 0,23 0,23 0,09 0,38	
			3.580 14,14	Adjustable Rate Mortgage Trust 0,332 % fällig am 25.08.2036		775	378 1,49	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,500 % fällig am 01.03.2026	CLP	50.000	72 0,28	
INDUSTRIEWERTE				US-SCHATZOBIGATIONEN				STAATSEMISSIONEN				
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€	300	367 1,45	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,250 % fällig am 15.07.2029 1,000 % fällig am 15.02.2049		417 106	465 143 1,84 0,56	Mexico Government International Bond 10,000 % fällig am 05.12.2024	MXN	10.000	561 2,22	
Boeing Co. 5,705 % fällig am 01.05.2040	\$	190	245 0,97	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030		300	285 1,13	Peru Government International Bond 6,900 % fällig am 12.08.2037	PEN	700	193 0,76	
Bombardier, Inc. 6,000 % fällig am 15.10.2022		245	246 0,97	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030		300	285 1,13	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	5.900	470 1,86	
Charter Communications Operating LLC 3,500 % fällig am 01.06.2041		100	101 0,40	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030		300	285 1,13	Turkey Government International Bond 5,750 % fällig am 11.05.2047	\$	250	214 0,85	
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. 7,750 % fällig am 15.04.2028		240	252 0,99				893 3,53				1.746 6,90	
Community Health Systems, Inc. 6,125 % fällig am 01.04.2030		400	407 1,61	Commercial Mortgage Lease-Backed Certificates 8,125 % fällig am 20.06.2031		400	430 1,70	Summe kurzfristige Instrumente			4.699 18,56	
CSC Holdings LLC 4,500 % fällig am 15.11.2031		200	201 0,79	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust 5,797 % fällig am 15.01.2049		56	55 0,22	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	24.859	98,18	
Expedia Group, Inc. 6,250 % fällig am 01.05.2025		76	88 0,35	GS Mortgage Securities Corp. 2,073 % fällig am 15.11.2032		250	250 0,99	AKTIEN				
Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % fällig am 18.03.2033	€	210	252 1,00	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 3,073 % fällig am 15.06.2035		500	502 1,98	INVESTMENTFONDS				
Intelsat Jackson Holdings S.A. 5,500 % fällig am 01.08.2023 ^	\$	100	57 0,22	Lehman XS Trust 0,452 % fällig am 25.11.2035		432	416 1,64	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
MGM China Holdings Ltd. 4,750 % fällig am 01.02.2027		200	204 0,81	Liberty Street Trust 4,501 % fällig am 10.02.2036		500	547 2,16	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)		240.945	2.400 9,48	

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		0,250 %	16.06.2024	\$ 460	\$ 0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		0,250	16.06.2024	1.830	1	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		0,500	16.06.2026	550	1	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		0,500	16.06.2028	200	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,250	10.05.2031	25	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund II (Forts.)

Zahlung/ Erhalt/ variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250 %	16.06.2051	\$ 450	\$ (1)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 750	1	0,00
					\$ 2	0,01
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 2	0,01

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2021	TRY 212	\$ 25	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2021	\$ 1	PEN 4	0	0	0	0,00
	08.2021	€ 1.658	\$ 2.014	46	0	46	0,18
	08.2021	\$ 26	RUB 1.942	1	0	1	0,00
	09.2021	123	CNY 790	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	252	IDR 3.625.865	0	(3)	(3)	(0,02)
	09.2021	51	RUB 3.731	0	(1)	(1)	0,00
	02.2022	ZAR 1.067	\$ 74	1	0	1	0,01
BPS	07.2021	TRY 7	\$ 1	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 51	TRY 428	0	(2)	(2)	(0,01)
	09.2021	ZAR 33	\$ 2	0	0	0	0,00
	11.2021	MXN 12.598	624	2	0	2	0,01
BRC	07.2021	TRY 209	24	1	0	1	0,00
CBK	07.2021	PEN 213	54	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2021	\$ 26	MXN 505	0	0	0	0,00
	07.2021	141	PEN 549	3	0	3	0,01
	07.2021	23	RUB 1.809	1	0	1	0,01
	08.2021	PEN 88	\$ 24	1	0	1	0,00
	08.2021	\$ 19	PEN 77	1	0	1	0,00
	08.2021	32	RUB 2.401	1	0	1	0,00
	09.2021	PEN 410	\$ 109	1	0	1	0,01
	09.2021	\$ 15	PEN 58	0	0	0	0,00
	09.2021	ZAR 898	\$ 66	3	0	3	0,01
	02.2022	\$ 3	ZAR 47	0	0	0	0,00
	03.2022	PEN 266	\$ 71	2	0	2	0,01
GLM	07.2021	89	22	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	\$ 47	RUB 3.627	3	0	3	0,01
	08.2021	22	PEN 89	1	0	1	0,00
	08.2021	45	RUB 3.354	1	0	1	0,00
	09.2021	65	4.764	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	22	ZAR 309	0	0	0	0,00
	09.2021	ZAR 772	\$ 56	2	0	2	0,01
	11.2021	PEN 52	14	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	\$ 12	PEN 47	0	0	0	0,00
	08.2021	€ 9	\$ 11	0	0	0	0,00
	08.2021	£ 1.169	1.653	38	0	38	0,15
	08.2021	\$ 128	CAD 155	0	(3)	(3)	(0,01)
	08.2021	62	RUB 4.704	2	0	2	0,01
	09.2021	204	CNH 1.309	0	(2)	(2)	(0,01)
	09.2021	584	MXN 12.271	28	0	28	0,11
	09.2021	1	PEN 4	0	0	0	0,00
	09.2021	27	RUB 1.965	0	0	0	0,00
MYI	07.2021	19	1.459	1	0	1	0,00
	08.2021	125	€ 103	0	(3)	(3)	(0,01)
RYL	02.2022	10	ZAR 152	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	PEN 101	\$ 25	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	\$ 2	PEN 8	0	0	0	0,00
	09.2021	25	101	1	0	1	0,01
	12.2021	179	INR 13.407	0	(2)	(2)	(0,01)
UAG	07.2021	72	RUB 5.507	3	0	3	0,01
	09.2021	26	1.941	0	0	0	0,00
				\$ 144	\$ (21)	\$ 123	0,48

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Class E AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2021	AUD 108	\$ 81	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2021	\$ 87	AUD 113	0	(2)	(2)	(0,01)
	08.2021	81	108	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	\$ 62	AUD 79	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	(0,01)
CBK	07.2021	17	22	0	0	0	0,00
MYI	07.2021	AUD 46	\$ 35	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 35	AUD 46	0	0	0	0,00
UAG	07.2021	AUD 73	\$ 55	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 83	AUD 107	0	(4)	(4)	(0,01)
	08.2021	55	73	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1	\$ (9)	\$ (8)	(0,03)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	\$ 74	€ 60	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	(0,01)
BRC	07.2021	82	67	0	(2)	(2)	(0,01)
MYI	07.2021	4	3	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	86	70	0	(3)	(3)	(0,01)
				\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	(0,03)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Class E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
GLM	07.2021	\$ 88	£ 62	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	(0,01)
SCX	07.2021	£ 66	\$ 91	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 88	£ 62	0	(3)	(3)	(0,01)
	08.2021	91	66	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	£ 66	\$ 91	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 91	£ 66	0	0	0	0,00
UAG	07.2021	88	62	0	(2)	(2)	(0,01)
				\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	(0,03)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 111	\$ 83	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,01
	08.2021	\$ 83	SGD 111	0	0	0	0,00
BPS	07.2021	83	110	0	(2)	(2)	(0,01)
HUS	07.2021	83	110	0	(1)	(1)	(0,01)
MYI	07.2021	SGD 111	\$ 83	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 83	SGD 111	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	82	109	0	(1)	(1)	0,00
SSB	07.2021	1	1	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 97 0,38

Summe Anlagen

\$ 27.358 108,05

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (2.039) (8,05)

Nettovermögen

\$ 25.319 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von USD 86 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 24.787	\$ 72	\$ 24.859
Investmentfonds	2.400	0	0	2.400
Finanzderivate ⁽³⁾	0	99	0	99
Summen	\$ 2.400	\$ 24.886	\$ 72	\$ 27.358

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 41	\$ 0	\$ 41
BPS	(6)	0	(6)
BRC	(1)	0	(1)
CBK	12	0	12
GLM	3	0	3
HUS	62	0	62
MYI	(2)	0	(2)
SCX	(9)	0	(9)
UAG	(3)	0	(3)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%) ⁽¹⁾
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	49,30	k. A.
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	44,76	k. A.
Sonstige übertragbare Wertpapiere	4,12	k. A.
Investmentfonds	9,48	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	k. A.
Freiverkehrsfinanzderivate	0,38	k. A.

⁽¹⁾ Der Income Fund II wurde am 29 Januar 2021 aufgelegt.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Inflation Strategy Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS			
Rattler Midstream LP	15.138	\$ 165	0,17	Boston Properties, Inc.	1.341	\$ 154	0,16	Rexford Industrial Realty, Inc.	1.918	10	0,11			
Targa Resources Corp.	10.529	468	0,47	Brixmor Property Group, Inc.	3.562	81	0,08	Sabra Health Care REIT, Inc.	1.386	25	0,03			
TC Energy Corp.	9.115	452	0,46	Camden Property Trust	1.102	146	0,15	SBA Communications Corp.	798	254	0,26			
Williams Cos., Inc.	23.178	615	0,62	CoreSite Realty Corp.	822	111	0,11	Simon Property Group, Inc.	1.535	200	0,20			
		5.139	5,17	Crown Castle International Corp.	133	26	0,03	SITE Centers Corp.	2.914	44	0,04			
				CubeSmart	1.133	52	0,05	Sun Communities, Inc.	1.052	180	0,18			
GESUNDHEITSWESEN				Digital Realty Trust, Inc.	2.670	402	0,40	Sunstone Hotel Investors, Inc.	3.231	40	0,04			
Change Healthcare, Inc. (a)	2.746	63	0,06	Duke Realty Corp.	3.817	181	0,18	Terreno Realty Corp.	971	63	0,06			
Constellation Pharmaceuticals, Inc. (a)	314	11	0,01	Equinix, Inc.	147	118	0,12	UDR, Inc.	3.854	189	0,19			
PPD, Inc. (a)	1.610	74	0,08	Equity LifeStyle Properties, Inc.	1.618	120	0,12	Ventas, Inc.	1.943	111	0,11			
		148	0,15	Equity Residential	2.766	213	0,21	Vornado Realty Trust	2.489	116	0,12			
INDUSTRIEWERTE				Essex Property Trust, Inc.	845	253	0,25	Weingarten Realty Investors	1.118	36	0,04			
Navistar International Corp. (a)	1.501	67	0,07	Extra Space Storage, Inc.	1.004	164	0,16	Welltower, Inc.	3.437	286	0,29			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE				Federal Realty Investment Trust	474	55	0,06			8.160	8,22			
Nuance Communications, Inc. (a)	1.391	76	0,08	First Industrial Realty Trust, Inc.	2.559	134	0,13							
BAUSTOFFE				Gaming and Leisure Properties, Inc.	1.594	74	0,07	PARI						
WR Grace & Co.	1.218	84	0,08	Healthcare Realty Trust, Inc.	2.780	84	0,08	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE						
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				Healthcare Trust of America, Inc. 'A'	2.055	55	0,06	ARGENTINA TREASURY BILLS						
PNM Resources, Inc.	1.296	63	0,06	Healthpeak Properties, Inc.	6.314	210	0,21	38,001 % fällig am						
		5.685	5,72	Host Hotels & Resorts, Inc.	10.472	179	0,18	30.07.2021 (b)(c)	ARS	513	3	0,00		
VORZUGSWERTPAPIERE				Invitation Homes, Inc.	3.721	139	0,14	Summe kurzfristige Instrumente			3	0,00		
Nationwide Building Society 10,250 %	3.685	957	0,96	JBG SMITH Properties	866	27	0,03	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$	96.81	97,47		
REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS				Kilroy Realty Corp.	1.091	76	0,08	AKTIEN						
Agree Realty Corp.	1.750	123	0,12	Kimco Realty Corp.	3.978	83	0,08	INVESTMENTFONDS						
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	588	107	0,11	Life Storage, Inc.	718	77	0,08	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN						
American Campus Communities, Inc.	2.267	106	0,11	MGM Growth Properties LLC 'A'	11.187	410	0,41	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	542.304	5.402	5,44			
American Homes 4 Rent 'A'	4.575	178	0,18	Mid-America Apartment Communities, Inc.	641	108	0,11	BÖRSENGEHANDELTE FONDS						
Americold Realty Trust	2.700	102	0,10	Park Hotels & Resorts, Inc.	1.453	30	0,03	Invesco Physical Gold ETC	17.926	3.062	3,08			
Apartment Income REIT Corp.	539	26	0,03	Pebblebrook Hotel Trust	2.331	55	0,06	Summe Investmentfonds		\$	8.46	8,52		
AvalonBay Communities, Inc.	1.835	383	0,39	Prologis, Inc.	6.540	782	0,79							
				Public Storage	2.013	605	0,61							
				Realty Income Corp.	1.569	105	0,11							
				Regency Centers Corp.	2.338	150	0,15							
				Retail Opportunity Investments Corp.	1.297	23	0,02							

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend², außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2021	8	\$ 2	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	1	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 100,625 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2022 Futures ⁽¹⁾	Short	09.2022	23	4	0,01
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2021	36	3	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2021	15	(19)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	51	42	0,04
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	20	(81)	(0,08)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2021	198	2	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	2	(4)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2021	6	2	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	105	(42)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	64	27	0,03
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	30	(44)	(0,04)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	7	34	0,03
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	27	(240)	(0,24)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2021	37	51	0,05
				\$ (263)	(0,26)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (263)	(0,26)

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festszinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000 %	20.06.2024	\$ 470	\$ 1	0,00
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	400	1	0,00
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	400	2	0,01
				\$ 4	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	15.09.2026	£ 700	\$ 1	0,00	
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	100	(3)	0,00	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,700	02.01.2024	BRL 17.500	(2)	0,00	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,650	02.01.2025	5.600	11	0,01	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,945	02.01.2025	11.200	23	0,02	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,970	02.01.2025	1.600	3	0,00	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,300	02.01.2025	21.500	47	0,05	
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 4.200	(1)	0,00	
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,000	16.06.2031	¥ 50.000	0	0,00	
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	154.390	(3)	0,00	
Erhalt	CPTFEMU	0,500	15.05.2027	€ 300	0	0,00	
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	300	(1)	0,00	
Zahlung	CPURNSA	1,280	19.05.2030	\$ 600	(1)	0,00	
Zahlung	CPURNSA	1,335	01.07.2021	400	0	0,00	
Zahlung	CPURNSA	1,400	08.07.2021	600	0	0,00	
Zahlung	CPURNSA	1,420	09.07.2021	500	0	0,00	
Zahlung	CPURNSA	1,690	07.08.2021	1.500	(13)	(0,01)	
Erhalt	CPURNSA	1,794	24.08.2027	850	2	0,00	
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	300	1	0,00	
Zahlung	CPURNSA	1,825	14.08.2021	900	(8)	(0,01)	
Zahlung	CPURNSA	1,840	14.08.2021	500	(4)	0,00	
Zahlung	CPURNSA	1,863	26.08.2021	600	(5)	(0,01)	
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	500	1	0,00	
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	750	(1)	0,00	
Zahlung	CPURNSA	2,155	19.01.2022	1.200	(8)	(0,01)	
Zahlung	CPURNSA	2,165	16.04.2029	500	(1)	0,00	
Zahlung	CPURNSA	2,170	01.02.2022	100	(1)	0,00	
Zahlung	CPURNSA	2,180	19.01.2022	1.200	(8)	(0,01)	
Zahlung	CPURNSA	2,200	21.01.2022	800	(5)	(0,01)	
Erhalt	CPURNSA	2,220	13.04.2023	1.380	4	0,01	
Erhalt	CPURNSA	2,263	27.04.2023	80	0	0,00	
Erhalt	CPURNSA	2,263	09.05.2023	300	1	0,00	
Erhalt	CPURNSA	2,281	10.05.2023	460	1	0,00	
Erhalt	CPURNSA	2,314	26.02.2026	400	1	0,00	
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	300	0	0,00	
Zahlung	CPURNSA	2,360	09.05.2028	450	(1)	0,00	
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	460	(1)	0,00	
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	300	0	0,00	
Erhalt	CPURNSA	2,419	05.03.2026	700	2	0,00	
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	300	1	0,00	
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	500	1	0,00	
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	300	1	0,00	
Zahlung	FRCPXTOB	1,280	15.11.2034	€ 200	(2)	0,00	
Zahlung	FRCPXTOB	1,590	15.02.2028	180	(1)	0,00	
Zahlung	UKRPI	3,330	15.01.2025	£ 3.400	(16)	(0,02)	
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	800	(2)	0,00	
Zahlung	UKRPI	3,500	15.09.2033	190	0	0,00	
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	500	3	0,00	
Zahlung	UKRPI	3,695	15.12.2028	480	(3)	0,00	
Zahlung	UKRPI	3,850	15.09.2024	400	(2)	0,00	
					\$ 11	0,01	
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 15	0,02

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Inflation Strategy Fund (Forts.)

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,195 %	02.11.2022	200	\$ 0	\$ 29	0,03
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	250	19	37	0,04
BRC	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	150	11	22	0,02
MYC	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,007	24.08.2021	6.000	22	2	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	200	15	30	0,03
							\$ 67	\$ 120	0,12

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	18.08.2021	100	\$ 0	\$ 0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	100	0	0	0,00	
BPS	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	100	0	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	200	(1)	0	0,00	
BRC	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	100	0	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	100	0	0	0,00	
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	200	0	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	200	0	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	500	(1)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	100	0	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	500	(1)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	600	(1)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	100	0	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	100	0	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	400	(1)	(1)	0,00	
CBK	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	100	0	0	0,00	
DUB	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	200	0	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	200	0	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	400	(1)	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	100	0	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	100	0	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	700	(1)	(1)	0,00	
FBF	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	100	0	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	600	(1)	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	200	0	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	200	0	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	200	0	0	0,00	
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	100	0	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	100	0	0	0,00	
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	100	0	0	0,00	
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	100	0	0	0,00	
							\$ (8)	\$ (2)	0,00

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap – OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	300	\$ (13)	\$ 0	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000 %	02.11.2022	600	\$ 0	\$ (27)	(0,03)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	740	(18)	(33)	(0,03)
BRC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	460	(11)	(21)	(0,02)
DUB	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	950	(7)	(1)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	8.400	(13)	(4)	(0,01)
MYC	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,006	24.08.2021	12.000	(19)	(1)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.09.2021	2.050	(14)	(1)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	600	(15)	(27)	(0,03)
							\$ (97)	\$ (115)	(0,12)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	100	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	05.08.2021	100	0	0	0,00
JPM	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,797	05.08.2021	100	0	0	0,00
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	12.08.2021	100	0	0	0,00
SAL	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	100	0	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,609	07.07.2021	100	(1)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,203	07.07.2021	100	0	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,645	07.07.2021	100	0	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,406	05.08.2021	200	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,688	05.08.2021	100	0	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,406	05.08.2021	200	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,328	07.09.2021	100	0	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,211	07.07.2021	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,078	05.08.2021	100	(1)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,609	05.08.2021	100	0	0	0,00
					\$ (6)	\$ (3)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 200	\$ (6)	\$ 8	\$ 2	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	800	(26)	34	8	0,01
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	200	0	2	2	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(12)	16	4	0,00
					\$ (44)	\$ 60	\$ 16	0,01

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Erhalt	CPURNSA	1,800 %	20.07.2026	\$ 600	\$ 0	\$ (43)	\$ (43)	(0,04)
	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	50	0	(4)	(4)	0,00
	Erhalt	CPURNSA	1,810	19.07.2026	500	0	(35)	(35)	(0,04)
						\$ 0	\$ (82)	\$ (82)	(0,08)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Zahlung	BCOMF1TC Index	20.257	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 1.735	15.02.2022	\$ 0	\$ 20	\$ 20	0,02
	Zahlung	BCOMTR Index	2.815	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	562	15.02.2022	0	6	6	0,01
CBK	Zahlung	TRNGLU Index	314	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	1.651	13.10.2021	0	77	77	0,08
	Zahlung	BCOMF1TC Index	5.431	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	531	15.02.2022	0	6	6	0,01
	Zahlung	BCOMTR Index	711	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	142	15.02.2022	0	2	2	0,00
	Zahlung	AMZX Index	745	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	854	20.04.2022	0	40	40	0,04
FBF	Zahlung	DWRTFT Index	19	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	233	25.08.2021	0	(5)	(5)	(0,01)
GST	Zahlung	BCOMF1TC Index	2.547	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	808	15.02.2022	0	9	9	0,01
JPM	Zahlung	BCOMF1TC Index	28.657	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	4.755	15.02.2022	0	55	55	0,06
	Zahlung	BCOMTR Index	6.122	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	1.223	15.02.2022	0	13	13	0,01
MAC	Zahlung	JMABDEWU Index	16.708	0,053	2.648	15.02.2022	0	(3)	(3)	0,00
	Zahlung	BCOMTR Index	480	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	96	15.02.2022	0	1	1	0,00
SOG	Erhalt	DWRTFT Index	517	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	6.655	08.06.2022	0	173	173	0,17
UAG	Zahlung	TRNGLU Index	1.150	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	6.548	01.06.2022	0	(225)	(225)	(0,23)
							\$ 0	\$ 169	\$ 169	0,17

Aufstellung der Wertpapieranlagen Inflation Strategy Fund (Forts.)

TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Zahlung	Enterprise Products Partners LP	6.110	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 154	15.09.2021	\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	(0,01)	
	Zahlung	Genesis Energy LP	42.422	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	506	15.11.2021	0	(14)	(14)	(0,01)	
	Zahlung	MPLX LP	40.379	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.257	15.11.2021	0	(62)	(62)	(0,06)	
	Zahlung	Plains All American Pipeline LP	47.814	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	580	15.11.2021	0	(37)	(37)	(0,04)	
	Zahlung	Energy Transfer LP	110.799	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.097	18.01.2022	0	81	81	0,08	
	Zahlung	Western Midstream Partners LP	15.823	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	316	18.01.2022	0	23	23	0,02	
	Zahlung	Cheniere Energy Partners LP	1.264	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	52	10.03.2022	0	4	4	0,00	
	Zahlung	Energy Transfer LP	8.421	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	83	13.04.2022	0	6	6	0,01	
	Zahlung	Holly Energy Partners LP	10.694	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	234	13.04.2022	0	8	8	0,01	
	Zahlung	Equitrans Midstream Corp.	36.988	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	305	16.05.2022	0	10	10	0,01	
	Zahlung	Holly Energy Partners LP	7.670	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	163	16.05.2022	0	10	10	0,01	
	CBK	Zahlung	Equitrans Midstream Corp.	2.880	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	26	15.11.2021	0	(2)	(2)	0,00
		Zahlung	DCP Midstream LP	25.059	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	782	15.02.2022	0	(13)	(13)	(0,01)
	FAR	Zahlung	Cheniere Energy Partners LP	5.437	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	224	16.05.2022	0	16	16	0,02
		Zahlung	MPLX LP	148	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5	15.09.2021	0	0	0	0,00
MYI	Zahlung	Enterprise Products Partners LP	6.463	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	163	15.10.2021	0	(7)	(7)	(0,01)	
	Zahlung	Western Midstream Partners LP	34.753	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	791	15.09.2021	0	(46)	(46)	(0,05)	
	Zahlung	Cheniere Energy Partners LP	1.278	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	57	15.10.2021	0	0	0	0,00	
	Zahlung	Crestwood Equity Partners LP	14.288	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	467	15.11.2021	0	(39)	(39)	(0,04)	
	Zahlung	NuStar Energy LP	25.420	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	501	15.11.2021	0	(42)	(42)	(0,04)	
	Zahlung	Phillips 66 Partners LP	12.237	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	499	15.11.2021	0	(16)	(16)	(0,02)	
	Zahlung	Sunoco LP	9.398	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	357	15.11.2021	0	(2)	(2)	0,00	
	Zahlung	Plains All American Pipeline LP	17.358	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	183	18.01.2022	0	14	14	0,02	
	Zahlung	Crestwood Equity Partners LP	5.766	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	189	15.02.2022	0	(16)	(16)	(0,02)	
Zahlung	Enterprise Products Partners LP	25.105	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	593	13.04.2022	0	13	13	0,01		
								\$ 0	\$ (118)	\$ (118)	(0,12)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	CAD	1.892	\$ 1.565	\$ 37	\$ 0	0,04	
	07.2021	DKK	6.134	976	0	(2)	0,00	
	07.2021	¥	63.600	575	2	0	0,00	
	07.2021	\$	47	SEK 390	0	(1)	0,00	
	08.2021		11	RUB 834	0	0	0,00	
	09.2021		67	CNY 429	0	(1)	0,00	
	09.2021		7	PLN 25	0	0	0,00	
	09.2021		15	RUB 1.103	0	0	0,00	
	11.2021		776	CLP 560.527	0	(10)	(0,01)	
	07.2021	AUD	1.869	\$ 1.453	49	0	49	0,05
	07.2021	DKK	4.495	729	12	0	12	0,01
BPS	07.2021	\$	87	DKK 535	0	(2)	0,00	
	07.2021		128	£ 92	0	(1)	0,00	
	07.2021		145	TRY 1.252	0	(2)	0,00	
	08.2021		74	MXN 1.587	5	0	5	0,01
	09.2021		82	THB 2.550	0	(2)	(2)	0,00
	11.2021		281	MXN 5.675	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021		52	BRL 276	3	0	3	0,00
BRC	07.2021		462	MXN 9.410	9	0	9	0,01
	07.2021		15	TRY 123	0	0	0	0,00
	09.2021		4	PLN 17	0	0	0	0,00
CBK	07.2021	AUD	587	\$ 454	13	0	13	0,01
	07.2021	DKK	4.756	754	0	(4)	(4)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
GLM	07.2021	PEN	783 \$	215	\$ 11	\$ 11	0,01	
	07.2021	\$	87 DKK	550	0	0	0,00	
	07.2021		7 RUB	537	0	0	0,00	
	08.2021		10	760	0	0	0,00	
	09.2021	ZAR	298 \$	22	1	1	0,00	
	07.2021	DKK	7.025	1.144	24	0	24	0,02
	07.2021	£	6.929	9.796	224	0	224	0,22
	07.2021	MXN	9.410	458	0	(13)	(13)	(0,01)
	07.2021	\$	187 CAD	226	0	(5)	(5)	(0,01)
	07.2021		14 RUB	1.078	1	0	1	0,00
	07.2021		21 TRY	176	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021		490 COP	1.824.257	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021		456 MXN	9.410	13	0	13	0,01
	08.2021		36 RUB	2.718	1	0	1	0,00
	09.2021		76 HKD	590	0	0	0	0,00
	09.2021		7 PLN	27	0	0	0	0,00
	09.2021		19 RUB	1.409	0	0	0	0,00
HUS	09.2021	ZAR	181 \$	13	1	1	0,00	
	07.2021	£	128	181	4	4	0,00	
	07.2021	\$	57 €	47	0	(2)	(2)	0,00
	07.2021		9.648 £	6.965	0	(26)	(26)	(0,03)
	07.2021		985 ILS	3.198	0	(3)	(3)	0,00
	07.2021		222 SEK	1.830	0	(8)	(8)	(0,01)
	08.2021	£	6.733 \$	9.320	18	0	18	0,02
	08.2021	\$	23 RUB	1.715	1	0	1	0,00
	09.2021		212 CNH	1.363	0	(2)	(2)	0,00
	09.2021		116 KRW	129.142	0	(2)	(2)	0,00
	09.2021		8 PLN	30	0	0	0	0,00
	09.2021		8 RUB	581	0	0	0	0,00
	07.2021	DKK	5.303 \$	841	0	(5)	(5)	0,00
	07.2021	\$	429 BRL	2.247	19	0	19	0,02
	07.2021		1.942 DKK	12.101	0	(13)	(13)	(0,01)
	07.2021		711 TRY	6.272	1	0	1	0,00
	09.2021		210 IDR	3.024.857	0	(4)	(4)	0,00
10.2021	DKK	12.101 \$	1.946	13	0	13	0,01	
MYI	07.2021	BRL	24.369	4.834	0	(22)	(22)	(0,02)
	07.2021	€	146	173	1	0	1	0,00
	07.2021	¥	467.682	4.259	45	0	45	0,04
	07.2021	PEN	159	44	2	0	2	0,00
	07.2021	\$	2.304 DKK	14.345	0	(16)	(16)	(0,02)
	07.2021		207 NOK	1.715	0	(8)	(8)	(0,01)
	07.2021		7 RUB	529	0	0	0	0,00
	08.2021		4.819 BRL	24.369	22	0	22	0,02
	10.2021	DKK	14.345 \$	2.308	16	0	16	0,02
	07.2021		17.030	2.752	36	0	36	0,04
	07.2021	€	15.357	18.787	575	0	575	0,58
	07.2021	\$	242 MXN	4.848	1	0	1	0,00
	07.2021		40 PEN	159	2	0	2	0,00
	09.2021	PEN	159 \$	40	0	(2)	(2)	0,00
	07.2021	\$	2.742 DKK	17.073	0	(19)	(19)	(0,02)
	07.2021		8 RUB	613	0	0	0	0,00
	08.2021		13	953	0	0	0	0,00
10.2021	DKK	17.073 \$	2.747	19	0	19	0,02	
SSB UAG	07.2021	\$	4.057 BRL	21.488	226	0	226	0,23
	07.2021		1.255 AUD	1.654	0	(13)	(13)	(0,01)
	07.2021		70 BRL	358	2	0	2	0,00
	07.2021		34 RUB	2.566	1	0	1	0,00
	08.2021	AUD	1.654 \$	1.255	13	0	13	0,01
	09.2021	\$	8 RUB	574	0	0	0	0,00
					\$ 1.423	\$ (192)	\$ 1.231	1,24

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	€	518 \$	618	\$ 4	\$ 4	0,01	
	07.2021	\$	200 €	164	0	(5)	(0,01)	
BPS	07.2021		919	759	0	(19)	(0,02)	
BRC	07.2021		24	20	0	(1)	0,00	
GLM	07.2021		246	203	0	(5)	(0,01)	
HUS	07.2021		901	744	0	(19)	(0,02)	
MYI	07.2021		69	58	0	0	0,00	
SCX	07.2021		5.310	4.341	0	(162)	(0,16)	
TOR	07.2021		5.281	4.317	0	(163)	(0,16)	
UAG	07.2021		78	64	0	(2)	0,00	
					\$ 4	\$ (376)	\$ (372)	(0,37)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Inflation Strategy Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	\$ 42	£ 30	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
GLM	07.2021	£ 1.042	£ 737	0	(24)	(24)	(0,02)
HUS	07.2021	£ 788	\$ 1.091	2	0	2	0,00
	08.2021	\$ 1.091	£ 788	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2021	£ 221	£ 156	0	(6)	(6)	(0,01)
SSB	07.2021	£ 788	\$ 1.089	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 1.089	£ 788	0	0	0	0,00
UAG	07.2021	£ 1.044	£ 737	0	(26)	(26)	(0,03)
				\$ 2	\$ (59)	\$ (57)	(0,06)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 787	0,79
Summe Anlagen						\$ 105.821	106,54
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (6.495)	(6,54)
Nettovermögen						\$ 99.326	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 4.253 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 1.301 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 13.845	\$ 82.973	\$ 0	\$ 96.818
Investmentfonds	8.464	0	0	8.464
Finanzderivate ⁽³⁾	(1)	540	0	539
Summen	\$ 22.308	\$ 83.513	\$ 0	\$ 105.821

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 10.139	\$ 84.042	\$ 0	\$ 94.181
Investmentfonds	2.602	3.295	0	5.897
Pensionsgeschäfte	0	571	0	571
Finanzderivate ⁽³⁾	7	1.615	0	1.622
Summen	\$ 12.748	\$ 89.523	\$ 0	\$ 102.271

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
GRE	0,040 %	19.05.2021	19.07.2021	\$ (368)	\$ (368)	(0,37)
	0,060	06.05.2021	07.07.2021	(3.843)	(3.844)	(3,87)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (4.212)	(4,24)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 46	\$ 0	\$ 46
BPS	70	0	70
BRC	11	0	11
CBK	147	(260)	(113)
DUB	(2)	0	(2)
FAR	(7)	0	(7)
FBF	(5)	0	(5)
GLM	210	0	210
GST	11	0	11
HUS	(39)	0	(39)
JPM	76	0	76
MAC	1	0	1
MYC	(71)	0	(71)
MYI	(94)	0	(94)
SAL	(1)	0	(1)
SCX	444	(330)	114
SOG	173	0	173
SSB	226	(260)	(34)
TOR	(163)	0	(163)
UAG	(246)	0	(246)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	78,74	87,81
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	16,41	43,93
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,32	2,73
Investmentfonds	8,52	8,42
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,82
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,26)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,02	2,71
Freiverkehrsfinanzderivate	0,79	(0,40)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(4,24)	(21,93)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	7,37	6,22
US-Regierungsbehörden	4,55	24,57
US-Schatzobligationen	26,14	33,43
Non-Agency-MBS	2,54	4,03
Forderungsbesicherte Wertpapiere	3,55	5,75
Staatsemissionen	38,42	44,72
Stammaktien	5,72	4,36
Vorzugswertpapiere	0,96	1,27
Real Estate Investment Trusts	8,22	10,12
Kurzfristige Instrumente	0,00	k. A.
Investmentfonds	8,52	8,42
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,82
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,26)	(0,01)
Futures		
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,14
Zinsswaps	0,01	2,57
Freiverkehrsfinanzderivate		
Käufe		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	0,12	0,10
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Inflation-Capped Options	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,12)	(0,08)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,03
Zinsswaps	(0,08)	(0,04)
Total Return Swaps auf Indizes	0,17	0,75
Total Return Swaps auf Wertpapiere	(0,12)	(0,72)
Devisenterminkontrakte	1,24	(0,69)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,43)	0,27
Sonstige Aktiva und Passiva	(6,54)	(46,03)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Average Duration Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				BANKEN UND FINANZEN			
American Tower Corp.				NatWest Group PLC				Danone S.A.			
3,000 % fällig am 15.06.2023	\$ 3.560	\$ 3.732	0,33	1,626 % fällig am 15.05.2023	\$ 3.500	\$ 3.537	0,32	2,947 % fällig am 02.11.2026	\$ 2.400	\$ 2.574	0,23
Aviation Capital Group LLC				NatWest Markets PLC				Dell International LLC			
0,856 % fällig am 30.07.2021	2.100	2.100	0,19	0,362 % fällig am 27.09.2021	€ 2.300	2.733	0,25	5,450 % fällig am 15.06.2023	900	977	0,09
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				Nissan Motor Acceptance Corp.				Equifax, Inc.			
0,875 % fällig am 18.09.2023	2.400	2.409	0,22	0,765 % fällig am 21.09.2021	\$ 2.600	2.601	0,23	1,026 % fällig am 15.08.2021	4.700	4.704	0,42
Bank of America Corp.				1,050 % fällig am 08.03.2024	1.800	1.790	0,16	Expedia Group, Inc.			
0,810 % fällig am 24.10.2024	2.900	2.913	0,26	2,650 % fällig am 13.07.2022	500	508	0,05	3,600 % fällig am 15.12.2023	2.100	2.234	0,20
1,486 % fällig am 19.05.2024	2.400	2.442	0,22	2,800 % fällig am 13.01.2022	2.300	2.326	0,21	Fidelity National Information Services, Inc.			
Barclays PLC				NTT Finance Corp.				0,375 % fällig am 01.03.2023	3.000	2.997	0,27
1,586 % fällig am 15.02.2023	3.500	3.526	0,32	0,373 % fällig am 03.03.2023	3.000	3.002	0,27	GATX Corp.			
4,610 % fällig am 15.02.2023	4.500	4.616	0,41	Santander Holdings USA, Inc.				0,896 % fällig am 05.11.2021	3.700	3.707	0,33
Brixmor Operating Partnership LP				3,400 % fällig am 18.01.2023	2.300	2.395	0,21	General Mills, Inc.			
1,226 % fällig am 01.02.2022	3.500	3.514	0,32	3,450 % fällig am 02.06.2025	2.700	2.903	0,26	6,410 % fällig am 15.10.2022	3.000	3.215	0,29
Citigroup, Inc.				Standard Chartered PLC				Hasbro, Inc.			
0,776 % fällig am 30.10.2024	2.300	2.307	0,21	1,319 % fällig am 14.10.2023	3.500	3.535	0,32	3,550 % fällig am 19.11.2026	2.800	3.071	0,28
0,871 % fällig am 27.10.2022	5.400	5.439	0,49	1,338 % fällig am 20.01.2023	3.200	3.217	0,29	Hewlett Packard Enterprise Co.			
Cooperatieve Rabobank UA				Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				0,914 % fällig am 05.10.2021	3.000	3.001	0,27
1,004 % fällig am 24.09.2026	3.700	3.656	0,33	1,474 % fällig am 08.07.2025	3.200	3.234	0,29	Hyatt Hotels Corp.			
Credit Agricole S.A.				Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				3,135 % fällig am 01.09.2022	2.000	2.008	0,18
1,196 % fällig am 24.04.2023	4.450	4.510	0,40	0,800 % fällig am 12.09.2023	3.100	3.120	0,28	Hyundai Capital America			
Credit Suisse Group AG				U.S. Bancorp				0,800 % fällig am 03.04.2023	3.100	3.101	0,28
4,550 % fällig am 17.04.2026	2.400	2.720	0,24	1,450 % fällig am 12.05.2025	2.700	2.763	0,25	1,150 % fällig am 10.11.2022	3.500	3.525	0,32
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.				UBS Group AG				Nissan Motor Co. Ltd.			
3,800 % fällig am 15.09.2022	500	520	0,05	1,106 % fällig am 15.08.2023	3.000	3.027	0,27	3,043 % fällig am 15.09.2023	3.600	3.756	0,34
Danske Bank A/S				2,859 % fällig am 15.08.2023	2.900	2.977	0,27	NXP BV			
5,000 % fällig am 12.01.2022	3.000	3.070	0,28	3,491 % fällig am 23.05.2023	2.900	2.979	0,27	4,875 % fällig am 01.03.2024	2.700	2.974	0,27
Deutsche Bank AG				4,125 % fällig am 24.09.2025	2.400	2.679	0,24	Panasonic Corp.			
1,000 % fällig am 19.11.2025	€ 3.000	3.634	0,33	UniCredit SpA				2,536 % fällig am 19.07.2022	2.500	2.550	0,23
3,300 % fällig am 16.11.2022	\$ 4.100	4.249	0,38	4,086 % fällig am 14.01.2022	3.200	3.258	0,29	Penske Truck Leasing Co. LP			
4,250 % fällig am 14.10.2021	2.900	2.932	0,26	7,830 % fällig am 04.12.2023	6.350	7.361	0,66	1,700 % fällig am 15.06.2026	3.300	3.325	0,30
Equinix, Inc.				Volkswagen Bank GmbH				Siemens Financieringsmaatschappij NV			
2,625 % fällig am 18.11.2024	3.400	3.579	0,32	0,934 % fällig am 01.08.2022	€ 2.600	3.124	0,28	3,125 % fällig am 16.03.2024	700	747	0,07
Equitable Holdings, Inc.				Volkswagen Financial Services NV				SK Hynix, Inc.			
3,900 % fällig am 20.04.2023	52	55	0,00	1,125 % fällig am 18.09.2023	€ 2.400	3.344	0,30	1,000 % fällig am 19.01.2024	2.900	2.885	0,26
Federal Realty Investment Trust				1,625 % fällig am 30.11.2022	5.800	8.122	0,72	Southern Co.			
3,950 % fällig am 15.01.2024	2.400	2.575	0,23	Wells Fargo & Co.				0,600 % fällig am 26.02.2024	3.000	2.993	0,27
Ford Credit Canada Co.				1,654 % fällig am 02.06.2024	\$ 2.500	2.554	0,23	Suntory Holdings Ltd.			
3,465 % fällig am 10.01.2022 (g)	CAD 1.800	1.462	0,13	2,125 % fällig am 20.12.2023	€ 900	1.284	0,12	2,550 % fällig am 28.06.2022	4.090	4.170	0,37
Ford Motor Credit Co. LLC						212.067	19,04	Sutter Health			
1,391 % fällig am 15.02.2023	\$ 2.800	2.790	0,25	INDUSTRIEWERTE				1,321 % fällig am 15.08.2025	2.900	2.921	0,26
3,096 % fällig am 04.05.2023	2.900	2.962	0,27	7-Eleven, Inc.				Sysco Corp.			
3,550 % fällig am 07.10.2022	3.000	3.084	0,28	0,612 % fällig am 10.08.2022	\$ 2.900	2.901	0,26	5,650 % fällig am 01.04.2025	2.700	3.130	0,28
3,810 % fällig am 09.01.2024	1.000	1.048	0,09	0,625 % fällig am 10.02.2023	2.900	2.902	0,26	Toyota Motor Corp.			
5,596 % fällig am 07.01.2022	2.900	2.963	0,27	0,800 % fällig am 10.02.2024	2.900	2.894	0,26	0,681 % fällig am 25.03.2024	3.700	3.708	0,33
General Motors Financial Co., Inc.				Anthem, Inc.				VMware, Inc.			
1,235 % fällig am 17.11.2023	2.900	2.949	0,26	0,450 % fällig am 15.03.2023	3.700	3.705	0,33	2,950 % fällig am 21.08.2022	3.500	3.591	0,32
3,550 % fällig am 08.07.2022	2.800	2.890	0,26	2,375 % fällig am 15.01.2025	2.700	2.829	0,25	Volkswagen Group of America Finance LLC			
5,200 % fällig am 20.03.2023	2.400	2.585	0,23	3,350 % fällig am 01.12.2024	1.000	1.080	0,10	3,125 % fällig am 12.05.2023	1.500	1.567	0,14
Goldman Sachs Group, Inc.				AstraZeneca PLC				Walt Disney Co.			
0,900 % fällig am 23.02.2023	1.000	1.009	0,09	3,500 % fällig am 17.08.2023	2.200	2.338	0,21	1,750 % fällig am 13.01.2026	2.000	2.058	0,19
JPMorgan Chase & Co.				BMW Finance NV				WRKCo, Inc.			
0,563 % fällig am 16.02.2025	2.000	1.990	0,18	2,250 % fällig am 12.08.2022	3.400	3.474	0,31	3,750 % fällig am 15.03.2025	2.700	2.948	0,26
0,697 % fällig am 16.03.2024	3.000	3.010	0,27	BMW U.S. Capital LLC							
1,514 % fällig am 01.06.2024	2.800	2.856	0,26	3,450 % fällig am 12.04.2023	2.400	2.522	0,23				
Lloyds Banking Group PLC				Boeing Co.				VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
2,858 % fällig am 17.03.2023	3.300	3.357	0,30	1,167 % fällig am 04.02.2023	3.500	3.515	0,32	AES Corp.			
Logicor Financing SARL				1,950 % fällig am 01.02.2024	2.500	3.586	0,32	1,375 % fällig am 15.01.2026	3.200	3.170	0,28
1,500 % fällig am 14.11.2022	€ 4.800	5.797	0,52	Broadcom, Inc.				Atmos Energy Corp.			
Marsh & McLennan Cos., Inc.				3,459 % fällig am 15.09.2026	504	549	0,05	0,503 % fällig am 09.03.2023	3.600	3.601	0,32
3,500 % fällig am 03.06.2024	\$ 3.100	3.334	0,30	3,469 % fällig am 15.04.2034	2.400	2.541	0,23	BG Energy Capital PLC			
Metropolitan Life Global Funding				CenterPoint Energy Resources Corp.				4,000 % fällig am 15.10.2021	1.250	1.263	0,11
0,950 % fällig am 02.07.2025	3.700	3.698	0,33	0,631 % fällig am 02.03.2023	3.000	3.001	0,27	Eversource Energy			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				Central Nippon Expressway Co. Ltd.				0,800 % fällig am 15.08.2025	3.000	2.969	0,27
0,871 % fällig am 02.03.2023	8.400	8.476	0,76	0,616 % fällig am 15.02.2022	7.000	7.015	0,63	Exelon Generation Co. LLC			
Mizuho Financial Group, Inc.				Chanel Ceres PLC				3,250 % fällig am 01.06.2025	2.600	2.806	0,25
0,849 % fällig am 08.09.2024	3.600	3.619	0,32	0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 4.700	5.624	0,51	Midwest Connector Capital Co. LLC			
0,921 % fällig am 05.03.2023	500	505	0,05	Charter Communications Operating LLC				3,625 % fällig am 01.04.2022	1.600	1.627	0,15
1,178 % fällig am 10.07.2024	3.100	3.145	0,28	4,464 % fällig am 23.07.2022	\$ 4.300	4.452	0,40	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.			
1,444 % fällig am 19.07.2023	AUD 4.800	3.667	0,33	CommonSpirit Health				0,420 % fällig am 22.02.2023	2.900	2.900	0,26
Morgan Stanley				1,547 % fällig am 01.10.2025	2.900	2.926	0,26	2,800 % fällig am 15.01.2023	2.800	2.895	0,26
0,864 % fällig am 21.10.2025	\$ 2.000	2.000	0,18	CRH America, Inc.				Pacific Gas & Electric Co.			
				3,875 % fällig am 18.05.2025	2.700	2.960	0,27	1,367 % fällig am 10.03.2023	3.000	3.000	0,27
				Daimler Finance North America LLC				1,598 % fällig am 16.06.2022	2.200	2.201	0,20
				0,750 % fällig am 01.03.2024	3.600	3.609	0,32	3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	500	525	0,05
				2,550 % fällig am 15.08.2022	3.500	3.583	0,32				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
3,850 % fällig am 15.11.2023 ^	\$ 1.000	\$ 1.049	0,09	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				Wells Fargo Commercial Mortgage Trust			
4,250 % fällig am 01.08.2023	3.100	3.287	0,29	2,302 % fällig am 25.01.2034	\$ 11	\$ 11	0,00	1,890 % fällig am 15.10.2045	\$ 2.432	\$ 38	0,00
SSE PLC				3,128 % fällig am 25.07.2034	157	152	0,01	(a)			
1,250 % fällig am 16.04.2025	€ 2.400	2.977	0,27	4,341 % fällig am 25.01.2035	11	12	0,00			87.283	7,84
Verizon Communications, Inc.				Bear Stearns ALT-A Trust				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
0,550 % fällig am 22.03.2024	\$ 3.600	3.629	0,33	0,412 % fällig am 25.02.2034	70	68	0,01	Adams Mill CLO Ltd.			
		37.899	3,40	2,596 % fällig am 25.12.2033	41	43	0,00	1,284 % fällig am 15.07.2026	1.466	1.466	0,13
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		396.409	35,60	Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.	1	1	0,00	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
				2,530 % fällig am 25.10.2035	21	21	0,00	1,112 % fällig am 25.10.2034	2.514	2.514	0,23
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				Countrywide Alternative Loan Trust				BlueMountain CLO Ltd.			
Fannie Mae				6,000 % fällig am 25.10.2033	12	13	0,00	1,120 % fällig am 18.07.2027	2.727	2.729	0,24
0,000 % fällig am 25.04.2040				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				BlueMountain Fuji EUR CLO DAC			
(b)(d)	232	207	0,02	2,665 % fällig am 20.02.2035	20	20	0,00	0,720 % fällig am 15.01.2031	€ 2.400	2.843	0,26
0,152 % fällig am 25.07.2037	25	24	0,00	2,800 % fällig am 25.11.2034	42	42	0,00	Cairn CLO BV			
0,442 % fällig am 25.12.2036 - 25.03.2044	2.281	2.308	0,21	Eurosail PLC				0,650 % fällig am 20.10.2028	2.452	2.915	0,26
0,502 % fällig am 25.09.2035	185	187	0,02	1,034 % fällig am 13.06.2045	€ 5.577	7.757	0,70	Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC			
1,000 % fällig am 25.01.2043	76	74	0,01	FirstMac Mortgage Funding Trust				0,680 % fällig am 16.09.2025	€ 1.117	1.547	0,14
Freddie Mac				1,060 % fällig am 08.03.2049	AUD 1.676	1.267	0,11	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC			
0,000 % fällig am 15.05.2037				1,310 % fällig am 08.03.2049	8.000	6.064	0,55	0,700 % fällig am 15.01.2031	€ 2.200	2.609	0,23
(b)(d)	121	117	0,01	Great Hall Mortgages PLC				0,750 % fällig am 15.11.2031	2.600	3.070	0,28
0,393 % fällig am 15.02.2037	27	27	0,00	0,255 % fällig am 18.06.2039	\$ 947	934	0,08	Catamaran CLO Ltd.			
0,523 % fällig am 15.09.2041	6	6	0,00	GSR Mortgage Loan Trust				1,444 % fällig am 22.04.2030	\$ 3.482	3.484	0,31
0,650 % fällig am 22.10.2025	23.500	23.384	2,10	2,924 % fällig am 25.09.2035	125	127	0,01	Chesapeake Funding LLC			
0,680 % fällig am 06.08.2025	11.300	11.253	1,01	6,000 % fällig am 25.03.2032	0	0	0,00	3,230 % fällig am 15.08.2030	857	864	0,08
0,800 % fällig am 28.10.2026	7.000	6.964	0,63	Hawksmoor Mortgages PLC				CIFC Funding Ltd.			
1,328 % fällig am 25.02.2045	89	90	0,01	1,099 % fällig am 25.05.2053	€ 10.140	14.080	1,27	1,036 % fällig am 25.10.2027	1.518	1.520	0,14
2,000 % fällig am 15.11.2026	3.275	3.338	0,30	IndyMac Mortgage Loan Trust				Countrywide Asset-Backed Certificates			
2,125 % fällig am 01.12.2034	5	5	0,00	0,572 % fällig am 25.04.2035	\$ 365	347	0,03	1,142 % fällig am 25.11.2034	996	1.001	0,09
2,275 % fällig am 01.01.2035	7	8	0,00	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
2,288 % fällig am 01.07.2035	15	15	0,00	1,890 % fällig am 15.10.2045				0,712 % fällig am 25.01.2032	12	12	0,00
2,309 % fällig am 01.01.2035	4	4	0,00	(a)	10.322	135	0,01	Fremont Home Loan Trust			
2,364 % fällig am 01.09.2035	130	138	0,01	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				0,797 % fällig am 25.04.2035	124	124	0,01
6,000 % fällig am 01.05.2022	0	0	0,00	2,515 % fällig am 25.10.2034	623	637	0,06	Gallatin CLO Ltd.			
6,500 % fällig am 25.07.2043	96	118	0,01	MortgageIT Trust				1,236 % fällig am 21.01.2028	3.000	3.000	0,27
Ginnie Mae				0,732 % fällig am 25.02.2035	115	115	0,01	Griffith Park CLO DAC			
0,570 % fällig am 20.06.2065	2.073	2.082	0,19	Mulcair Securities DAC				0,720 % fällig am 21.11.2031	€ 3.000	3.544	0,32
0,807 % fällig am 20.10.2065	27	27	0,00	0,461 % fällig am 24.04.2071	€ 3.014	3.587	0,32	Harvest CLO DAC			
0,907 % fällig am 20.05.2066	1.706	1.736	0,16	Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				0,650 % fällig am 26.06.2030	3.000	3.554	0,32
1,007 % fällig am 20.04.2066	2.657	2.714	0,24	0,652 % fällig am 25.12.2035	\$ 386	385	0,04	Jubilee CLO BV			
1,157 % fällig am 20.02.2062	31	32	0,00	Pepper Residential Securities Trust				0,610 % fällig am 15.04.2030	4.000	4.742	0,43
1,343 % fällig am 20.08.2070	3.711	3.944	0,35	1,210 % fällig am 16.09.2019	AUD 2.213	1.673	0,15	Madison Park Euro Funding DAC			
1,438 % fällig am 20.07.2067	7.770	7.913	0,71	Prime Mortgage Trust				0,750 % fällig am 15.01.2032	2.700	3.206	0,29
2,875 % fällig am 20.06.2027	17	17	0,00	0,492 % fällig am 25.02.2034	\$ 3	3	0,00	Mountain View CLO Ltd.			
Uniform Mortgage-Backed Security				Primrose Residential				0,984 % fällig am 15.10.2026	\$ 113	113	0,01
1,328 % fällig am 01.07.2042 - 01.06.2043	60	62	0,01	0,200 % fällig am 24.03.2061	€ 3.578	4.242	0,38	1,274 % fällig am 16.10.2029	1.900	1.900	0,17
1,377 % fällig am 01.09.2041	69	71	0,01	Residential Mortgage Securities PLC				OCF CLO Ltd.			
1,776 % fällig am 01.01.2035	8	9	0,00	0,881 % fällig am 20.03.2050	€ 1.902	2.633	0,24	0,984 % fällig am 15.07.2027	249	249	0,02
1,837 % fällig am 01.01.2035	4	4	0,00	Ripon Mortgages PLC				Palmer Square CLO Ltd.			
1,977 % fällig am 01.01.2035	20	20	0,00	0,881 % fällig am 20.08.2056	2.379	3.294	0,30	1,006 % fällig am 15.08.2026	749	750	0,07
1,996 % fällig am 01.12.2034	25	27	0,00	Sequoia Mortgage Trust				SLC Student Loan Trust			
2,019 % fällig am 01.12.2034	4	4	0,00	0,513 % fällig am 20.06.2036	\$ 332	320	0,03	0,229 % fällig am 15.03.2027	852	851	0,08
2,203 % fällig am 01.07.2035	2	2	0,00	0,893 % fällig am 20.10.2027	3	3	0,00	SLM Student Loan Trust			
2,259 % fällig am 01.05.2038	893	945	0,09	Stratton Mortgage Funding PLC				0,266 % fällig am 26.01.2026	509	509	0,05
2,300 % fällig am 01.03.2035	2	2	0,00	0,948 % fällig am 20.07.2060	€ 4.133	5.732	0,52	0,326 % fällig am 25.10.2029	1.944	1.936	0,17
2,588 % fällig am 01.08.2035	130	138	0,01	1,249 % fällig am 25.05.2051	2.036	2.827	0,25	South Carolina Student Loan Corp.			
3,500 % fällig am 01.07.2047	41.718	45.146	4,06	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				1,135 % fällig am 03.09.2024	255	256	0,02
4,000 % fällig am 01.10.2047	37	40	0,00	2,978 % fällig am 25.01.2035	\$ 250	255	0,02	Structured Asset Investment Loan Trust			
5,000 % fällig am 01.02.2025 - 01.10.2031	1.098	1.207	0,11	0,593 % fällig am 19.07.2035	21	20	0,00	1,067 % fällig am 25.10.2033	151	151	0,01
5,500 % fällig am 01.02.2027 - 01.03.2028	11	12	0,00	Structured Asset Mortgage Investments Trust				TICP CLO Ltd.			
6,000 % fällig am 01.01.2023 - 01.01.2041	1.413	1.671	0,15	0,772 % fällig am 25.04.2043	1	1	0,00	1,028 % fällig am 20.04.2028	1.939	1.939	0,17
6,500 % fällig am 01.12.2035 - 01.01.2036	13	14	0,00	Thornburg Mortgage Securities Trust				Venture CLO Ltd.			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				2,772 % fällig am 25.04.2043	1	1	0,00	1,288 % fällig am 20.01.2029	2.900	2.902	0,26
2,000 % fällig am 01.08.2036 - 01.08.2051	76.000	77.860	6,99	Towd Point Mortgage Funding PLC				WhiteHorse Ltd.			
		193.966	17,42	0,049 % fällig am 20.05.2045	€ 6.509	9.030	0,81	1,120 % fällig am 17.04.2027	424	424	0,04
				0,949 % fällig am 20.07.2045	2.847	3.946	0,36	Zais CLO Ltd.			
				1,111 % fällig am 20.10.2051	4.201	5.834	0,53	1,334 % fällig am 15.04.2028	1.501	1.503	0,13
				Trinity Square PLC						58.227	5,23
				0,899 % fällig am 15.07.2059	3.200	4.428	0,40	STAATSEMISSIONEN			
				Twin Bridges PLC				Israel Government International Bond			
				1,199 % fällig am 12.06.2053	2.809	3.909	0,35	0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS 20.000	6.138	0,55
				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Peru Government International Bond			
				0,772 % fällig am 25.01.2045	\$ 622	622	0,06	8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN 17.000	5.518	0,50
				1,516 % fällig am 25.06.2042	7	7	0,00				
				Warwick Finance Residential Mortgages PLC							
				0,999 % fällig am 21.12.2049	€ 1.470	2.037	0,18				

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Average Duration Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 2.300	\$ 2.315	0,21	U.S. TREASURY BILLS 0,031 % fällig am 04.11.2021 (d)(e)(h)	\$ 3.400	\$ 3.399	0,30	INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (f)	3.140.921	\$ 32.038	2,88
		13.971	1,26	0,041 % fällig am 23.09.2021 (d)(e)	23.800	23.798	2,14	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	2.743.323	27.326	2,46
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE KURZFRISTIGE SCHULDITITEL Pacific Gas and Electric Co. 1,531 % fällig am 15.11.2021	2.900	2.906	0,26	0,043 % fällig am 26.08.2021 (d)(e)	8.700	8.700	0,78			59.364	5,34
ISRAEL TREASURY BILLS (0,052) % fällig am 06.10.2021 (d)(e) ILS	10.000	3.069	0,27	0,052 % fällig am 26.08.2021 (d)(e)	16.000	15.999	1,44	BÖRSENGEHADELTE FONDS PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	484.660	49.216	4,42
(0,020) % fällig am 02.02.2022 (d)(e)	16.600	5.094	0,46	0,053 % fällig am 19.08.2021 (d)(e)(h)	271	271	0,02	Summe Investmentfonds		\$ 108.580	9,76
0,000 % fällig am 06.04.2022 (d)(e)	10.500	3.222	0,29	0,057 % fällig am 26.08.2021 (d)(e)	28.300	28.298	2,54				
0,010 % fällig am 02.03.2022 (d)(e)	10.000	3.068	0,27	0,058 % fällig am 02.09.2021 (d)(e)	20.000	19.998	1,80				
0,023 % fällig am 28.02.2022 (d)(e)	10.400	3.191	0,29	0,061 % fällig am 02.09.2021 (d)(e)	1.400	1.400	0,13				
		17.644	1,58	0,081 % fällig am 06.07.2021 (d)(e)	1	1	0,00				
						152.358	13,69				
				Summe kurzfristige Instrumente		172.908	15,53				
				Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 970.481	87,17				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	0,030 %	30.06.2021	01.07.2021	\$ 105.100	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2028	\$ (107.332)	\$ 105.100	\$ 105.100	9,44
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (107.332)	\$ 105.100	\$ 105.100	9,44

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	36	\$ (65)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2021	1.358	(475)	(0,04)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	2.220	(702)	(0,06)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	687	(976)	(0,09)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	134	(294)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (2.512)	(0,22)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 3.000	\$ 13	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	15.000	40	0,00
				\$ 53	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,345 %	03.01.2022	BRL 3.700	\$ (6)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,350	03.01.2022	80.300	(133)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,360	03.01.2022	426.000	(485)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,700	03.01.2022	236.000	(226)	(0,02)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR		0,100	20.03.2024	¥ 6.090.000	58	0,01
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR		0,300	18.03.2026	4.220.000	(343)	(0,03)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR		0,380	18.06.2028	90.000	9	0,00
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (1.126)	(0,10)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

DEVISETERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	08.2021	€	37.713	\$	45.769	\$	1.003	0,09
BPS	07.2021	AUD	12.404		9.640		327	0,03
	07.2021	CAD	1.825		1.515		41	0,00
CBK	07.2021	AUD	4.146		3.207		94	0,01
	07.2021	PEN	3.549		942		16	0,00
	10.2021	ILS	10.003		3.024		0	(50)
	11.2021		20.007		6.080		0	(73)
	02.2022		27.003		8.254		0	(62)
	03.2022		9.999		3.052		0	(28)
GLM	04.2022		10.499		3.198		0	(38)
HUS	08.2021	€	8.001		9.772		275	0,03
	08.2021	£	62.319		88.098		1.998	0,18
	08.2021	\$	1.091	£	775		0	(20)
	09.2021	MXN	1.089	\$	52		0	(3)
JPM	07.2021	PEN	18.917		5.031		91	0,01
	08.2021	€	3.580		4.380		130	0,01
	08.2021	\$	3.487	£	2.469		0	(76)
MYI	07.2021	£	12	\$	17		0	0,00
	07.2021	\$	1.739	AUD	2.299		0	(13)
	07.2021		70	€	59		0	0,00
	07.2021		10	£	7		0	0,00
	08.2021	AUD	2.299	\$	1.739		13	0,00
SCX	07.2021	\$	5.644	PEN	22.466		223	0,02
	08.2021		1.388	£	993		0	(16)
	09.2021	PEN	22.466	\$	5.649		0	(233)
UAG	07.2021	\$	8.454	AUD	11.145		0	(87)
	08.2021	AUD	11.145	\$	8.455		87	0,01
	08.2021	¥	128.700		1.178		18	0,00
							\$	4.316
							\$	(699)
							\$	3.617
								0,33

ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	€	87	\$	104	\$	1	0,00
	07.2021	\$	82	€	67		(2)	0,00
BPS	07.2021	€	619	\$	748		13	0,00
	07.2021	\$	22.806	€	18.642		0	(698)
BRC	07.2021	€	81	\$	99		3	0,00
HUS	07.2021		89		107		1	0,00
	07.2021	\$	1.033	€	852		0	(23)
MYI	07.2021	€	22	\$	26		0	0,00
SCX	07.2021	\$	26.604	€	21.746		0	(815)
TOR	07.2021		26.604		21.746		0	(815)
							\$	18
							\$	(2.353)
							\$	(2.335)
								(0,21)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BPS	07.2021	\$	1.076	£	767		0	(17)
BRC	07.2021	£	692	\$	974		18	0,00
GLM	07.2021	\$	10.683	£	7.557		0	(244)
HUS	07.2021	£	11.200	\$	15.626		154	0,01
	08.2021	\$	8.605	£	6.217		0	(16)
MYI	07.2021	£	175	\$	248		6	0,00
	07.2021	\$	102	£	73		0	(1)
SCX	07.2021	£	5	\$	7		0	0,00
	07.2021	\$	10.685	£	7.517		0	(301)
SSB	07.2021	£	6.217	\$	8.591		3	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Average Duration Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2021	\$ 183	£ 129	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	08.2021	8.592	6.217	0	(3)	(3)	0,00
UAG	07.2021	10.707	7.557	0	(268)	(268)	(0,02)
				\$ 181	\$ (855)	\$ (674)	(0,06)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 608 0,06

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG

US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

Uniform Mortgage-Backed Security, TBA
3,500 % fällig am 01.08.2051
4,000 % fällig am 01.08.2051

PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
\$ 36.200	\$ (38.129)	(3,43)
89.945	(95.862)	(8,61)

Summe Leerverkaufte Wertpapiere

\$ (133.991) (12,04)

Summe Anlagen

\$ 1.047.193 94,07

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 65.956 5,93

Nettovermögen

\$ 1.113.149 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
 (b) Reines Kapitalwertpapier.
 (c) Wertpapier per Emissionstermin.
 (d) Nullkuponwertpapier.
 (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (f) Mit dem Fonds verbunden.
 (g) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Ford Credit Canada Co.	3,465 %	10.01.2022	20.10.2020 - 29.10.2020	\$ 1.359	\$ 1.462	0,13

(h) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.554 und Barmittel in Höhe von USD 890 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 5.102 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 970.481	\$ 0	\$ 970.481
Investmentfonds	59.364	49.216	0	108.580
Pensionsgeschäfte	0	105.100	0	105.100
Finanzderivate ⁽³⁾	(359)	(2.618)	0	(2.977)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(133.991)	0	(133.991)
Summen	\$ 59.005	\$ 988.188	\$ 0	\$ 1.047.193

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.198.660	\$ 5.827	\$ 1.204.487
Investmentfonds	67.214	49.283	0	116.497
Pensionsgeschäfte	0	8.275	0	8.275
Finanzderivate ⁽³⁾	595	(2.407)	0	(1.812)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(236.203)	0	(236.203)
Summen	\$ 67.809	\$ 1.017.608	\$ 5.827	\$ 1.091.244

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 1.002	\$ (790)	\$ 212
BPS	(334)	260	(74)
BRC	21	0	21
CBK	(103)	0	(103)
GLM	(282)	261	(21)
HUS	2.366	(1.910)	456
JPM	145	(280)	(135)
MYI	5	(10)	(5)
SCX	(1.142)	1.032	(110)
SSB	(5)	0	(5)
TOR	(815)	630	(185)
UAG	(250)	261	11

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	44,75	33,42
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	41,21	67,18
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,21	1,18
Investmentfonds	9,76	9,84
Pensionsgeschäfte	9,44	0,70
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,22)	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,10)	0,04
Freiverkehrsfinanzderivate	0,06	(0,24)
Leerverkaufte Wertpapiere	(12,04)	(19,96)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	35,60	34,34
Kommunalanleihen und Wechsel	k. A.	0,09
US-Regierungsbehörden	17,42	29,12
US-Schatzobligationen	4,29	4,03
Non-Agency-MBS	7,84	7,38
Forderungsbesicherte Wertpapiere	5,23	5,29
Staatsemissionen	1,26	1,30
Kurzfristige Instrumente	15,53	20,23
Investmentfonds	9,76	9,84
Pensionsgeschäfte	9,44	0,70
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,22)	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,01
Zinsswaps	(0,10)	0,03
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,33	(0,44)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,27)	0,20
Leerverkaufte Wertpapiere	(12,04)	(19,96)
Sonstige Aktiva und Passiva	5,93	7,79
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
Caesars Resort Collection LLC				Barclays PLC				Enact Holdings, Inc.			
4,604 % fällig am 21.07.2025	\$ 99	\$ 100	0,01	1,536 % fällig am 16.05.2024	\$ 709	\$ 722	0,09	6,500 % fällig am 15.08.2025	\$ 1.500	\$ 1.658	0,22
Dell International LLC				3,200 % fällig am 10.08.2021	2.600	2.608	0,34	FCE Bank PLC			
2,000 % fällig am 19.09.2025	108	108	0,01	3,375 % fällig am 02.04.2025	€ 500	646	0,08	0,869 % fällig am 13.09.2021	€ 300	356	0,05
Delos Finance SARL				4,610 % fällig am 15.02.2023	\$ 200	205	0,03	First Abu Dhabi Bank PJSC			
1,897 % fällig am 06.10.2023	420	420	0,06	BBVA Bancomer S.A.				1,375 % fällig am 19.02.2023	€ 1.000	1.398	0,18
FinCo LLC				4,375 % fällig am 10.04.2024	600	654	0,09	Ford Motor Credit Co. LLC			
2,604 % fällig am 27.06.2025	199	199	0,03	6,750 % fällig am 30.09.2022	1.750	1.861	0,24	0,000 % fällig am 01.12.2021	€ 200	237	0,03
HCA, Inc.				Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL				1,391 % fällig am 15.02.2023	\$ 800	797	0,10
1,854 % fällig am 13.03.2025	116	116	0,02	1,400 % fällig am 06.07.2022	€ 600	719	0,09	1,514 % fällig am 17.02.2023	€ 500	603	0,08
Intelsat Jackson Holdings S.A.				BNP Paribas S.A.				1,744 % fällig am 19.07.2024	100	121	0,02
3,600 % - 6,500 % fällig am 13.07.2022	22	22	0,00	2,219 % fällig am 09.06.2026	\$ 1.500	1.547	0,20	2,386 % fällig am 17.02.2026	300	370	0,05
Jefferies Finance LLC				2,950 % fällig am 23.05.2022	2.000	2.048	0,27	3,021 % fällig am 06.03.2024	400	498	0,07
3,125 % fällig am 03.06.2026	695	693	0,09	3,800 % fällig am 10.01.2024	500	537	0,07	3,219 % fällig am 09.01.2022	\$ 200	202	0,03
Ortho-Clinical Diagnostics S.A.				BOC Aviation Ltd.				3,350 % fällig am 01.11.2022	500	513	0,07
3,089 % fällig am 30.06.2025	54	54	0,01	2,375 % fällig am 15.09.2021	1.800	1.803	0,24	3,550 % fällig am 07.10.2022	1.900	1.953	0,26
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				2,750 % fällig am 18.09.2022	800	815	0,11	4,250 % fällig am 20.09.2022	500	518	0,07
3,854 % fällig am 16.11.2025	2.500	2.498	0,33	3,500 % fällig am 10.10.2024	1.000	1.067	0,14	5,596 % fällig am 07.01.2022	700	715	0,09
RPI Intermediate Finance Trust				BPCE S.A.				5,875 % fällig am 02.08.2021	300	302	0,04
1,854 % fällig am 11.02.2027	21	21	0,00	1,652 % fällig am 06.10.2026	300	302	0,04	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			
Univision Communications, Inc.				Brixmor Operating Partnership LP				6,500 % fällig am 01.10.2025	1.000	1.040	0,14
2,854 % fällig am 15.03.2024	608	608	0,08	1,226 % fällig am 01.02.2022	1.700	1.707	0,22	FS KKR Capital Corp.			
		4.839	0,64	Canadian Imperial Bank of Commerce				2,625 % fällig am 15.01.2027	400	396	0,05
				0,447 % fällig am 14.12.2023	700	701	0,09	GA Global Funding Trust			
				Cantor Fitzgerald LP				1,000 % fällig am 08.04.2024	1.400	1.404	0,18
				6,500 % fällig am 17.06.2022	850	897	0,12	GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.			
				Charles Schwab Corp.				3,373 % fällig am 15.11.2025	3.500	3.821	0,50
				0,550 % fällig am 18.03.2024	1.500	1.512	0,20	General Motors Financial Co., Inc.			
				0,750 % fällig am 18.03.2024	600	604	0,08	1,457 % fällig am 30.06.2022	100	101	0,01
				China Construction Bank Europe S.A.				5,100 % fällig am 17.01.2024	300	330	0,04
				0,000 % fällig am 28.06.2024 (c)	€ 2.800	3.319	0,44	Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
				China Construction Bank New Zealand Ltd.				2,875 % fällig am 20.06.2022	€ 600	731	0,10
				0,885 % fällig am 20.12.2021	\$ 300	301	0,04	2,950 % fällig am 29.07.2026	600	772	0,10
				CIFI Holdings Group Co. Ltd.				Goldman Sachs Group, Inc.			
				5,950 % fällig am 20.10.2025	1.000	1.058	0,14	0,461 % fällig am 27.07.2021	600	712	0,09
				6,450 % fällig am 07.11.2024	300	318	0,04	3,375 % fällig am 27.03.2025	3.100	4.124	0,54
				Cooperative Rabobank UA				Greenland Global Investment Ltd.			
				2,625 % fällig am 22.07.2024	700	738	0,10	6,250 % fällig am 16.12.2022	\$ 200	192	0,02
				3,875 % fällig am 25.07.2023	€ 1.000	1.284	0,17	Groupe Bruxelles Lambert S.A.			
				Country Garden Holdings Co. Ltd.				1,875 % fällig am 19.06.2025	€ 1.700	2.168	0,28
				2,700 % fällig am 12.07.2026	\$ 600	594	0,08	Horse Gallop Finance Ltd.			
				3,125 % fällig am 22.10.2025	3.100	3.119	0,41	3,250 % fällig am 30.05.2022	\$ 500	509	0,07
				CPI Property Group S.A.				HSBC Holdings PLC			
				2,750 % fällig am 12.05.2026	€ 700	905	0,12	3,950 % fällig am 18.05.2024	3.000	3.187	0,42
				4,750 % fällig am 08.03.2023	\$ 1.000	1.068	0,14	Industrial & Commercial Bank of China Ltd.			
				Credit Agricole S.A.				1,000 % fällig am 20.07.2023	2.500	2.511	0,33
				0,500 % fällig am 24.06.2024	€ 2.300	2.772	0,36	1,000 % fällig am 09.09.2023	500	503	0,07
				1,185 % fällig am 22.03.2024	\$ 2.600	2.631	0,35	ING Groep NV			
				Credit Suisse AG				1,000 % fällig am 20.09.2023	€ 2.000	2.438	0,32
				2,100 % fällig am 12.11.2021	800	806	0,11	International Lease Finance Corp.			
				3,000 % fällig am 29.10.2021	1.400	1.413	0,19	8,625 % fällig am 15.01.2022	\$ 200	209	0,03
				Credit Suisse Group AG				Intesa Sanpaolo SpA			
				3,574 % fällig am 09.01.2023	500	508	0,07	3,125 % fällig am 14.07.2022	1.600	1.642	0,22
				3,800 % fällig am 09.06.2023	400	424	0,06	3,375 % fällig am 12.01.2023	1.300	1.354	0,18
				Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.				5,017 % fällig am 26.06.2024	2.200	2.395	0,31
				3,800 % fällig am 15.09.2022	850	885	0,12	Itau Unibanco Holding S.A.			
				Cromwell Ereit Lux Finco SARL				2,900 % fällig am 24.01.2023	2.200	2.253	0,30
				2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 1.000	1.231	0,16	JPMorgan Chase & Co.			
				CTP NV				2,776 % fällig am 25.04.2023	5.000	5.097	0,67
				0,500 % fällig am 21.06.2025	100	118	0,02	Kaisa Group Holdings Ltd.			
				DAE Sukuk Dific Ltd.				9,375 % fällig am 30.06.2024	400	379	0,05
				3,750 % fällig am 15.02.2026	\$ 700	743	0,10	9,750 % fällig am 28.09.2023	1.500	1.483	0,19
				Danske Bank A/S				10,875 % fällig am 23.07.2023	1.600	1.602	0,21
				1,179 % fällig am 12.09.2023	2.100	2.124	0,28	11,700 % fällig am 11.11.2025	200	189	0,02
				3,001 % fällig am 20.09.2022	800	804	0,11	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.			
				Dell Bank International DAC				3,950 % fällig am 30.06.2022	€ 832	1.175	0,15
				0,625 % fällig am 17.10.2022	€ 2.000	2.398	0,32	Kilroy Realty LP			
				Deutsche Bank AG				3,450 % fällig am 15.12.2024	\$ 800	854	0,11
				1,447 % fällig am 01.04.2025 (g)	\$ 1.600	1.610	0,21	KWG Group Holdings Ltd.			
				2,129 % fällig am 24.11.2026 (g)	500	508	0,07	5,950 % fällig am 10.08.2025	300	299	0,04
				3,300 % fällig am 16.11.2022	500	518	0,07	LeasePlan Corp. NV			
				4,250 % fällig am 14.10.2021	2.600	2.628	0,35	0,125 % fällig am 13.09.2023	€ 800	954	0,13
				Digital Dutch Finco BV				0,750 % fällig am 03.10.2022	500	600	0,08
				0,125 % fällig am 15.10.2022	€ 1.000	1.191	0,16	2,875 % fällig am 24.10.2024	\$ 1.500	1.577	0,21
				Easy Tactic Ltd.				Lloyds Banking Group PLC			
				11,750 % fällig am 02.08.2023	\$ 300	295	0,04	3,500 % fällig am 01.04.2026	€ 600	801	0,11
								4,050 % fällig am 16.08.2023	\$ 1.000	1.072	0,14

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Logicor Financing SARL				QNB Finance Ltd.				UBS Group AG			
0,750 % fällig am 15.07.2024 €	1.200	\$ 1.448	0,19	1,256 % fällig am 12.02.2022 \$	1.300	\$ 1.306	0,17	2,859 % fällig am 15.08.2023 \$	300	\$ 308	0,04
Lseg Netherlands BV				1,375 % fällig am 26.01.2026	300	298	0,04	UniCredit SpA			
0,000 % fällig am 06.04.2025				3,500 % fällig am 28.03.2024	1.100	1.175	0,15	7,830 % fällig am 04.12.2023	2.800	3.246	0,43
(c)	1.000	1.187	0,16	Radian Group, Inc.				Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.			
LSEGA Financing PLC				6,625 % fällig am 15.03.2025	200	226	0,03	1,697 % fällig am 25.05.2023	300	301	0,04
1,375 % fällig am 06.04.2026 \$	1.600	1.604	0,21	Reliance Standard Life Global Funding				4,150 % fällig am 18.04.2023	1.900	1.989	0,26
MassMutual Global Funding				2,150 % fällig am 21.01.2023	500	512	0,07	4,200 % fällig am 07.06.2024	900	967	0,13
0,480 % fällig am 28.08.2023	1.900	1.904	0,25	2,625 % fällig am 22.07.2022	1.400	1.434	0,19	Virgin Money UK PLC			
Metropolitan Life Global Funding				Santander UK Group Holdings PLC				0,375 % fällig am 27.05.2024 €	2.500	2.986	0,39
0,375 % fällig am 09.04.2024 €	2.100	2.530	0,33	1,532 % fällig am 21.08.2026	1.200	1.203	0,16	Volkswagen Bank GmbH			
0,450 % fällig am 01.09.2023 \$	300	300	0,04	3,571 % fällig am 10.01.2023	200	203	0,03	1,250 % fällig am 10.06.2024	600	738	0,10
0,900 % fällig am 08.06.2023	1.500	1.516	0,20	Santander UK PLC				Volkswagen Financial Services AG			
1,250 % fällig am 17.09.2021 €	1.400	1.666	0,22	0,816 % fällig am 15.11.2021	1.900	1.905	0,25	0,625 % fällig am 01.04.2022	1.200	1.433	0,19
MGM Growth Properties Operating Partnership LP				3,750 % fällig am 15.11.2021	700	709	0,09	Volkswagen Financial Services NV			
5,625 % fällig am 01.05.2024 \$	700	759	0,10	SBA Tower Trust				1,125 % fällig am 18.09.2023 £	2.200	3.065	0,40
Mitsubishi HC Capital, Inc.				1,631 % fällig am 15.11.2026	1.900	1.902	0,25	1,875 % fällig am 07.09.2021	1.300	1.800	0,24
2,250 % fällig am 07.09.2021	1.500	1.505	0,20	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				Volkswagen Leasing GmbH			
3,406 % fällig am 28.02.2022	2.300	2.339	0,31	5,125 % fällig am 29.10.2022	700	732	0,10	0,000 % fällig am 19.07.2024			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				5,250 % fällig am 23.05.2023				(c)	1.000	1.185	0,16
1,036 % fällig am 26.07.2023	3.000	3.041	0,40	(f)	500	530	0,07	Wells Fargo & Co.			
2,623 % fällig am 18.07.2022	1.600	1.640	0,22	6,125 % fällig am 07.02.2022	2.900	2.996	0,39	0,805 % fällig am 19.05.2025 \$	3.300	3.294	0,43
Mizuho Financial Group, Inc.				Scentre Group Trust				Wells Fargo Bank N.A.			
0,777 % fällig am 25.05.2024	1.900	1.912	0,25	1,375 % fällig am 22.03.2023 €	200	243	0,03	3,550 % fällig am 14.08.2023	1.400	1.491	0,20
1,005 % fällig am 11.09.2022	2.700	2.725	0,36	Seazen Group Ltd.				3,625 % fällig am 22.10.2021	700	705	0,09
1,020 % fällig am 11.10.2023 €	400	488	0,06	6,000 % fällig am 12.08.2024 \$	400	417	0,05	Yango Justice International Ltd.			
Morgan Stanley				Shinhan Bank Co. Ltd.				7,500 % fällig am 15.04.2024	500	483	0,06
0,637 % fällig am 26.07.2024	2.800	3.374	0,44	0,250 % fällig am 16.10.2024 €	1.100	1.318	0,17	7,500 % fällig am 17.02.2025	300	271	0,04
0,731 % fällig am 05.04.2024 \$	2.700	2.706	0,36	1,183 % fällig am 29.09.2025 AUD	800	598	0,08	10,250 % fällig am 18.03.2022	1.800	1.814	0,24
MUFG Bank Ltd.				Shriram Transport Finance Co. Ltd.				5,125 % fällig am 20.05.2026	1.700	1.738	0,23
3,200 % fällig am 26.02.2023	1.450	1.518	0,20	5,950 % fällig am 24.10.2022 \$	900	922	0,12	299.684			39,47
MUFG Union Bank N.A.				Sitka Holdings LLC				INDUSTRIEWERTE			
0,757 % fällig am 09.12.2022	900	906	0,12	4,643 % fällig am 06.07.2026	1.800	1.799	0,24	21Vianet Group, Inc.			
Multibank, Inc.				(a)				7,875 % fällig am 15.10.2021	500	501	0,07
4,375 % fällig am 09.11.2022	200	205	0,03	SL Green Realty Corp.				7-Eleven, Inc.			
Muthoot Finance Ltd.				4,500 % fällig am 01.12.2022	2.900	3.021	0,40	0,612 % fällig am 10.08.2022	1.500	1.501	0,20
4,400 % fällig am 02.09.2023	800	825	0,11	SLM Corp.				AA Bond Co. Ltd.			
Nationale-Niederlanden Bank NV				5,125 % fällig am 05.04.2022	700	715	0,09	2,750 % fällig am 31.07.2043 £	900	1.264	0,17
0,375 % fällig am 31.05.2023 €	400	480	0,06	SMBC Aviation Capital Finance DAC				AbbVie, Inc.			
Nationwide Building Society				2,650 % fällig am 15.07.2021	1.400	1.401	0,18	3,250 % fällig am 01.10.2022 \$	400	411	0,05
3,622 % fällig am 26.04.2023 \$	700	718	0,09	3,550 % fällig am 15.04.2024	3.330	3.540	0,47	Aeroporti di Roma SpA			
3,766 % fällig am 08.03.2024	800	840	0,11	4,125 % fällig am 15.07.2023	800	851	0,11	5,441 % fällig am 20.02.2023 £	400	590	0,08
Natwest Group PLC				Societe Generale S.A.				Air Canada Pass-Through Trust			
1,626 % fällig am 15.05.2023	1.800	1.819	0,24	1,488 % fällig am 14.12.2026	2.400	2.380	0,31	3,750 % fällig am 15.06.2029 \$	759	790	0,10
2,000 % fällig am 08.03.2023 €	500	602	0,08	Standard Chartered PLC				ALROSA Finance S.A.			
2,359 % fällig am 22.05.2024 \$	3.000	3.092	0,41	0,991 % fällig am 12.01.2025	1.000	998	0,13	4,650 % fällig am 09.04.2024	400	433	0,06
NatWest Markets PLC				1,214 % fällig am 23.03.2025	500	502	0,07	Altice Financing S.A.			
1,000 % fällig am 28.05.2024 €	1.300	1.591	0,21	1,271 % fällig am 14.10.2023	200	202	0,03	2,250 % fällig am 15.01.2025 €	1.200	1.385	0,18
NE Property BV				1,319 % fällig am 14.10.2023	200	202	0,03	American Airlines, Inc.			
2,625 % fällig am 22.05.2023	300	370	0,05	1,328 % fällig am 10.09.2022	1.000	1.002	0,13	5,500 % fällig am 20.04.2026 \$	500	530	0,07
New Metro Global Ltd.				4,247 % fällig am 20.01.2023	600	612	0,08	Arrow Electronics, Inc.			
4,500 % fällig am 02.05.2026 \$	1.700	1.671	0,22	State Bank of India				3,500 % fällig am 01.04.2022	1.580	1.606	0,21
7,500 % fällig am 16.12.2021	800	816	0,11	3,250 % fällig am 24.01.2022	2.500	2.534	0,33	Asahi Group Holdings Ltd.			
Nissan Motor Acceptance Corp.				Sumitomo Mitsui Banking Corp.				0,010 % fällig am 19.04.2024 €	1.200	1.427	0,19
1,078 % fällig am 13.01.2022	900	902	0,12	0,010 % fällig am 10.09.2025 €	5.000	5.969	0,79	0,155 % fällig am 23.10.2024	500	597	0,08
2,800 % fällig am 13.01.2022	500	506	0,07	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				Atlantia SpA			
Nomura Holdings, Inc.				0,465 % fällig am 30.05.2024	100	121	0,02	1,625 % fällig am 03.02.2025	1.300	1.584	0,21
1,851 % fällig am 16.07.2025	200	205	0,03	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				Bacardi Ltd.			
2,648 % fällig am 16.01.2025	2.800	2.945	0,39	0,800 % fällig am 12.09.2023 \$	700	705	0,09	2,750 % fällig am 03.07.2023	300	374	0,05
NTT Finance Corp.				Sunac China Holdings Ltd.				Baidu, Inc.			
0,583 % fällig am 01.03.2024	1.200	1.199	0,16	5,950 % fällig am 26.04.2024	3.700	3.649	0,48	3,875 % fällig am 29.09.2023 \$	700	745	0,10
1,900 % fällig am 21.07.2021	900	901	0,12	6,500 % fällig am 10.01.2025	400	394	0,05	BAT Capital Corp.			
Nykredit Realkredit A/S				6,500 % fällig am 26.01.2026	200	193	0,02	1,125 % fällig am 16.11.2023 €	300	364	0,05
0,750 % fällig am 14.07.2021 €	1.100	1.305	0,17	6,650 % fällig am 03.08.2024	600	603	0,08	BAT International Finance PLC			
Omega Healthcare Investors, Inc.				7,000 % fällig am 09.07.2025	200	197	0,03	1,750 % fällig am 05.07.2021 £	500	691	0,09
4,375 % fällig am 01.08.2023 \$	83	88	0,01	Svenska Handelsbanken AB				Bayer AG			
Pacific Life Global Funding				1,418 % fällig am 11.06.2027	1.500	1.507	0,20	0,050 % fällig am 12.01.2025 €	500	592	0,08
1,375 % fällig am 14.04.2026	1.700	1.704	0,22	Synchrony Financial				0,375 % fällig am 06.07.2024	1.500	1.799	0,24
Park Aerospace Holdings Ltd.				4,375 % fällig am 19.03.2024	600	653	0,09	Bayer U.S. Finance LLC			
5,250 % fällig am 15.08.2022	2.200	2.303	0,30	Times China Holdings Ltd.				1,129 % fällig am 15.12.2023 \$	687	697	0,09
PNC Bank N.A.				7,625 % fällig am 21.02.2022	200	202	0,03	Becton Dickinson and Co.			
2,028 % fällig am 09.12.2022	700	705	0,09	Toronto-Dominion Bank				1,000 % fällig am 15.12.2022 €	1.000	1.206	0,16
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.				0,506 % fällig am 27.01.2023	800	804	0,11	Berry Global, Inc.			
5,950 % fällig am 30.04.2025	1.000	1.036	0,14	TP ICAP Ltd.				0,950 % fällig am 15.02.2024 \$	3.170	3.177	0,42
6,250 % fällig am 10.08.2024	300	311	0,04	5,250 % fällig am 26.01.2024 £	1.750	2.656	0,35				
Protective Life Global Funding				UBS AG							
1,170 % fällig am 15.07.2025	1.000	1.001	0,13	7,625 % fällig am							
1,999 % fällig am 14.09.2021	800	803	0,11	17.08.2022 (f)	\$ 2.650	2.851	0,37				

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS
BlueScope Finance Americas LLC 4,625 % fällig am 25.05.2023	\$ 700	\$ 741	0,10	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	€ 2.600	\$ 3.192	0,42	Occidental Petroleum Corp. 2,900 % fällig am 15.08.2024	\$ 1.800	\$ 1.843	0,24
Boeing Co. 1,433 % fällig am 04.02.2024	1.000	1.003	0,13	GATX Corp. 0,896 % fällig am 05.11.2021	\$ 800	802	0,11	6,950 % fällig am 01.07.2024	1.100	1.243	0,16
2,300 % fällig am 01.08.2021	600	601	0,08	4,750 % fällig am 15.06.2022	500	520	0,07	ONEOK Partners LP 5,000 % fällig am 15.09.2023	200	216	0,03
Booking Holdings, Inc. 0,100 % fällig am 08.03.2025	€ 300	357	0,05	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,949 % fällig am 24.01.2024	€ 4.000	4.994	0,66	Oracle Corp. 1,650 % fällig am 25.03.2026	1.900	1.927	0,25
British Airways Pass-Through Trust 3,350 % fällig am 15.12.2030	\$ 2.150	2.157	0,28	6,510 % fällig am 07.03.2022	\$ 100	104	0,01	(g)			
Broadcom, Inc. 3,459 % fällig am 15.09.2026	521	568	0,07	Geely Automobile Holdings Ltd. 3,625 % fällig am 25.01.2023	200	206	0,03	Panasonic Corp. 2,536 % fällig am 19.07.2022	2.600	2.652	0,35
Caesars Resort Collection LLC 5,750 % fällig am 01.07.2025	500	528	0,07	Georgia-Pacific LLC 0,625 % fällig am 15.05.2024	2.700	2.691	0,35	Perrigo Finance Unlimited Co. 3,900 % fällig am 15.12.2024	250	270	0,04
Cellnex Telecom S.A. 2,375 % fällig am 16.01.2024	€ 200	249	0,03	HollyFrontier Corp. 2,625 % fällig am 01.10.2023	1.300	1.345	0,18	Petroleos Mexicanos 2,500 % fällig am 21.08.2021	€ 2.400	2.853	0,38
Central Japan Railway Co. 2,200 % fällig am 02.10.2024	\$ 3.300	3.435	0,45	HPHT Finance Ltd. 2,875 % fällig am 05.11.2024	700	734	0,10	Pinnacle Bidco PLC 5,500 % fällig am 15.02.2025	1.000	1.218	0,16
Central Nippon Expressway Co. Ltd. 2,849 % fällig am 03.03.2022	700	711	0,09	Hyatt Hotels Corp. 3,135 % fällig am 01.09.2022	200	201	0,03	Rolls-Royce PLC 3,625 % fällig am 14.10.2025	\$ 500	507	0,07
Cetin Finance BV 1,423 % fällig am 06.12.2021	€ 1.200	1.432	0,19	5,375 % fällig am 15.08.2021	600	602	0,08	Royalty Pharma PLC 0,750 % fällig am 02.09.2023	700	702	0,09
Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	1.100	1.316	0,17	Hyundai Capital America 0,875 % fällig am 14.06.2024	1.600	1.593	0,21	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625 % fällig am 01.03.2025	200	229	0,03
Charter Communications Operating LLC 4,464 % fällig am 23.07.2022	\$ 1.100	1.139	0,15	1,150 % fällig am 10.11.2022	2.200	2.216	0,29	6,250 % fällig am 15.03.2022	620	636	0,08
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7,000 % fällig am 30.06.2024	2.065	2.366	0,31	1,500 % fällig am 15.06.2026	1.100	1.093	0,14	Sands China Ltd. 4,600 % fällig am 08.08.2023	5.900	6.285	0,83
China Mengniu Dairy Co. Ltd. 4,250 % fällig am 07.08.2023	600	639	0,08	IHS Markit Ltd. 3,625 % fällig am 01.05.2024	500	538	0,07	SEB S.A. 1,375 % fällig am 16.06.2025	€ 500	612	0,08
China Resources Gas Group Ltd. 4,500 % fällig am 05.04.2022	300	308	0,04	4,000 % fällig am 01.03.2026	1.200	1.334	0,18	1,500 % fällig am 31.05.2024	200	246	0,03
Clear Channel International BV 6,625 % fällig am 01.08.2025	200	211	0,03	5,000 % fällig am 01.11.2022	800	839	0,11	2,375 % fällig am 25.11.2022	100	122	0,02
CMHI Finance BVI Co. Ltd. 4,375 % fällig am 06.08.2023	600	639	0,08	Imperial Brands Finance PLC 3,500 % fällig am 11.02.2023	900	931	0,12	Seven & I Holdings Co. Ltd. 3,350 % fällig am 17.09.2021	\$ 3.400	3.421	0,45
CommonSpirit Health 2,760 % fällig am 01.10.2024	100	105	0,01	Infor, Inc. 1,450 % fällig am 15.07.2023	300	304	0,04	Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	€ 500	613	0,08
Crown European Holdings S.A. 0,750 % fällig am 15.02.2023	€ 1.000	1.190	0,16	InterContinental Hotels Group PLC 1,625 % fällig am 08.10.2024	€ 800	989	0,13	SK Hynix, Inc. 1,000 % fällig am 19.01.2024	\$ 1.300	1.293	0,17
DAE Funding LLC 1,550 % fällig am 01.08.2024	\$ 900	900	0,12	3,875 % fällig am 28.11.2022	€ 300	432	0,06	Sky Ltd. 1,875 % fällig am 24.11.2023	€ 2.100	2.617	0,34
1,625 % fällig am 15.02.2024	3.200	3.252	0,43	International Flavors & Fragrances, Inc. 0,697 % fällig am 15.09.2022	\$ 800	801	0,11	Skyworks Solutions, Inc. 0,900 % fällig am 01.06.2023	\$ 1.600	1.605	0,21
2,625 % fällig am 20.03.2025	300	306	0,04	3,200 % fällig am 01.05.2023	1.600	1.666	0,22	Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust 6,650 % fällig am 01.08.2022	105	107	0,01
5,250 % fällig am 15.11.2021	700	706	0,09	John Lewis PLC 6,125 % fällig am 21.01.2025	€ 200	313	0,04	Spirit AeroSystems, Inc. 7,500 % fällig am 15.04.2025	1.800	1.927	0,25
Danone S.A. 2,077 % fällig am 02.11.2021	200	201	0,03	JT International Financial Services BV 3,500 % fällig am 28.09.2023	\$ 400	426	0,06	Sprint Spectrum Co. LLC 3,360 % fällig am 20.03.2023	103	104	0,01
Delta Air Lines, Inc. 2,900 % fällig am 28.10.2024	2.100	2.138	0,28	Kinder Morgan Energy Partners LP 4,150 % fällig am 01.03.2022	600	615	0,08	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 900	1.064	0,14
3,625 % fällig am 15.03.2022	800	811	0,11	KLA Corp. 4,650 % fällig am 01.11.2024	2.000	2.234	0,29	Stryker Corp. 0,250 % fällig am 03.12.2024	1.000	1.198	0,16
3,800 % fällig am 19.04.2023	300	312	0,04	Komatsu Finance America, Inc. 0,849 % fällig am 09.09.2023	2.350	2.359	0,31	1,125 % fällig am 30.11.2023	1.600	1.960	0,26
4,500 % fällig am 20.10.2025	600	645	0,08	Leidos, Inc. 3,625 % fällig am 15.05.2025	100	109	0,01	Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 3,750 % fällig am 23.01.2023	\$ 1.000	1.036	0,14
7,000 % fällig am 01.05.2025	1.000	1.168	0,15	Lennox Corp. 5,375 % fällig am 01.10.2022	3.100	3.285	0,43	Suntory Holdings Ltd. 2,250 % fällig am 16.10.2024	1.100	1.141	0,15
7,375 % fällig am 15.01.2026	200	235	0,03	Lenovo Group Ltd. 5,875 % fällig am 24.04.2025	600	680	0,09	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 2.400	3.174	0,42
Devon Energy Corp. 5,250 % fällig am 15.09.2024	300	334	0,04	Lundin Energy Finance BV 2,000 % fällig am 15.07.2026	900	902	0,12	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 0,548 % fällig am 21.11.2022	100	120	0,02
Diamond Sports Group LLC 5,375 % fällig am 15.08.2026	1.000	649	0,09	Marks & Spencer PLC 4,250 % fällig am 08.12.2023	€ 300	441	0,06	Tencent Holdings Ltd. 2,985 % fällig am 19.01.2023	\$ 400	414	0,05
Diamondback Energy, Inc. 0,900 % fällig am 24.03.2023	2.300	2.301	0,30	Marriott International, Inc. 5,750 % fällig am 01.05.2025	\$ 700	808	0,11	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 3,650 % fällig am 10.11.2021	1.300	1.305	0,17
Dongfeng Motor Hong Kong International Co. Ltd. 1,150 % fällig am 23.10.2021	€ 3.200	3.811	0,50	Marvell Technology, Inc. 1,650 % fällig am 15.04.2026	2.000	2.000	0,26	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 2,200 % fällig am 21.07.2021	104	104	0,01
Enbridge, Inc. 0,435 % fällig am 17.02.2023	\$ 400	401	0,05	Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	800	820	0,11	Thermo Fisher Scientific, Inc. 0,125 % fällig am 01.03.2025	€ 2.300	2.743	0,36
0,655 % fällig am 18.02.2022	1.200	1.203	0,16	MGM China Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 18.06.2025	1.980	2.063	0,27	Time Warner Cable LLC 4,000 % fällig am 01.09.2021	\$ 400	400	0,05
Entergy Louisiana LLC 0,620 % fällig am 17.11.2023	2.700	2.704	0,36	MGM Resorts International 7,750 % fällig am 15.03.2022	100	105	0,01	Toyota Industries Corp. 3,110 % fällig am 12.03.2022	1.900	1.934	0,25
EQM Midstream Partners LP 4,000 % fällig am 01.08.2024	2.700	2.778	0,37	Newell Brands, Inc. 4,700 % fällig am 01.04.2026	650	726	0,10	Ubisoft Entertainment S.A. 1,289 % fällig am 30.01.2023	€ 1.700	2.051	0,27
Equifax, Inc. 1,026 % fällig am 15.08.2021	1.800	1.802	0,24	Nissan Canada, Inc. 3,150 % fällig am 14.09.2021 (g)	CAD 200	162	0,02	United Airlines, Inc. 4,375 % fällig am 15.04.2026	\$ 1.300	1.347	0,18
Eurofins Scientific SE 2,125 % fällig am 25.07.2024	€ 297	373	0,05	Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	€ 2.000	2.471	0,33	Vale Overseas Ltd. 6,250 % fällig am 10.08.2026	300	361	0,05
Expedia Group, Inc. 6,250 % fällig am 01.05.2025	\$ 1.715	1.996	0,26	3,043 % fällig am 15.09.2023	\$ 2.400	2.504	0,33				
Fidelity National Information Services, Inc. 0,125 % fällig am 03.12.2022	€ 1.000	1.192	0,16	NXP BV 3,875 % fällig am 01.09.2022	1.000	1.037	0,14				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG- ENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG- ENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG- ENS						
Valero Energy Corp. 1,200 % fällig am 15.03.2024	\$	1.000	1,009	0,13	3,300 % fällig am 15.03.2027 ^	\$	300	\$	311	0,04	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,712 % fällig am 25.12.2035	\$	555	550	0,08		
Vantage Towers AG 0,000 % fällig am 31.03.2025 (c)	€	1.900	2.247	0,30	3,300 % fällig am 01.12.2027 ^		300		309	0,04			882	0,12			
Viking Cruises Ltd. 13,000 % fällig am 15.05.2025	\$	900	1.061	0,14	3,400 % fällig am 15.08.2024 ^		100		105	0,01	STAATSEMISSIONEN						
VMware, Inc. 2,950 % fällig am 21.08.2022		2.056	2.110	0,28	3,450 % fällig am 01.07.2025		100		105	0,01	Autonomous Community of Catalonia 4,900 % fällig am 15.09.2021	€	900	1.079	0,14		
Weir Group PLC 2,200 % fällig am 13.05.2026		900	904	0,12	3,850 % fällig am 15.11.2023 ^		200		210	0,03	Canada Government International Bond 1,500 % fällig am 01.09.2024 CAD	2.800	2.318	0,31			
West Fraser Timber Co. Ltd. 4,350 % fällig am 15.10.2024		200	214	0,03	4,250 % fällig am 01.08.2023	2.000	2.120	0,28	Pennsylvania Electric Co. 4,150 % fällig am 15.04.2025	200	216	0,03	China Development Bank 0,375 % fällig am 16.11.2021	€	2.200	2.613	0,34
Williams Cos., Inc. 7,875 % fällig am 01.09.2021		385	390	0,05	Potomac Electric Power Co. 3,600 % fällig am 15.03.2024	1.262	1.353	0,18	Southwestern Electric Power Co. 3,550 % fällig am 15.02.2022	400	405	0,05	France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2025 (c)	9.000	10.886	1,43	
Woodside Finance Ltd. 3,650 % fällig am 05.03.2025		600	641	0,08	San Diego Gas & Electric Co. 7,875 % fällig am 15.05.2026	226	239	0,03	Sprint Communications, Inc. 6,000 % fällig am 15.11.2022	800	848	0,11	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % fällig am 01.04.2026 (c)	2.700	3.188	0,42	
Worldline S.A. 0,500 % fällig am 30.06.2023	€	600	721	0,10	Sprint Corp. 7,125 % fällig am 15.06.2024	125	144	0,02	1,850 % fällig am 01.07.2025	1.000	1.275	0,17	Province of Alberta 1,000 % fällig am 15.11.2021	£	100	139	0,02
Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 15.01.2026	\$	1.100	1.154	0,15	State Grid Overseas Investment Ltd. 0,797 % fällig am 05.08.2026	€	500	€	606	0,08	Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2022	\$	200	210	0,03		
YPF S.A. 40,115 % fällig am 24.07.2021	ARS	21.512	129	0,02	1,000 % fällig am 05.08.2025	\$	500	\$	495	0,07			21.708	2,86			
Zoetis, Inc. 0,595 % fällig am 20.08.2021	\$	2.100	2.101	0,28	3,750 % fällig am 02.05.2023	1.300	1.371	0,18	Systems Energy Resources, Inc. 2,140 % fällig am 09.12.2025	1.150	1.163	0,15	AKTIEN				
			190.645	25,11	Trans-Allegheny Interstate Line Co. 3,850 % fällig am 01.06.2025	1.305	1.412	0,19	Stammaktien Finanzwerte	43.861	63	0,01	Stearns Holdings LLC 'B' (b)(g)	43.861	63	0,01	
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN					Verizon Communications, Inc. 0,550 % fällig am 22.03.2024	100	101	0,01	OPTIONSSCHEINE				Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31. Dezember 2060	210	25	0,00	
Adani Green Energy UP Ltd. 6,250 % fällig am 10.12.2024		200	222	0,03	0,750 % fällig am 22.03.2024	100	101	0,01									
American Transmission Systems, Inc. 5,250 % fällig am 15.01.2022		700	717	0,09	0,840 % fällig am 20.03.2026	800	815	0,11									
Atmos Energy Corp. 0,625 % fällig am 09.03.2023		1.200	1.200	0,16	Vistra Operations Co. LLC 3,550 % fällig am 15.07.2024	1.825	1.928	0,25									
Azure Power Energy Ltd. 5,500 % fällig am 03.11.2022		500	508	0,07	Wisconsin Power & Light Co. 2,250 % fällig am 15.11.2022	600	613	0,08									
BG Energy Capital PLC 4,000 % fällig am 15.10.2021		605	611	0,08			43.643	5,74									
British Transco International Finance BV 0,000 % fällig am 04.11.2021 (c)		450	450	0,06	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		533.972	70,32									
East Ohio Gas Co. 1,300 % fällig am 15.06.2025		1.800	1.817	0,24	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL												
Electricite de France S.A. 3,625 % fällig am 13.10.2025		1.900	2.091	0,28	State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020	1.200	1.212	0,16									
Enel Finance International NV 0,000 % fällig am 17.06.2024 (c)	€	800	955	0,13	1,258 % fällig am 01.07.2025												
2,650 % fällig am 10.09.2024	\$	2.500	2.630	0,35	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN												
2,875 % fällig am 25.05.2022		400	409	0,05	Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	500	516	0,07									
Energy, Inc. 5,292 % fällig am 15.06.2022 b		505	522	0,07	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2051	17.440	18.370	2,42									
FirstEnergy Corp. 3,350 % fällig am 15.07.2022		275	280	0,04			18.886	2,49									
Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. 4,375 % fällig am 19.09.2022		1.400	1.455	0,19	1,500 % fällig am 30.11.2024												
Georgia Power Co. 2,100 % fällig am 30.07.2023		200	207	0,03	US-SCHATZ Obligationen												
India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024		250	262	0,03	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 30.04.2026	17.500	17.413	2,29									
IPALCO Enterprises, Inc. 3,700 % fällig am 01.09.2024		1.000	1.077	0,14	0,750 % fällig am 31.05.2026												
Jersey Central Power & Light Co. 4,300 % fällig am 15.01.2026		374	414	0,05	(h) 1,500 % fällig am 30.11.2024	3.200	3.182	0,42									
4,700 % fällig am 01.04.2024		1.083	1.179	0,16		800	826	0,11									
Metropolitan Edison Co. 3,500 % fällig am 15.03.2023		1.500	1.553	0,20	NON-AGENCY-MBS												
Midwest Connector Capital Co. LLC 3,625 % fällig am 01.04.2022		2.300	2.339	0,31	GSR Mortgage Loan Trust 2,924 % fällig am 25.09.2035	3	3	0,00									
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,950 % fällig am 01.09.2022		1.000	1.019	0,13	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2,541 % fällig am 25.11.2034	9	9	0,00									
Novatek OAO Via Novatek Finance DAC 4,422 % fällig am 13.12.2022		900	944	0,12	6,318 % fällig am 25.09.2034	489	540	0,07									
ONEOK, Inc. 7,500 % fällig am 01.09.2023		2.418	2.725	0,36	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 1,593 % fällig am 25.01.2047	243	242	0,03									
Pacific Gas & Electric Co. 1,598 % fällig am 16.06.2022		254	254	0,03	2,558 % fällig am 25.01.2033	6	6	0,00									
3,250 % fällig am 15.06.2023 ^		200	207	0,03			800	0,10									
					FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE												
					Driver Australia Five Trust 0,942 % fällig am 21.07.2026 AUD	118	89	0,01									
					IXIS Real Estate Capital Trust 0,722 % fällig am 25.02.2036	\$	240	243	0,03								

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (e)	7.526.235	\$ 74.969	9,87
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c., PIMCO China Bond Fund (e)	5.163	69	0,01
Summe Investmentfonds		\$ 75.038	9,88

PENSIONS-GESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	0,030 %	30.06.2021	01.07.2021	\$ 7.100	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2049	\$ (7.271)	\$ 7.100	\$ 7.100	0,94
TDM	0,030	30.06.2021	01.07.2021	1.100	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	(1.125)	1.100	1.100	0,14
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (8.396)	\$ 8.200	\$ 8.200	1,08

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2021	156	\$ 13	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	328	(143)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (130)	(0,02)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Newell Brands, Inc.	(1,000) %	20.06.2023	\$ 1.000	\$ 0	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2024	\$ 1.900	\$ 15	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	200	1	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	3.200	9	0,00
Atlantia SpA	1,000	20.12.2025	€ 2.700	114	0,02
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2022	\$ 2.400	(14)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2021	2.000	37	0,01
Boeing Co.	1,000	20.12.2022	800	4	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	1.900	4	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2022	1.300	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	4.200	31	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	5,000	20.12.2021	400	(4)	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20.12.2023	900	(35)	0,00
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2026	300	1	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 2.200	(81)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	500	24	0,00
Ryder System, Inc.	1,000	20.12.2023	\$ 1.100	34	0,00
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.06.2022	700	(3)	0,00
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.12.2022	1.600	(7)	0,00
Stellantis NV	5,000	20.06.2026	€ 1.100	2	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	1.200	17	0,00
Summe				\$ 152	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000 %	20.06.2026	€ 17.300	\$ 7	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	Erhalt/variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽⁴⁾		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	15.09.2026	£ 2.900	\$ 5	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	6,789	02.01.2023	BRL 137.300	(19)	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 5.900	9	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	1.500	3	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	9.300	207	0,03
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	5,680	08.06.2026	ZAR 87.600	(75)	(0,01)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	5,723	08.06.2026	74.200	(51)	(0,01)
Zahlung		6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	HUF 1.604.100	(63)	(0,01)
Erhalt		6-Month JPY-LIBOR	0,399	18.06.2028	¥ 77.700	(18)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIIE	6,015	03.06.2026	MXN 235.200	(280)	(0,04)
						\$ (282)	(0,04)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (123)	(0,02)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	\$ 103,234	05.08.2021	500	\$ 3	\$ 2	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000 %	20.10.2021	200	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	3.200	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.100	(1)	0	0,00
BPS	Put – OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	300	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	600	(1)	0	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	3.500	(4)	(3)	0,00
	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	1.600	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.600	(2)	(1)	0,00
	Call – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	2.400	(1)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.400	(3)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	4.400	(5)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	3.400	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	2.000	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	1.700	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	5.500	(6)	(3)	0,00
	CBK	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	500	(2)	(1)
Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index		Verkauf	0,800	18.08.2021	1.000	(1)	0	0,00
Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index		Verkauf	0,950	15.09.2021	3.700	(4)	(1)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
DUB	Call – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475 %	18.08.2021	1.200	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.200	(2)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	9.300	(9)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	3.700	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	1.300	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104.000	15.09.2021	200	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104.000	20.10.2021	1.200	(7)	(5)	(0,01)
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	7.000	(7)	(1)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	15.09.2021	6.200	(6)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	2.000	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	800	(1)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	900	(1)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	2.600	(3)	(2)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	2.000	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	8.800	(9)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	500	(1)	0	0,00
JPM	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	5.200	(6)	(4)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	1.200	(2)	(1)	0,00
MYC	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98.000	21.07.2021	300	(1)	0	0,00
						\$ (123)	\$ (41)	(0,01)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens		
FAR	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	1.900	\$ (8)	\$ (2)	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	05.08.2021	500	(2)	(1)	0,00		
JPM	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,797	05.08.2021	500	(2)	(1)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,313	07.09.2021	2.200	(7)	(9)	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,047	07.07.2021	1.500	(5)	0	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	104,047	07.07.2021	1.500	(3)	0	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	400	(1)	(1)	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	1.000	(3)	(1)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	400	(1)	0	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	3.100	(5)	(5)	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	100,219	07.07.2021	2.700	(16)	(1)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,203	07.07.2021	1.500	(6)	(3)	0,00		
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,219	07.07.2021	2.700	(14)	(4)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,422	07.07.2021	700	(3)	(1)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,641	07.07.2021	300	(1)	0	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,645	07.07.2021	4.600	(15)	(2)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,766	07.07.2021	5.800	(18)	(1)	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,188	05.08.2021	900	(3)	(1)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,188	05.08.2021	900	(1)	(3)	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,281	07.09.2021	1.500	(7)	(6)	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,164	07.07.2021	3.600	(14)	0	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,375	07.07.2021	2.700	(8)	0	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,703	05.08.2021	900	(2)	(1)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,609	05.08.2021	5.700	(18)	(11)	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	101,844	07.09.2021	7.500	(22)	(20)	(0,01)		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	103,844	07.09.2021	7.500	(11)	(12)	0,00		
							\$ (196)	\$ (86)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens	
GST	Intrum AB	5,000 %	20.12.2024	€ 1.100	\$ 128	\$ (7)	\$ 121	0,01	
HUS	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2022	\$ 300	(27)	29	2	0,00	
JPM	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	€ 600	139	(9)	130	0,02	
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	\$ 100	(9)	9	0	0,00	
						\$ 231	\$ 22	\$ 253	0,03

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	07.2021	€	288	\$	344	\$	2	0,00	
	07.2021	\$	2.012	BRL	10.682		117	0,02	
	08.2021		98	RUB	7.384		2	0,00	
	09.2021		285	PLN	1.082		(1)	0,00	
BPS	07.2021	€	1.061	\$	1.268		10	0,00	
	07.2021	£	312		436		5	0,00	
	07.2021	\$	2.144	CAD	2.583		(58)	(0,01)	
	07.2021		1.439	€	1.205		(10)	0,00	
BRC	07.2021		2.958	¥	323.500		(43)	(0,01)	
	07.2021		632	RUB	47.152		12	0,00	
	11.2021		709	MXN	14.320		(2)	0,00	
	07.2021	MXN	4.698	\$	234		(1)	0,00	
CBK	08.2021	\$	827	MXN	17.134		30	0,00	
	09.2021		187	PLN	711		0	0,00	
	07.2021	AUD	509	\$	394		11	0,00	
	07.2021	MXN	8.532		416		(12)	0,00	
GLM	07.2021	RUB	11.466		148		(8)	0,00	
	07.2021	\$	1.067	BRL	5.381		5	0,00	
	08.2021	HUF	91.914	\$	306		(5)	0,00	
	08.2021	\$	121	RUB	9.129		3	0,00	
HUS	09.2021		414	MXN	8.532		12	0,00	
	09.2021		371	ZAR	5.087		(18)	0,00	
	07.2021	BRL	16.063	\$	3.200		(1)	0,00	
	07.2021	£	11.548		16.325		373	0,05	
MYI	07.2021	RUB	22.985		298		(16)	0,00	
	07.2021	\$	3.078	€	2.539		(67)	(0,01)	
	08.2021		3.190	BRL	16.063		1	0,00	
	08.2021		941	COP	3.503.969		(4)	0,00	
SCX	08.2021		170	RUB	12.753		3	0,00	
	09.2021		299	PLN	1.137		(1)	0,00	
	09.2021		247	RUB	18.112		(2)	0,00	
	09.2021		224	ZAR	3.088		(10)	0,00	
TOR	07.2021	€	6.989	\$	8.345		57	0,01	
	07.2021	£	4		6		0	0,00	
	07.2021	MXN	5.277		267		2	0,00	
	07.2021	\$	16.420	£	11.864		(31)	0,00	
UAG	07.2021		420	MXN	8.532		7	0,00	
	08.2021	£	11.864	\$	16.422		31	0,00	
	08.2021	\$	237	RUB	17.886		6	0,00	
	09.2021		541	IDR	7.788.918		(10)	0,00	
BOA	09.2021		339	PLN	1.297		2	0,00	
	09.2021		102	RUB	7.471		(1)	0,00	
	07.2021	£	8	\$	11		0	0,00	
	07.2021	RUB	10.551		138		(6)	0,00	
BOA	07.2021	\$	4.280	€	3.587		(26)	0,00	
	07.2021		4	£	3		0	0,00	
	09.2021	ZAR	1.845	\$	129		1	0,00	
	07.2021	€	118.918		145.478		4.454	0,59	
BOA	12.2021	\$	1.201	INR	90.215		(12)	0,00	
	07.2021	CAD	5.580	\$	4.619		112	0,01	
BOA	07.2021	RUB	36.314		474		(22)	0,00	
	07.2021	\$	1.086	RUB	81.316		24	0,00	
BOA	09.2021		101		7.381		(1)	0,00	
							\$ 5.282	\$ (370)	\$ 4.912

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	07.2021	€	155	\$	189	\$	5	0,00		
	07.2021	\$	123	€	103		(1)	0,00		
BPS	07.2021	€	12	\$	14		0	0,00		
	07.2021	\$	153.724	€	125.693		(4.664)	(0,61)		
BRC	07.2021	€	18	\$	22		1	0,00		
	07.2021		274		328		4	0,00		
HUS	07.2021	\$	54.381	€	44.656		(1.424)	(0,19)		
	07.2021	€	250	\$	298		1	0,00		
SCX	07.2021	\$	168.180	€	137.473		(5.151)	(0,68)		
	07.2021		168.180		137.473		(5.151)	(0,68)		
							\$ 11	\$ (16.391)	\$ (16.380)	(2,16)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 95	\$ 135	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07.2021	\$ 16.670	£ 11.988	0	(110)	(110)	(0,01)
BRC	07.2021	£ 67	£ 94	1	0	1	0,00
GLM	07.2021	\$ 9.949	£ 7.037	0	(227)	(227)	(0,03)
HUS	07.2021	£ 13.795	\$ 19.093	37	0	37	0,01
	07.2021	\$ 2.188	£ 1.549	0	(48)	(48)	(0,01)
	08.2021	19.080	13.785	0	(36)	(36)	0,00
MYI	07.2021	£ 17	\$ 24	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 57	£ 40	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07.2021	6.672	4.740	0	(124)	(124)	(0,02)
SCX	07.2021	£ 6	\$ 9	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 9.995	£ 7.031	0	(282)	(282)	(0,04)
SSB	07.2021	£ 13.785	\$ 19.049	7	0	7	0,00
	07.2021	\$ 6	£ 4	0	0	0	0,00
	08.2021	19.051	13.785	0	(6)	(6)	0,00
UAG	07.2021	9.971	7.037	0	(249)	(249)	(0,03)
				\$ 48	\$ (1.083)	\$ (1.035)	(0,13)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	NOK 147.820	\$ 17.242	\$ 63	\$ 0	\$ 63	0,01
	08.2021	\$ 17.244	NOK 147.820	0	(64)	(64)	(0,01)
CBK	07.2021	16.815	140.455	0	(493)	(493)	(0,06)
GLM	07.2021	16.467	137.975	0	(433)	(433)	(0,06)
MYI	07.2021	16.948	141.326	0	(525)	(525)	(0,07)
SCX	07.2021	4	35	0	0	0	0,00
				\$ 63	\$ (1.515)	\$ (1.452)	(0,19)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (13.827) (1,82)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 1.400	\$ (1.411)	(0,18)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (1.411)	(0,18)
Summe Anlagen		\$ 756.378	99,61
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 2.927	0,39
Nettovermögen		\$ 759.305	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG 1,447 % fällig am 01.04.2025	30.03.2021	\$ 1.600	\$ 1.610	0,07
Deutsche Bank AG 2,129 % fällig am 24.11.2026	17.11.2020	500	508	0,21
Nissan Canada, Inc. 3,150 % fällig am 14.09.2021	05.06.2020	149	162	0,02
Oracle Corp. 1,650 % fällig am 25.03.2026	22.03.2021	1.899	1.927	0,25
Stearns Holdings LLC 'B'	15.03.2021	77	63	0,01
Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 30.12.2021	11.01.2021	400	400	0,05
		\$ 4.625	\$ 4.670	0,61

(h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.182 als Sicherheiten verpfändet.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.910 und Barmittel in Höhe von USD 8.660 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 7.385 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 688.543	\$ 88	\$ 688.631
Investmentfonds	75.038	0	0	75.038
Pensionsgeschäfte	0	8.200	0	8.200
Finanzderivate ⁽³⁾	13	(14.093)	0	(14.080)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(1.411)	0	(1.411)
Summen	\$ 75.051	\$ 681.239	\$ 88	\$ 756.378

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 622.581	\$ 700	\$ 623.281
Investmentfonds	43.112	0	0	43.112
Pensionsgeschäfte	0	2.680	0	2.680
Finanzderivate ⁽³⁾	65	8.575	0	8.640
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(2.489)	0	(2.489)
Summen	\$ 43.177	\$ 631.347	\$ 700	\$ 675.224

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	(0,050) %	30.06.2021	07.07.2021	\$ (3.184)	\$ (3.184)	(0,42)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (3.184)	(0,42)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 119	\$ 0	\$ 119
BPS	(4.860)	4.240	(620)
BRC	21	0	21
CBK	(507)	320	(187)
DUB	(5)	(10)	(15)
FAR	(4)	0	(4)
FBF	(10)	0	(10)
GLM	(384)	311	(73)
GST	117	0	117
HUS	(1.402)	1.183	(219)
JPM	111	(280)	(169)
MYC	0	(110)	(110)
MYI	(556)	365	(191)
RBC	(124)	0	(124)
SAL	(66)	0	(66)
SCX	(991)	731	(260)
SSB	1	0	1
TOR	(5.039)	4.420	(619)
UAG	(248)	0	(248)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	64,22	61,59
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	26,13	36,47
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,34	0,48
Investmentfonds	9,88	6,82
Pensionsgeschäfte	1,08	0,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,02)	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,82)	1,34
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,18)	(0,39)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,42)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,64	0,39
Unternehmensanleihen und Wechsel	70,32	77,63
Kommunalanleihen und Wechsel	0,16	0,19
US-Regierungsbehörden	2,49	7,50
US-Schatzobligationen	2,82	5,85
Non-Agency-MBS	0,10	0,14
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,12	0,19
Staatsemissionen	2,86	4,30
Stammaktien	0,01	k. A.
Optionsscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	11,17	2,35
Investmentfonds	9,88	6,82
Pensionsgeschäfte	1,08	0,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,02)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	(0,04)	0,03
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	0,02
Devisenterminkontrakte	0,65	(0,54)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,48)	1,87
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,18)	(0,39)
Sonstige Aktiva und Passiva	0,39	(6,75)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG											
Altice France S.A. 4,155 % fällig am 14.08.2026	\$ 195	\$ 195	0,02	Whatabrands LLC 2,832 % fällig am 31.07.2026	\$ 15	\$ 15	0,00	3,961 % fällig am 26.11.2025	\$ 480	\$ 519	0,05
Banijay Entertainment S.A.S. 3,836 % fällig am 01.03.2025	14	14	0,00	Windstream Services LLC 7,250 % fällig am 21.09.2027	3	3	0,00	4,250 % fällig am 14.10.2021	1.600	1.617	0,15
Bausch Health Cos., Inc. 2,854 % fällig am 27.11.2025	1.380	1.371	0,13				74.597	6,94			
Caesars Resort Collection LLC 2,854 % fällig am 23.12.2024	3.178	3.154	0,29	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
4,604 % fällig am 21.07.2025	1.985	1.994	0,19	BANKEN UND FINANZEN							
CommScope, Inc. 3,346 % fällig am 06.04.2026	98	98	0,01	ADLER Group S.A. 2,250 % fällig am 27.04.2027	€ 8.300	9.724	0,90	Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust 5,250 % fällig am 30.05.2025	123	124	0,01
Diamond Resorts Corp. 4,750 % fällig am 02.09.2023	294	294	0,03	AerCap Ireland Capital DAC 3,500 % fällig am 26.05.2022	\$ 228	234	0,02	Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust 5,125 % fällig am 30.11.2024	64	64	0,01
Emerald TopCo, Inc. 3,604 % - 3,686 % fällig am 24.07.2026	74	74	0,01	4,625 % fällig am 01.07.2022	700	728	0,07	EPR Properties 4,750 % fällig am 15.12.2026	8	9	0,00
Envision Healthcare Corp. 3,854 % fällig am 10.10.2025	407	350	0,03	Ambac LSNi LLC 6,000 % fällig am 12.02.2023	641	642	0,06	4,950 % fällig am 15.04.2028	34	37	0,00
Forest City Enterprises LP 3,604 % fällig am 08.12.2025	908	888	0,08	Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	400	479	0,04	Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % fällig am 29.04.2030	411	472	0,04
iHeartCommunications, Inc. 3,104 % fällig am 01.05.2026	4.907	4.872	0,45	Atrium European Real Estate Ltd. 3,000 % fällig am 11.09.2025	€ 1.000	1.286	0,12	Ford Motor Credit Co. LLC 1,068 % fällig am 12.10.2021	500	499	0,05
4,750 % fällig am 01.05.2026	2.475	2.477	0,23	Atrium Finance Issuer BV 2,625 % fällig am 05.09.2027	3.900	5.005	0,47	1,391 % fällig am 15.02.2023	200	199	0,02
INEOS Finance PLC 2,500 % fällig am 01.04.2024	€ 7.181	8.480	0,79	Aviation Capital Group LLC 2,875 % fällig am 20.01.2022	\$ 96	97	0,01	1,744 % fällig am 19.07.2024	€ 100	121	0,01
Intelsat Jackson Holdings S.A. 3,600 % - 6,500 % fällig am 13.07.2022	\$ 444	449	0,04	3,875 % fällig am 01.05.2023	670	702	0,07	2,748 % fällig am 14.06.2024	€ 200	281	0,03
8,000 % fällig am 27.11.2023	7.680	7.802	0,73	Avolon Holdings Funding Ltd. 3,250 % fällig am 15.02.2027	36	37	0,00	3,021 % fällig am 06.03.2024	€ 200	249	0,02
Lealand Finance Company B.V. 3,096 % fällig am 30.06.2024	8	5	0,00	5,125 % fällig am 01.10.2023	346	374	0,03	3,087 % fällig am 09.01.2023	\$ 400	409	0,04
Lealand Finance Company B.V. (1,093 % bar oder 3,000 % PIK)				5,500 % fällig am 15.01.2023	1.077	1.144	0,11	3,250 % fällig am 15.09.2025	€ 100	127	0,01
1,093 % - 3,000 % fällig am 30.06.2025 (b)	23	10	0,00	Banca Carige SpA 1,161 % fällig am 25.10.2021	€ 1.600	1.903	0,18	3,339 % fällig am 28.03.2022	\$ 2.000	2.035	0,19
Nascar Holdings, Inc. 2,854 % fällig am 19.10.2026	96	96	0,01	Banco Bradesco S.A. 2,850 % fällig am 27.01.2023	\$ 200	205	0,02	3,370 % fällig am 17.11.2023	500	519	0,05
Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 3,089 % fällig am 30.06.2025	1.002	1.002	0,09	Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % fällig am 10.01.2025	200	210	0,02	3,375 % fällig am 13.11.2025	3.000	3.115	0,29
Parexel International Corp. 2,845 % fällig am 27.09.2024	7.586	7.550	0,70	Banco de Credito del Peru 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 600	162	0,02	3,550 % fällig am 07.10.2021	5.104	5.149	0,48
Petco Health & Wellness Co., Inc. 4,000 % fällig am 03.03.2028	5.017	5.015	0,47	Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025	€ 669	939	0,09	3,813 % fällig am 12.10.2021	800	830	0,08
PetSmart, Inc. 4,500 % fällig am 12.02.2028	3.900	3.907	0,36	(g)(i)				4,535 % fällig am 06.03.2025	€ 2.100	3.115	0,29
PUG LLC 3,604 % fällig am 12.02.2027	30	29	0,00	Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022	\$ 3.452	3.766	0,35	5,125 % fällig am 16.06.2025	\$ 1.700	1.874	0,17
Sequa Mezzanine Holdings LLC 7,750 % fällig am 28.11.2023	1.956	1.972	0,18	(i)				5,584 % fällig am 18.03.2024	400	439	0,04
10,000 % fällig am 23.07.2025	2.860	2.774	0,26	Barclays PLC 6,125 % fällig am 15.12.2025	2.011	2.231	0,21	5,596 % fällig am 07.01.2022	1.300	1.328	0,12
Sinclair Television Group, Inc. 2,610 % fällig am 30.09.2026	0	0	0,00	(g)(i)				Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 6,500 % fällig am 01.10.2025	229	238	0,02
SkyMiles IP Ltd. 4,750 % fällig am 20.10.2027	3.307	3.497	0,33	6,375 % fällig am 15.12.2025	€ 650	1.007	0,09	GLP Capital LP 5,300 % fällig am 15.01.2029	88	103	0,01
Sotera Health Holdings LLC 3,250 % fällig am 11.12.2026	121	121	0,01	(g)(i)				Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 5,800 % fällig am 21.02.2022	1.140	1.165	0,11
Sunshine Luxembourg SARL 4,500 % fällig am 01.10.2026	429	431	0,04	7,250 % fällig am 15.03.2023	200	299	0,03	Horse Gallop Finance Ltd. 3,250 % fällig am 30.05.2022	400	407	0,04
Syniverse Holdings, Inc. 6,000 % fällig am 09.03.2023	92	91	0,01	(g)(i)				Host Hotels & Resorts LP 3,500 % fällig am 15.09.2030	731	768	0,07
TransDigm, Inc. 2,354 % fällig am 09.12.2025	4.489	4.427	0,41	7,750 % fällig am 15.09.2023	\$ 800	881	0,08	HSBC Holdings PLC 2,848 % fällig am 04.06.2031	5.900	6.130	0,57
U.S. Renal Care, Inc. 5,125 % fällig am 26.06.2026	68	68	0,01	(g)(i)				4,950 % fällig am 31.03.2030	1.320	1.595	0,15
Uber Technologies, Inc. 3,604 % fällig am 04.04.2025	5.957	5.962	0,56	7,875 % fällig am 15.09.2022	€ 400	594	0,06	IMMOFINANZ AG 2,625 % fällig am 27.01.2023	€ 200	245	0,02
Univision Communications, Inc. 2,854 % fällig am 15.03.2024	340	340	0,03	(g)(i)				ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026	\$ 900	998	0,09
VICI Properties LLC 1,841 % fällig am 20.12.2024	4.800	4.765	0,44	Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 4.400	5.175	0,48	International Lease Finance Corp. 8,625 % fällig am 15.01.2022	19	20	0,00
Westmoreland Coal Co. (15,000 % PIK)				BGC Partners, Inc. 3,750 % fällig am 01.10.2024	\$ 54	57	0,01	Kilroy Realty LP 3,050 % fällig am 15.02.2030	500	521	0,05
TBD % - 15,000 % fällig am 15.03.2029 (b)	12	3	0,00	BOC Aviation Ltd. 1,271 % fällig am 26.09.2023	200	200	0,02	MGM Growth Properties Operating Partnership LP 4,500 % fällig am 15.01.2028	4.325	4.582	0,43
Westmoreland Mining Holdings LLC 9,250 % fällig am 15.03.2022	2	2	0,00	CBL & Associates LP 5,950 % fällig am 15.12.2026	19	11	0,00	MPT Operating Partnership LP 2,550 % fällig am 05.12.2023	€ 100	142	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
Omega Healthcare Investors, Inc. 3,625 % fällig am 01.10.2029	\$ 62	\$ 67	0,01	Boeing Co. 5,150 % fällig am 01.05.2030	\$ 1.228	\$ 1.455	0,14	8,500 % fällig am 15.10.2024 ^	\$ 4.423	\$ 2.625	0,24
OneMain Finance Corp. 5,625 % fällig am 15.03.2023	2.794	2.988	0,28	5,705 % fällig am 01.05.2040	1.014	1.308	0,12	9,750 % fällig am 15.07.2025 ^	266	155	0,01
6,125 % fällig am 15.05.2022	68	71	0,01	5,805 % fällig am 01.05.2050	664	896	0,08	Intelsat Luxembourg S.A. 7,750 % fällig am 01.06.2021 ^	3	0	0,00
6,125 % fällig am 15.03.2024	70	75	0,01	5,930 % fällig am 01.05.2060	787	1.089	0,10	IQVIA, Inc. 2,875 % fällig am 15.06.2028	€ 2.000	2.449	0,23
Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.03.2023	587	617	0,06	Bombardier, Inc. 6,000 % fällig am 15.10.2022	32	32	0,00	JDE Peet's NV 0,000 % fällig am 16.01.2026 (d)	2.900	3.420	0,32
QNB Finance Ltd. 1,256 % fällig am 12.02.2022	2.400	2.411	0,22	6,125 % fällig am 15.01.2023	3.967	4.186	0,39	0,500 % fällig am 16.01.2029	5.700	6.717	0,63
1,610 % fällig am 11.08.2021	400	401	0,04	7,500 % fällig am 01.12.2024	290	303	0,03	JetBlue Pass-Through Trust 4,000 % fällig am 15.05.2034	\$ 484	535	0,05
1,760 % fällig am 19.07.2021	200	200	0,02	7,500 % fällig am 15.03.2025	10	10	0,00	Kraft Heinz Foods Co. 3,750 % fällig am 01.04.2030	140	154	0,01
Sabra Health Care LP 3,900 % fällig am 15.10.2029	16	17	0,00	7,875 % fällig am 15.04.2027	269	279	0,03	3,875 % fällig am 15.05.2027	8.545	9.395	0,87
4,800 % fällig am 01.06.2024	18	20	0,00	Broadcom Corp. 3,875 % fällig am 15.01.2027	9	10	0,00	4,250 % fällig am 01.03.2031	1.018	1.158	0,11
Santander UK Group Holdings PLC 7,375 % fällig am 24.06.2022 (g)(i)	€ 6.248	9.127	0,85	Broadcom, Inc. 2,450 % fällig am 15.02.2031	700	688	0,06	Level 3 Financing, Inc. 3,875 % fällig am 15.11.2029	80	86	0,01
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 6,125 % fällig am 07.02.2022	\$ 3.385	3.498	0,33	3,469 % fällig am 15.04.2034	3.817	4.041	0,38	Lundin Energy Finance BV 2,000 % fällig am 15.07.2026	2.900	2.908	0,27
Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	€ 7.500	8.872	0,82	4,110 % fällig am 15.09.2028	8	9	0,00	3,100 % fällig am 15.07.2031	2.700	2.733	0,25
Sitka Holdings LLC 4,643 % fällig am 06.07.2026 (a)	\$ 642	642	0,06	4,150 % fällig am 15.11.2030	306	344	0,03	Marriott International, Inc. 4,625 % fällig am 15.06.2030	30	35	0,00
SMBC Aviation Capital Finance DAC 2,650 % fällig am 15.07.2021	200	200	0,02	4,300 % fällig am 15.11.2032	323	368	0,03	Marriott Ownership Resorts, Inc. 6,125 % fällig am 15.09.2025	58	62	0,01
Societe Generale S.A. 1,792 % fällig am 09.06.2027	5.200	5.193	0,48	5,000 % fällig am 15.04.2030	9	11	0,00	Melco Resorts Finance Ltd. 5,625 % fällig am 17.07.2027	900	942	0,09
7,375 % fällig am 04.10.2023 (g)(i)	300	328	0,03	CCO Holdings LLC 4,500 % fällig am 15.08.2030	134	140	0,01	MGM Resorts International 7,750 % fällig am 15.03.2022	1.500	1.570	0,15
State Bank of India 4,000 % fällig am 24.01.2022	2.100	2.136	0,20	4,750 % fällig am 01.03.2030	150	159	0,02	Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % fällig am 15.12.2030	€ 41	62	0,01
TP ICAP Ltd. 5,250 % fällig am 26.01.2024	€ 3.071	4.661	0,43	Centene Corp. 4,250 % fällig am 15.12.2027	56	59	0,01	Motorola Solutions, Inc. 2,300 % fällig am 15.11.2030	\$ 4.383	4.311	0,40
5,250 % fällig am 29.05.2026	100	158	0,01	Charter Communications Operating LLC 4,800 % fällig am 01.03.2050	140	161	0,02	NCL Corp. Ltd. 10,250 % fällig am 01.02.2026	300	350	0,03
UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (i)	\$ 6.470	7.147	0,66	Citrix Systems, Inc. 3,300 % fällig am 01.03.2030	56	59	0,01	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2030	€ 100	141	0,01
UBS Group AG 5,125 % fällig am 29.07.2026 (g)(i)	1.600	1.745	0,16	Clear Channel International BV 6,625 % fällig am 01.08.2025	2.050	2.161	0,20	4,875 % fällig am 15.06.2030	\$ 100	119	0,01
5,750 % fällig am 19.02.2022 (g)(i)	€ 2.420	2.963	0,28	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. 7,750 % fällig am 15.04.2028	2.274	2.385	0,22	5,375 % fällig am 15.11.2029	31	38	0,00
7,125 % fällig am 10.08.2021 (g)(i)	\$ 300	302	0,03	CommScope, Inc. 8,250 % fällig am 01.03.2027	4.900	5.243	0,49	Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % fällig am 17.03.2026	€ 4.393	5.682	0,53
Unicredit SpA 6,750 % fällig am 10.09.2021 (g)(i)	€ 200	240	0,02	Community Health Systems, Inc. 5,625 % fällig am 15.03.2027	4.210	4.500	0,42	4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 700	770	0,07
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 2.740	3.176	0,30	6,625 % fällig am 15.02.2025	2.669	2.826	0,26	NMG Holding Co., Inc. 7,125 % fällig am 01.04.2026	400	428	0,04
9,250 % fällig am 03.06.2022 (g)(i)	€ 200	254	0,02	8,000 % fällig am 15.03.2026	742	800	0,07	Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK) 11,000 % fällig am 15.02.2028 (b)	67	74	0,01
Unique Pub Finance Co. PLC 7,395 % fällig am 28.03.2024	€ 70	104	0,01	Connect Finco SARL 6,750 % fällig am 01.10.2026	50	53	0,01	NXP BV 4,300 % fällig am 18.06.2029	874	1.004	0,09
Uniti Group LP 6,500 % fällig am 15.02.2029	\$ 1.875	1.882	0,17	Corning, Inc. 5,450 % fällig am 15.11.2079	47	66	0,01	Occidental Petroleum Corp. 1,606 % fällig am 15.08.2022	183	182	0,02
7,125 % fällig am 15.12.2024	2.000	2.070	0,19	CoStar Group, Inc. 2,800 % fällig am 15.07.2030	1.300	1.323	0,12	Ortho-Clinical Diagnostics, Inc. 7,375 % fällig am 01.06.2025	10	11	0,00
7,875 % fällig am 15.02.2025	3.057	3.282	0,31	DAE Funding LLC 4,500 % fällig am 01.08.2022	119	120	0,01	Pelabuhan Indonesia Persero PT 4,500 % fällig am 02.05.2023	200	213	0,02
VICI Properties LP 3,500 % fällig am 15.02.2025	174	178	0,02	5,000 % fällig am 01.08.2024	1.235	1.271	0,12	Petroleos de Venezuela S.A. 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	220	10	0,00
3,750 % fällig am 15.02.2027	176	180	0,02	5,250 % fällig am 15.11.2021	395	398	0,04	Petroleos Mexicanos 5,350 % fällig am 12.02.2028	470	463	0,04
4,125 % fällig am 15.08.2030	206	212	0,02	Delta Air Lines, Inc. 3,625 % fällig am 15.03.2022	25	25	0,00	5,950 % fällig am 28.01.2031	4.607	4.481	0,42
4,250 % fällig am 01.12.2026	100	104	0,01	7,000 % fällig am 01.05.2025	686	801	0,08	6,490 % fällig am 23.01.2027	60	63	0,01
4,625 % fällig am 01.12.2029	100	106	0,01	Diamond Resorts International, Inc. 7,750 % fällig am 01.09.2023	266	274	0,03	6,500 % fällig am 23.01.2029	554	571	0,05
Volkswagen Financial Services NV 1,875 % fällig am 07.09.2021	€ 100	138	0,01	Dufry One BV 3,625 % fällig am 15.04.2026	CHF 4.753	5.181	0,48	6,840 % fällig am 23.01.2030	520	537	0,05
				Expedia Group, Inc. 6,250 % fällig am 01.05.2025	\$ 1.432	1.667	0,16	6,950 % fällig am 28.01.2060	280	248	0,02
		191.340	17,79	Gap, Inc. 8,625 % fällig am 15.05.2025	535	588	0,06	7,690 % fällig am 23.01.2050	90	87	0,01
				8,875 % fällig am 15.05.2027	273	317	0,03	Prime Healthcare Services, Inc. 7,250 % fällig am 01.11.2025	2.200	2.385	0,22
INDUSTRIEWERTE				General Electric Co. 6,875 % fällig am 10.01.2039	4	6	0,00	PTC, Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2025	27	28	0,00
AA Bond Co. Ltd. 2,875 % fällig am 31.07.2043	2.483	3.447	0,32	Heathrow Funding Ltd. 4,875 % fällig am 15.07.2023	490	491	0,05	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,750 % fällig am 01.12.2026	3.400	3.669	0,34
5,500 % fällig am 31.07.2050	597	914	0,09	Hewlett Packard Enterprise Co. 0,914 % fällig am 05.10.2021	1.200	1.200	0,11	Rolls-Royce PLC 0,875 % fällig am 09.05.2024	€ 500	585	0,05
Airbus SE 2,375 % fällig am 09.06.2040	€ 200	276	0,03	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2032	500	494	0,05	Royal Caribbean Cruises Ltd. 10,875 % fällig am 01.06.2023	\$ 339	386	0,04
Altiace France S.A. 8,125 % fällig am 01.02.2027	\$ 3.400	3.709	0,35	3,750 % fällig am 01.05.2029	8.800	8.900	0,83	11,500 % fällig am 01.06.2025	522	602	0,06
American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	5.098	5.404	0,50	Hyatt Hotels Corp. 3,135 % fällig am 01.09.2022	1.000	1.004	0,09	Sands China Ltd. 3,800 % fällig am 08.01.2026	1.800	1.929	0,18
B.C. Unlimited Liability Co. 4,375 % fällig am 15.01.2028	18	18	0,00	Intelsat Connect Finance S.A. 9,500 % fällig am 15.02.2023 ^	100	33	0,00				
Barry Callebaut Services NV 5,500 % fällig am 15.06.2023	600	652	0,06	Intelsat Jackson Holdings S.A. 8,000 % fällig am 15.02.2024	249	258	0,02				
Bausch Health Cos., Inc. 6,125 % fällig am 15.04.2025	300	308	0,03								

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT	% DES VERMÖGENS
Residential Accredit Loans, Inc. Trust 0,342 % fällig am 25.08.2037	\$ 589	\$ 560	0,05	
Residential Asset Securitization Trust 6,609 % fällig am 25.02.2037	11.739	5.567	0,52	
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 6,250 % fällig am 25.08.2036	1.377	1.358	0,13	
RESIMAC Bastille Trust 1,010 % fällig am 05.09.2057	212	212	0,02	
RMAC PLC 0,784 % fällig am 12.06.2046	£ 6.458	8.933	0,83	
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 2,724 % fällig am 25.09.2034	\$ 316	330	0,03	
Taurus FR DAC 0,900 % fällig am 02.02.2031	€ 1.764	2.092	0,19	
TBW Mortgage-Backed Trust 5,965 % fällig am 25.07.2037	\$ 131	64	0,01	
Tharaldson Hotel Portfolio Trust 0,980 % fällig am 11.11.2034	227	227	0,02	
Thornburg Mortgage Securities Trust 2,037 % fällig am 25.12.2042	115	117	0,01	
Towd Point Mortgage Funding PLC 0,881 % fällig am 20.02.2045	£ 2.601	3.601	0,33	
0,949 % fällig am 20.07.2045	1.725	2.392	0,22	
1,111 % fällig am 20.10.2051	5.073	7.046	0,65	
1,249 % fällig am 20.02.2054	2.679	3.725	0,35	
Trinidad Mortgage Securities PLC 0,888 % fällig am 24.01.2059	24	34	0,00	
Twin Bridges PLC 0,964 % fällig am 12.09.2050	2.891	4.016	0,37	
Verus Securitization Trust 1,977 % fällig am 25.03.2060	\$ 547	555	0,05	
3,035 % fällig am 25.03.2060	100	103	0,01	
3,889 % fällig am 25.03.2060	200	209	0,02	
Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust 5,438 % fällig am 15.11.2048	17	17	0,00	
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,852 % fällig am 25.01.2045	154	154	0,01	
3,000 % fällig am 25.02.2037 ^	1.029	1.035	0,10	
		129.797	12,07	

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

ACA ABS Ltd. 1,126 % fällig am 01.08.2037	357	356	0,03	
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,532 % fällig am 25.05.2037	8.848	2.199	0,21	
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates 2,042 % fällig am 25.06.2034	510	533	0,05	
AlbaCore EURO CLO DAC 1,530 % fällig am 18.07.2031	€ 3.830	4.557	0,42	
Amortizing Residential Collateral Trust 0,792 % fällig am 25.10.2031	\$ 252	247	0,02	
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 0,857 % fällig am 25.10.2035	100	98	0,01	
Bayview Financial Asset Trust 1,592 % fällig am 25.03.2037	570	567	0,05	
Carrington Mortgage Loan Trust 1,082 % fällig am 25.06.2035	5.000	4.988	0,46	
College Avenue Student Loans LLC 1,292 % fällig am 26.12.2047	31	31	0,00	
4,130 % fällig am 26.12.2047	31	33	0,00	
Countrywide Asset-Backed Certificates 0,232 % fällig am 25.06.2047	2.614	2.446	0,23	
0,302 % fällig am 25.05.2047 ^	8.509	8.180	0,76	
1,292 % fällig am 25.10.2035	2.093	2.078	0,19	
Fieldstone Mortgage Investment Trust 1,217 % fällig am 25.03.2035	23	23	0,00	
GSAA Home Equity Trust 0,472 % fällig am 25.03.2036	2.768	1.380	0,13	
Harvest SBA Loan Trust 2,342 % fällig am 25.08.2044	523	509	0,05	
Hayfin Emerald CLO DAC 1,450 % fällig am 15.02.2033	€ 7.200	8.556	0,80	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT	% DES VERMÖGENS
HSI Asset Securitization Corp. Trust 0,282 % fällig am 25.01.2037	\$ 3.456	\$ 2.955	0,28	
IXIS Real Estate Capital Trust 0,322 % fällig am 25.01.2037	3.716	1.885	0,18	
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,352 % fällig am 25.06.2037	2.178	2.165	0,20	
Lehman XS Trust 6,500 % fällig am 25.06.2046	65	65	0,01	
Long Beach Mortgage Loan Trust 0,372 % fällig am 25.06.2036	680	655	0,06	
0,692 % fällig am 25.01.2036	3.961	3.775	0,35	
LP Credit Card ABS Master Trust 1,661 % fällig am 20.08.2024	157	157	0,02	
Man GLG Euro CLO DAC 0,740 % fällig am 15.10.2030	€ 3.000	3.552	0,33	
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 0,232 % fällig am 25.05.2037	\$ 5.077	3.262	0,30	
0,242 % fällig am 25.08.2037	541	527	0,05	
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,292 % fällig am 25.05.2037	1.183	850	0,08	
0,392 % fällig am 25.06.2036	2.268	2.062	0,19	
1,007 % fällig am 25.03.2035	656	657	0,06	
1,517 % fällig am 25.01.2035	1.330	1.230	0,12	
OAK Hill European Credit Partners DAC 0,730 % fällig am 20.01.2032	€ 2.800	3.323	0,31	
Option One Mortgage Loan Trust 1,517 % fällig am 25.11.2034	\$ 1.111	1.118	0,10	
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,667 % fällig am 25.02.2035	12.312	12.427	1,16	
Residential Asset Mortgage Products Trust 1,172 % fällig am 25.03.2035	2.000	1.973	0,18	
SoFi Professional Loan Program LLC 0,942 % fällig am 25.07.2039	525	526	0,05	
2,630 % fällig am 25.07.2040	1.455	1.477	0,14	
Starwood Commercial Mortgage Trust 1,204 % fällig am 15.07.2038	10.000	10.004	0,93	
Structured Asset Investment Loan Trust 0,812 % fällig am 25.01.2036	756	757	0,07	
1,092 % fällig am 25.09.2034	642	644	0,06	
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 0,322 % fällig am 25.05.2047	346	339	0,03	
1,067 % fällig am 25.05.2035	3.900	3.876	0,36	
Terwin Mortgage Trust 1,472 % fällig am 25.03.2035	710	682	0,06	
Towd Point Mortgage Trust 4,750 % fällig am 25.10.2058	9.300	9.429	0,88	
Tralee CLO Ltd. 1,298 % fällig am 20.10.2028	246	246	0,02	
Vendome Funding CLO DAC 1,860 % fällig am 20.07.2031	€ 6.649	7.893	0,73	
		115.292	10,72	

STAATSEMISSIONEN

Argentina Government International Bond 0,125 % fällig am 09.07.2030	\$ 2.796	980	0,09	
0,125 % fällig am 09.07.2035	1.732	537	0,05	
0,125 % fällig am 09.07.2041	3.129	1.120	0,10	
1,000 % fällig am 09.07.2029	120	46	0,00	
15,500 % fällig am 17.10.2026	ARS 1.188	3	0,00	
34,069 % fällig am 04.10.2022	460	2	0,00	
36,104 % fällig am 03.04.2022	7.100	41	0,00	
Australia Government International Bond 1,750 % fällig am 21.06.2051	AUD 2.500	1.660	0,15	
Autonomous City of Buenos Aires Argentina 37,374 % fällig am 29.03.2024	ARS 610	3	0,00	
China Development Bank 2,890 % fällig am 22.06.2025	CNY 8.700	1.331	0,12	
3,300 % fällig am 01.02.2024	1.200	187	0,02	
3,430 % fällig am 14.01.2027	1.500	233	0,02	
3,680 % fällig am 26.02.2026	4.500	708	0,07	
3,740 % fällig am 10.09.2025	7.100	1.120	0,10	
4,150 % fällig am 26.10.2025	7.000	1.122	0,10	
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,875 % fällig am 16.04.2050	\$ 600	693	0,06	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-WERT	% DES VERMÖGENS
Guatemala Government International Bond 6,125 % fällig am 01.06.2050	\$ 200	\$ 245	0,02	
Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	800	913	0,09	
4,500 % fällig am 03.04.2120	200	253	0,02	
Peru Government International Bond 5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN 1.489	345	0,03	
5,400 % fällig am 12.08.2034	12	3	0,00	
5,940 % fällig am 12.02.2029	5.706	1.631	0,15	
6,150 % fällig am 12.08.2032	6.322	1.700	0,16	
6,350 % fällig am 12.08.2028	1.711	500	0,05	
6,950 % fällig am 12.08.2031	382	112	0,01	
8,200 % fällig am 12.08.2026	2.513	816	0,08	
Provincia de Buenos Aires 37,854 % fällig am 12.04.2025	ARS 6.240	32	0,00	
37,954 % fällig am 31.05.2022	48.490	273	0,03	
Qatar Government International Bond 4,400 % fällig am 16.04.2050	\$ 400	488	0,05	
Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033	€ 4.100	4.834	0,45	
Russia Government International Bond 7,150 % fällig am 12.11.2025	RUB 19.414	269	0,03	
7,950 % fällig am 07.10.2026	13.158	188	0,02	
Serbia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.05.2027	€ 196	259	0,02	
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR 5.500	365	0,03	
8,250 % fällig am 31.03.2032	7.600	486	0,05	
8,750 % fällig am 28.02.2048	2.000	119	0,01	
8,875 % fällig am 28.02.2035	5.500	350	0,03	
10,500 % fällig am 21.12.2026	204.800	16.301	1,52	
Turkey Government International Bond 4,250 % fällig am 13.03.2025	\$ 1.200	1.180	0,11	
4,625 % fällig am 31.03.2025	€ 500	618	0,06	
5,250 % fällig am 13.03.2030	\$ 1.000	952	0,09	
5,600 % fällig am 14.11.2024	900	927	0,09	
5,750 % fällig am 22.03.2024	200	208	0,02	
5,750 % fällig am 11.05.2047	741	635	0,06	
Venezuela Government International Bond 8,250 % fällig am 13.10.2024	^ 2.000	211	0,02	
9,000 % fällig am 07.05.2023	^ 1.600	163	0,02	
		45.162	4,20	

AKTIEN

STAMMAKTIEN

KOMMUNIKATIONSDIENSTE

Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)	173.174	457	0,04
iHeartMedia, Inc. 'A' (c)	41.444	1.116	0,11
iHeartMedia, Inc. 'B' (c)	32.182	780	0,07
		2.353	0,22

BASISKONSUMGÜTER

Neiman Marcus Group Ltd. LLC (c)(j)	5.145	569	0,05
-------------------------------------	-------	-----	------

ENERGIE

Noble Corp. (c)	2.086	51	0,01
Noble Corp. (c)(j)	23.082	571	0,05
Valaris Ltd. (c)	1.580	46	0,00
		668	0,06

INDUSTRIEWERTE

Westmoreland Mining Holdings LLC (c)(j)	231	0	0,00
		3.590	0,33

OPTIONSSCHEINE

Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21. September 2055	361	8	0,00
---	-----	---	------

REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS

Uniti Group, Inc.	284	3	0,00
-------------------	-----	---	------

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖG ENS
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE								INVESTMENTFONDS			
ARGENTINA TREASURY BILLS								ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
(3,480) % fällig am				0,022 % fällig am	\$ 2.700	2.700	0,25				
13.09.2021 (d)(e)	ARS	115.853	\$ 685	0,023 % fällig am							
40,499 % fällig am				28.09.2021 (d)(e)	11.800	11.799	1,10	PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
29.10.2021 (d)(e)		35.552	187	0,025 % fällig am				US Dollar Short-Term			
			0,02	12.11.2021 (d)(e)(k)	5.100	5.099	0,47	Floating NAV Fund (h)			
			0,08	0,027 % fällig am							
				26.08.2021 (d)(e)	3.600	3.599	0,33	Summe Investmentfonds			
				0,053 % fällig am						\$ 63.473	5,90
				26.08.2021 (d)(e)	11.700	11.699	1,09				
				0,057 % fällig am							
				26.08.2021 (d)(e)	27.500	27.498	2,56				
				0,061 % fällig am							
				02.09.2021 (d)(e)(k)	2.500	2.500	0,23				
						119.191	11,08				
				Summe kurzfristige Instrumente		120.063	11,16				
				Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 1.266.296	117,74				

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	84	\$ 164	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	71	(94)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2021	81	19	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	1.004	(735)	(0,07)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	26	(127)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	93	(857)	(0,08)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	2	(3)	0,00
				\$ (1.633)	(0,15)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (1.633)	(0,15)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Group Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 7.600	\$ 298	0,03
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2025	\$ 700	32	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	2.500	16	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	4.700	16	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2021	1.600	2	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2022	1.600	9	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	1.300	3	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	€ 1.700	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	\$ 400	34	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	6.500	37	0,01
MGM Resorts International	5,000	20.06.2026	600	2	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	€ 4.500	216	0,02
				\$ 672	0,06

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000 %	20.06.2024	\$ 752	\$ 28	0,00
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	558	23	0,00
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	1.800	19	0,00
CDX.HY-34 5-Year Index	5,000	20.06.2025	368	24	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000	20.12.2025	5.500	64	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	47.900	499	0,05
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 6.800	44	0,01
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	8.000	12	0,00
				\$ 713	0,07

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽¹⁾		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2051	£ 800	\$ (28)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	3,700	03.01.2022	BRL 625.500	(760)	(0,07)
Zahlung		1-Year BRL-CDI	3,978	03.01.2022	33.300	(36)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	4,040	03.01.2022	300	0	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	5,830	02.01.2023	5.100	25	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	5,836	02.01.2023	4.600	22	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	5,855	02.01.2023	1.500	7	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	\$ 32.600	211	0,02
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	56.300	(271)	(0,03)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	9.375	21	0,00
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	76.933	2.074	0,19
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,928	06.05.2026	2.200	2	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,940	08.06.2026	2.900	1	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,000	17.06.2022	2.700	(53)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	20.713	1.338	0,12
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,030	17.06.2026	3.600	(14)	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,235	12.05.2028	1.100	(1)	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	4.400	(172)	(0,02)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050	12.600	444	0,04
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	8.700	(261)	(0,02)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,317	16.12.2050	400	(35)	0,00
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,438	22.01.2051	9.000	(610)	(0,06)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2021	500	(5)	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	1.200	(52)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,500	17.06.2050	7.700	1.634	0,15
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,580	13.01.2051	9.300	(361)	(0,03)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,625	06.01.2030	300	(4)	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,750	15.01.2030	4.600	(129)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,910	17.10.2049	400	(4)	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,000	10.12.2029	21.000	(895)	(0,08)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,000	12.02.2030	2.500	(107)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,000	10.03.2030	1.200	(70)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,250	12.03.2050	15.700	(1.874)	(0,17)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,543	05.02.2024	1.000	(64)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,550	05.02.2024	1.000	(64)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,559	05.02.2024	1.000	(64)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,571	05.02.2024	500	(32)	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,580	05.02.2024	1.500	(97)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,605	05.02.2024	1.500	(98)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,607	05.02.2024	500	(33)	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,750	19.12.2023	19.100	(1.286)	(0,12)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2024	24.000	(1.003)	(0,09)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2026	12.700	(808)	(0,08)
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	4,848	11.01.2026	ZAR 18.700	(44)	0,00
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	4,850	07.01.2026	5.200	(13)	0,00
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	4,915	01.02.2026	12.600	(29)	0,00
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	5,970	10.03.2026	300	0	0,00
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	AUD 12.400	847	0,08
Erhalt ⁽¹⁾		6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	14.100	(25)	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	2.500	42	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,294	30.06.2026	100	0	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	200	1	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	300	1	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	200	1	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024	300	0	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050	600	14	0,00
Erhalt		6-Month JPY-LIBOR	0,000	15.03.2029	¥ 3.763.000	54	0,01
Zahlung		28-Day MXN-TIE	4,470	27.02.2023	MXN 46.600	(55)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIE	4,500	03.03.2023	297.900	(345)	(0,03)
Zahlung		28-Day MXN-TIE	4,520	27.02.2023	93.200	(106)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIE	4,550	27.02.2023	394.100	(446)	(0,04)
Zahlung		28-Day MXN-TIE	4,560	27.02.2023	45.700	(51)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIE	4,565	27.02.2023	46.600	(51)	0,00
						\$ (3.717)	(0,35)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (2.332)	(0,22)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,641	07.07.2021	5.500	\$ 30	\$ 1	0,00

VERKAUFSoPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000 %	20.10.2021	800	\$ (4)	\$ (2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	2.900	(3)	0	0,00
BPS	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	2.900	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.600	(2)	(1)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	3.000	(3)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	3.200	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	3.000	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.400	(2)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	3.700	(4)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	7.100	(8)	(4)	0,00
CBK	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	1.000	(4)	(3)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	3.300	(4)	(1)	0,00
DUB	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	10.800	(11)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	5.000	(6)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	2.900	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	3.600	(4)	(3)	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	3.400	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	6.900	(7)	(4)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	6.700	(7)	(4)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	3.100	(4)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	3.000	(3)	0	0,00
MYC	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	7.600	(18)	(2)	0,00
						\$ (110)	\$ (34)	0,00

DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call – OTC USD versus CAD	CAD 1,265	11.02.2022	2.629	\$ (26)	\$ (32)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015 %	14.07.2021	2.000	\$ (9)	\$ (9)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	14.07.2021	2.000	(9)	0	0,00
BPS	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	16.07.2021	1.400	(3)	(2)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	16.07.2021	1.400	(3)	(1)	0,00
MYC	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	4.000	(30)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	15.07.2021	900	(2)	(2)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	15.07.2021	900	(2)	(1)	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	10.08.2021	1.100	(15)	(25)	(0,01)
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	10.08.2021	1.100	(15)	(1)	0,00
							\$ (88)	\$ (41)	(0,01)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,609	07.07.2021	4.000	\$ (17)	\$ (1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,672	07.07.2021	1.500	(7)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,203	07.07.2021	4.000	(15)	(7)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,227	07.07.2021	500	(3)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,422	07.07.2021	1.500	(6)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,641	07.07.2021	1.000	(3)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,645	07.07.2021	1.100	(4)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,188	05.08.2021	1.000	(3)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,406	05.08.2021	5.000	(22)	(9)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,688	05.08.2021	2.500	(8)	(6)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,188	05.08.2021	1.000	(2)	(4)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,406	05.08.2021	5.000	(11)	(13)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,281	07.09.2021	2.250	(11)	(9)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,281	07.09.2021	4.000	(11)	(17)	(0,01)
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,297	07.09.2021	1.500	(5)	(6)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,328	07.09.2021	1.000	(3)	(4)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	\$ 102,164	07.07.2021	1.500	\$ (6)	\$ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,703	05.08.2021	1.000	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,078	05.08.2021	1.000	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,102	05.08.2021	500	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	101,844	07.09.2021	700	(2)	(2)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	103,844	07.09.2021	700	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,258	05.08.2021	1.000	(3)	(2)	0,00
					\$ (151)	\$ (88)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2023	\$ 100	\$ (6)	\$ 7	\$ 1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.800	(100)	107	7	0,00
BPS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(2)	3	1	0,00
CBK	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(2)	4	2	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2025	5.500	38	25	63	0,01
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.700	(86)	93	7	0,00
GST	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(11)	5	(6)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	300	(9)	10	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	600	(18)	18	0	0,00
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	300	(2)	6	4	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(3)	4	1	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(16)	9	(7)	0,00
					\$ (217)	\$ 291	\$ 74	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500 %	16.12.2072	\$ 12.700	\$ 16	\$ 66	\$ 82	0,01
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	15.300	(74)	213	139	0,01
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	25.375	(78)	342	264	0,03
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	25.375	(193)	454	261	0,02
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	(2)	5	3	0,00
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	19.300	79	46	125	0,01
					\$ (252)	\$ 1.126	\$ 874	0,08

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
AZD	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,445 %	17.06.2025	CNY 9.500	\$ 0	\$ (15)	\$ (15)	0,00
CBK	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,845	23.01.2025	2.000	0	2	2	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,850	23.01.2025	2.400	0	2	2	0,00
						\$ 0	\$ (11)	\$ (11)	0,00

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 400	20.09.2021	\$ 0	\$ 8	\$ 8	0,00

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	MXN	7.909	\$	400	\$	4	0,00
	07.2021	PEN	51		13		(1)	0,00
	07.2021	TRY	1.195		139		2	0,00
	07.2021	\$	6.060	BRL	32.173		352	0,03
	07.2021		31	PEN	119		0	0,00
	07.2021		72	TRY	609		(2)	0,00
	08.2021	AUD	2.145	\$	1.661		51	0,01
	08.2021	\$	10.071	€	8.400		(101)	(0,01)
	08.2021		13	PEN	51		1	0,00
	08.2021		595	RUB	44.723		13	0,00
	09.2021		3.557	IDR	51.271.717		(62)	(0,01)
	09.2021		1.178	RUB	85.936		(14)	0,00
	02.2022	ZAR	48.801	\$	3.319		5	0,00
BPS	07.2021	TRY	3.579		417		7	0,00
	07.2021	\$	680	TRY	5.727		(23)	0,00
	08.2021	PEN	1.891	\$	512		17	0,00
	08.2021	\$	2.610	£	1.867		(31)	0,00
	09.2021	ZAR	36.561	\$	2.583		47	0,01
	11.2021	MXN	6.891		341		1	0,00
BRC	07.2021		5.725		285		(2)	0,00
	07.2021	TRY	600		70		1	0,00
	08.2021	€	8.478		10.111		47	0,01
BSS	07.2021	\$	28	PEN	108		0	0,00
CBK	07.2021	CLP	699.158	\$	934		(26)	0,00
	07.2021	MXN	5.244		254		(9)	0,00
	07.2021	PEN	11.290		2.883		(70)	(0,01)
	07.2021	TRY	1.597		187		4	0,00
	07.2021	\$	977	CLP	699.158		(17)	0,00
	07.2021		6.684	PEN	25.929		(31)	0,01
	07.2021		539	RUB	41.661		29	0,00
	08.2021	PEN	7.203	\$	1.918		32	0,00
	08.2021	\$	743	PEN	2.954		31	0,00
	08.2021		736	RUB	55.293		16	0,00
	09.2021	PEN	5.164	\$	1.378		26	0,00
	09.2021	\$	1.884	CLP	1.383.152		(13)	0,00
	09.2021		610	PEN	2.374		11	0,00
	09.2021	ZAR	34.949	\$	2.551		126	0,01
	10.2021	PEN	297		80		3	0,00
	12.2021	\$	544	INR	41.274		0	0,00
	12.2021		533	PEN	1.958		(20)	0,00
	02.2022	ZAR	3.186	\$	208		(8)	0,00
GLM	07.2021	BRL	32.173		6.388		(24)	0,00
	07.2021	PEN	3.185		801		(31)	0,00
	07.2021	\$	1.082	RUB	83.511		58	0,01
	07.2021		76	TRY	636		(3)	0,00
	08.2021	€	7.603	\$	9.055		30	0,00
	08.2021	£	241		342		9	0,00
	08.2021	\$	6.368	BRL	32.173		23	0,00
	08.2021		802	PEN	3.185		32	0,00
	08.2021		1.031	RUB	77.240		19	0,00
	09.2021		1.497		109.702		(12)	0,00
	09.2021	ZAR	29.551	\$	2.139		88	0,01
	11.2021	PEN	7.636		2.037		39	0,00
	02.2022	CAD	617		511		13	0,00
HUS	07.2021	\$	458	PEN	1.775		6	0,00
	08.2021	€	11.397	\$	13.834		306	0,03
	08.2021	£	67.883		95.965		2.179	0,20
	08.2021	\$	3.140	CAD	3.809		(65)	(0,01)
	08.2021		1.137	£	803		(28)	0,00
	08.2021		1.438	RUB	108.331		35	0,00
	09.2021		4.362	MXN	91.730		210	0,02
	09.2021		152	PEN	599		5	0,00
	09.2021		618	RUB	45.247		(5)	0,00
	10.2021		7.387	MXN	155.514		332	0,03
	12.2021	PEN	278	\$	75		2	0,00
MYI	12.2021	\$	408	INR	31.410		6	0,00
	07.2021	€	55	\$	66		0	0,00
	07.2021	SGD	258		192		0	0,00
	07.2021	\$	408	£	295		(1)	0,00
	07.2021		11	PEN	44		0	0,00
	07.2021		438	RUB	33.591		20	0,00
	08.2021	€	91.857	\$	111.223		2.189	0,20
	08.2021	\$	1.938	€	1.604		(34)	0,00
	09.2021		726	ZAR	10.407		(4)	0,00
RBC	08.2021	CHF	4.700	\$	5.261		171	0,02
	08.2021	\$	1.923	£	1.383		(12)	0,00
SCX	07.2021	PEN	3.038	\$	789		(12)	0,00
	07.2021	\$	110	MXN	2.190		0	0,00
	07.2021		76	PEN	295		1	0,00
	09.2021		28	CNH	179		0	0,00
	09.2021		317	PEN	1.259		13	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	12.2021	PEN	171	\$ 46	\$ 1	\$ 0	0,00
						\$ 1	0,00
UAG	12.2021	\$	2.546	INR 191.236	0	(25)	0,01
	07.2021		1.654	RUB 126.824	78	0	(0,01)
	08.2021		3.072	NOK 25.394	0	(121)	0,00
	09.2021		609	RUB 44.702	0	(4)	0,56
					\$ 6.849	\$ (811)	\$ 6.038

ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$	161	CHF 145	\$ 0	\$ (5)	0,00
BRC	07.2021	CHF	0	\$ 0	0	0	0,00
CBK	07.2021		145		1	0	0,00
	07.2021	\$	162	CHF 145	0	(5)	0,00
	08.2021		158		0	(1)	0,00
MYI	07.2021		160		144	0	0,00
					\$ 1	\$ (15)	\$ (14)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend und Class Z EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$	4.454	€ 3.680	\$ 0	\$ (89)	(0,01)
BPS	07.2021	€	3.488	\$ 4.231	94	0	0,01
	07.2021	\$	259.787	€ 212.477	0	(7.810)	(0,73)
BRC	07.2021		12.428		10.159	(381)	(0,04)
HUS	07.2021		276		229	(5)	0,00
MYI	07.2021	€	101	\$ 121	0	0	0,00
RBC	07.2021	\$	264.478	€ 216.188	0	(8.100)	(0,75)
SCX	07.2021		277.979		227.225	(8.513)	(0,79)
					\$ 94	\$ (24.898)	\$ (24.804)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£	2.716	\$ 3.824	\$ 72	\$ 72	0,01
GLM	07.2021	\$	70.462	£ 49.842	0	(1.609)	(0,15)
HUS	07.2021	£	50.937	\$ 70.501	133	0	0,01
	08.2021	\$	70.506	£ 50.937	0	(133)	(0,01)
MYI	07.2021	£	1.899	\$ 2.634	12	0	0,00
SCX	07.2021	\$	70.805	£ 49.807	0	(1.998)	(0,19)
SSB	07.2021	£	51.242	\$ 70.823	35	0	0,00
	08.2021	\$	70.397	£ 50.937	0	(24)	0,00
UAG	07.2021		70.619		49.842	(1.765)	(0,16)
					\$ 252	\$ (5.529)	\$ (5.277)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	\$	2.542	SGD 3.363	\$ 0	\$ (40)	(0,01)
GLM	07.2021		347		462	(3)	0,00
	08.2021		53		72	0	0,00
HUS	07.2021		2.559		3.386	(40)	0,00
MEI	07.2021	SGD	4.398	\$ 3.276	4	4	0,00
	08.2021	\$	3.276	SGD 4.398	0	(4)	0,00
MYI	07.2021	SGD	4.418	\$ 3.287	0	0	0,00
	08.2021	\$	3.286	SGD 4.418	0	0	0,00
SCX	07.2021		2.289		3.034	(32)	0,00
SSB	07.2021		2.007		2.670	(21)	0,00
UAG	07.2021		163		216	(2)	0,00
					\$ 4	\$ (142)	\$ (138)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (23.444) (2,18)

Summe Anlagen

\$ 1.302.360 121,09

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (226.846) (21,09)

Nettovermögen

\$ 1.075.514 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(h) Mit dem Fonds verbunden.

(i) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(j) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	\$ 166	\$ 569	0,05
Noble Corp.	05.02.2021 - 25.02.2021	296	571	0,05
Westmoreland Mining Holdings LLC	26.03.2019	1	0	0,00
		\$ 463	\$ 1.140	0,10

(k) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 12.340 und Barmittel in Höhe von USD 13.700 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 24.124 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.190	\$ 1.259.962	\$ 4.144	\$ 1.266.296
Investmentfonds	63.473	0	0	63.473
Finanzderivate ⁽³⁾	67	(27.476)	0	(27.409)
Summen	\$ 65.730	\$ 1.232.486	\$ 4.144	\$ 1.302.360

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 416	\$ 1.257.673	\$ 6.224	\$ 1.264.313
Investmentfonds	93.313	0	0	93.313
Pensionsgeschäfte	0	27.569	0	27.569
Finanzderivate ⁽³⁾	250	6.383	0	6.633
Summen	\$ 93.979	\$ 1.291.625	\$ 6.224	\$ 1.391.828

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (15)	\$ 0	\$ (15)
BOA	151	(280)	(129)
BPS	(7.670)	6.700	(970)
BRC	(335)	302	(33)
CBK	301	(320)	(19)
DUB	(7)	0	(7)
GLM	(1.403)	1.004	(399)
GST	67	0	67
HUS	2.939	(2.480)	459
MEI	139	0	139

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
MYC	\$ 620	\$ (920)	\$ (300)
MYI	2.178	(1.757)	421
RBC	(7.941)	7.000	(941)
SAL	(87)	0	(87)
SCX	(10.557)	9.413	(1.144)
SSB	(10)	0	(10)
UAG	(1.814)	1.621	(193)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	57,15	47,16
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	55,52	79,40
Sonstige übertragbare Wertpapiere	5,07	5,06
Investmentfonds	5,90	9,71
Pensionsgeschäfte	k. A.	2,87
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,15)	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,22)	(0,92)
Freiverkehrsfinanzderivate	(2,18)	1,58

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	6,94	5,87
Unternehmensanleihen und Wechsel	42,54	40,25
Wandelanleihen & Wechsel	k. A.	0,00
US-Regierungsbehörden	25,35	46,86
US-Schatzobligationen	4,43	3,82
Non-Agency-MBS	12,07	15,69
Forderungsbesicherte Wertpapiere	10,72	14,13
Staatsemissionen	4,20	2,93
Stammaktien	0,33	0,10
Optionsscheine	0,00	0,09
Real Estate Investment Trusts	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	11,16	1,88
Investmentfonds	5,90	9,71
Pensionsgeschäfte	k. A.	2,87
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,15)	0,03
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,06	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,07	0,03
Zinsswaps	(0,35)	(0,98)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Devisenoptionen	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,02)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,08	0,08
Zinsswaps	0,00	0,00
Total Return Swaps auf Indizes	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,56	(0,57)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,81)	2,09
Sonstige Aktiva und Passiva	(21,09)	(44,89)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
KANADA											
STAMMAKTIE											
Enbridge, Inc.	74.500	\$ 2.986	3,12	Kinder Morgan, Inc.	108.100	\$ 1.971	2,06	0,028 % fällig am 05.10.2021 (b)(c)	\$ 2.300	\$ 2.300	2,40
Pembina Pipeline Corp.	29.200	929	0,97	ONEOK, Inc.	64.430	3.585	3,75	0,030 % fällig am 12.11.2021 (b)(c)	1.100	1.100	1,15
TC Energy Corp.	57.120	2.829	2,96	Ovintiv, Inc.	33.900	1.067	1,11	0,032 % fällig am 30.09.2021 (b)(c)	1.400	1.400	1,46
Summe Kanada		6.744	7,05	Rattler Midstream LP	90.100	984	1,03	0,032 % fällig am 26.11.2021 (b)(c)	1.300	1.300	1,36
USA											
STAMMAKTIE											
ENERGIE											
Cheniere Energy, Inc. (a)	41.300	3.582	3,74	Targa Resources Corp.	64.000	2.845	2,97	0,039 % fällig am 09.09.2021 (b)(c)	2.900	2.900	3,03
Chesapeake Energy Corp.	17.600	914	0,96	Williams Cos., Inc.	144.100	3.826	4,00	0,048 % fällig am 16.12.2021 (b)(c)	3.300	3.299	3,45
Cimarex Energy Co.	12.600	913	0,95	Summe USA		26.724	27,92	0,096 % fällig am 22.07.2021 (b)(c)	9.500	9.500	9,93
Diamondback Energy, Inc.	15.200	1.427	1,49								
EQT Corp. (a)	46.000	1.024	1,07								
Equitrans Midstream Corp.	196.282	1.670	1,74								
Hess Midstream LP 'A'	115.486	2.916	3,05								
				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE							
				U.S. TREASURY BILLS							
				0,008 % fällig am 14.09.2021 (b)(c)				\$ 4.400 4.399 4,60			
				0,011 % fällig am 10.08.2021 (b)(c)				4.000 4.000 4,18			
				0,015 % fällig am 20.07.2021 (b)(c)				3.500 3.500 3,66			
				0,015 % fällig am 21.09.2021 (b)(c)(e)				900 900 0,94			
				0,020 % fällig am 10.08.2021 (b)(c)				9.400 9.400 9,82			
				0,022 % fällig am 10.08.2021 (b)(c)				1.200 1.200 1,25			
				0,022 % fällig am 12.11.2021 (b)(c)				2.900 2.899 3,03			
				0,023 % fällig am 28.09.2021 (b)(c)				1.600 1.600 1,67			
				0,027 % fällig am 28.10.2021 (b)(c)				1.900 1.900 1,99			
				PARI (000S)							
								Summe kurzfristige Instrumente			
								53.296 55,69			
								Summe Übertragbare Wertpapiere			
								\$ 86,76 90,66			
								AKTIEN			
								INVESTMENTFONDS			
								ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
								PIMCO Select Funds plc – PIMCO			
								US Dollar Short-Term			
								Floating NAV Fund (d)			
								805.882 8.027 8,39			
								Summe Investmentfonds			
								\$ 8.027 8,39			

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Zahlung	AMZX Index	6.006	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 6.837	20.04.2022	\$ 0	\$ 372	\$ 372	0,39

TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens	
BOA	Zahlung	Enterprise Products Partners LP	24.300	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 614	15.09.2021	\$ 0	\$ (28)	\$ (28)	(0,03)	
	Zahlung	Enterprise Products Partners LP	202.570	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.117	15.11.2021	0	(230)	(230)	(0,24)	
	Zahlung	Genesis Energy LP	278.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.317	15.11.2021	0	(89)	(89)	(0,09)	
	Zahlung	MPLX LP	241.500	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	7.520	15.11.2021	0	(370)	(370)	(0,39)	
	Zahlung	Plains All American Pipeline LP	77.156	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	936	15.11.2021	0	(60)	(60)	(0,06)	
	Zahlung	Energy Transfer LP	373.869	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.701	18.01.2022	0	270	270	0,28	
	Zahlung	Western Midstream Partners LP	75.561	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.510	18.01.2022	0	108	108	0,11	
	Zahlung	Energy Transfer LP	343.320	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.399	13.04.2022	0	249	249	0,26	
	Zahlung	Holly Energy Partners LP	64.071	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.363	13.04.2022	0	86	86	0,09	
	Zahlung	Crestwood Equity Partners LP	30.700	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	880	16.05.2022	0	40	40	0,04	
	Zahlung	Equitrans Midstream Corp.	118.899	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	980	16.05.2022	0	32	32	0,03	
	Zahlung	Holly Energy Partners LP	41.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	872	16.05.2022	0	56	56	0,06	
	CBK	Zahlung	DCP Midstream LP	143.100	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	4.468	15.02.2022	0	(77)	(77)	(0,08)
		Zahlung	Cheniere Energy Partners LP	44.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.815	16.05.2022	0	133	133	0,14
MYI	Zahlung	Cheniere Energy Partners LP	4.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	178	15.11.2021	0	(1)	(1)	0,00	
	Zahlung	Crestwood Equity Partners LP	43.300	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	1.416	15.11.2021	0	(117)	(117)	(0,12)	
	Zahlung	NuStar Energy LP	104.490	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.057	15.11.2021	0	(172)	(172)	(0,18)	
	Zahlung	Phillips 66 Partners LP	84.200	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.435	15.11.2021	0	(113)	(113)	(0,12)	
	Zahlung	Sunoco LP	48.200	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.829	15.11.2021	0	(12)	(12)	(0,01)	
Zahlung	Western Midstream Partners LP	65.932	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.500	15.11.2021	0	(88)	(88)	(0,09)		

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens	
Zahlung		Plains All American Pipeline LP	296.900	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 3.126	18.01.2022	\$ 0	\$ 245	\$ 245	0,26	
Zahlung		Crestwood Equity Partners LP	45.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.472	15.02.2022	0	(123)	(123)	(0,13)	
Zahlung		NuStar Energy LP	35.689	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	655	13.04.2022	0	(11)	(11)	(0,01)	
Zahlung		Western Midstream Partners LP	155.189	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.101	13.04.2022	0	222	222	0,23	
								\$ 0	\$ (50)	\$ (50)	(0,05)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	CAD	1.179	\$ 957	\$ 5	\$ 5	0,01	
HUS	07.2021	\$	514	CAD 621	0	(13)	(0,01)	
	07.2021	£	123	87	0	(3)	(0,01)	
MYI	07.2021	€	117	\$ 139	1	0	0,00	
	07.2021	\$	2	£ 2	0	0	0,00	
TOR	07.2021	CAD	6.997	\$ 5.791	141	0	0,15	
					\$ 147	\$ (16)	\$ 131	0,14

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Investor EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	07.2021	\$	521	€ 429	\$ 0	\$ (12)	(0,01)	
BPS	07.2021	\$	7.193	5.899	0	(197)	(0,21)	
BRC	07.2021		136	111	0	(4)	0,00	
GLM	07.2021		166	137	0	(4)	0,00	
HUS	07.2021	€	668	\$ 795	3	0	0,00	
	07.2021	\$	1.003	€ 824	0	(25)	(0,03)	
MYI	07.2021	€	91	\$ 111	3	0	0,00	
	07.2021	\$	72	€ 61	0	0	0,00	
SCX	07.2021		6.754	5.521	0	(207)	(0,22)	
TOR	07.2021		6.687	5.466	0	(205)	(0,21)	
UAG	07.2021		721	593	0	(18)	(0,02)	
					\$ 6	\$ (672)	\$ (666)	(0,70)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BPS	07.2021	£	21	\$ 29	\$ 0	\$ 0	0,00	
	07.2021	\$	115	£ 81	0	(3)	0,00	
BRC	07.2021		25	18	0	0	0,00	
GLM	07.2021		688	487	0	(16)	(0,02)	
HUS	07.2021	£	534	\$ 739	2	0	0,00	
	07.2021	\$	38	£ 27	0	(1)	0,00	
MYI	08.2021		739	534	0	(1)	0,00	
	07.2021	£	42	\$ 58	0	0	0,00	
	07.2021	\$	49	£ 35	0	(1)	0,00	
RYL	07.2021		18	13	0	0	0,00	
SCX	07.2021		673	473	0	(19)	(0,02)	
SSB	07.2021	£	534	\$ 737	0	0	0,00	
	08.2021	\$	737	£ 534	0	0	0,00	
UAG	07.2021		690	487	0	(17)	(0,02)	
					\$ 2	\$ (58)	\$ (56)	(0,06)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (269) (0,28)

Summe Anlagen

\$ 94.522 98,77

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 1.174 1,23

Nettovermögen

\$ 95.696 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(b) Nullkuponwertpapier.

- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Mit dem Fonds verbunden.
- (e) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 724 und Barmittel in Höhe von USD 450 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 33.468	\$ 53.296	\$ 0	\$ 86.764
Investmentfonds	8.027	0	0	8.027
Finanzderivate ⁽³⁾	0	(269)	0	(269)
Summen	\$ 41.495	\$ 53.027	\$ 0	\$ 94.522

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 22.445	\$ 56.796	\$ 0	\$ 79.241
Investmentfonds	325	0	0	325
Finanzderivate ⁽³⁾	0	(3.128)	0	(3.128)
Summen	\$ 22.770	\$ 53.668	\$ 0	\$ 76.438

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 57	\$ 724	\$ 781
BPS	(200)	0	(200)
BRC	(4)	0	(4)
CBK	428	0	428
GLM	(20)	0	(20)
HUS	(38)	0	(38)
MYI	(167)	450	283
SCX	(226)	0	(226)
TOR	(64)	0	(64)
UAG	(35)	0	(35)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	69,03	28,91
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	21,63	73,16
Investmentfonds	8,39	0,42
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,28)	(4,03)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kanada	7,05	6,64
USA	27,92	22,27
Kurzfristige Instrumente	55,69	73,16
Investmentfonds	8,39	0,42
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	0,39	(0,21)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	(0,05)	(4,06)
Devisenterminkontrakte	0,14	(0,13)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,76)	0,37
Sonstige Aktiva und Passiva	1,23	1,54
Nettvermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Mortgage Opportunities Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
BANKEN UND FINANZEN											
Santander UK Group Holdings PLC				6,608 % fällig am 25.07.2026 (a)	\$ 3.436	\$ 155	0,01	8,398 % fällig am 15.06.2037 -			
6,750 % fällig am 24.06.2024 (f)(h) £	2.600	\$ 4.016	0,17	6,708 % fällig am 25.12.2032 (a)	807	154	0,01	15.06.2044	\$ 4.222	\$ 4.977	0,21
U.S. Capital Funding Ltd.				7,008 % fällig am 25.11.2033 -				8,898 % fällig am 15.05.2041	595	704	0,03
0,468 % fällig am 10.07.2043	\$ 17.192	15.129	0,63	25.10.2034 (a)	1.252	198	0,01	9,188 % fällig am 15.12.2043	1.036	1.133	0,05
		19.145	0,80	7,320 % fällig am 25.08.2033	360	401	0,02	10,703 % fällig am 15.01.2041	973	1.227	0,05
				7,386 % fällig am 25.08.2033	124	137	0,01	11,698 % fällig am 15.09.2032	423	525	0,02
				7,500 % fällig am 25.04.2042	365	432	0,02	13,170 % fällig am 15.03.2041	96	124	0,01
				7,508 % fällig am 25.11.2033 (a)	74	14	0,00	13,248 % fällig am 15.05.2041	1.425	1.911	0,08
				7,682 % fällig am 25.10.2043	406	406	0,02	Ginnie Mae			
				9,076 % fällig am 25.11.2042	483	563	0,02	0,000 % fällig am 20.08.2033 -			
				9,120 % fällig am 25.05.2043	0	0	0,00	20.01.2044 (b)(d)	4.810	4.722	0,20
				11,440 % fällig am 25.08.2043	34	40	0,00	0,975 % fällig am 20.03.2058	266	271	0,01
				13,725 % fällig am 25.07.2023	184	195	0,01	1,020 % fällig am 20.01.2066	111	113	0,00
				Freddie Mac				1,699 % fällig am 20.11.2046 (a)	11.347	662	0,03
				0,000 % fällig am 01.02.2035 -				1,705 % fällig am 20.06.2046 (a)	9.146	467	0,02
				15.10.2058 (b)(d)	68.397	59.714	2,50	1,723 % fällig am 20.08.2047 (a)	7.005	320	0,01
				0,162 % fällig am 25.12.2036	9.001	8.667	0,36	1,760 % fällig am 20.11.2046 (a)	7.753	320	0,01
				0,410 % fällig am 25.08.2024 (a)	62.087	648	0,03	1,765 % fällig am 20.05.2047 (a)	11.766	610	0,03
				1,951 % fällig am 15.07.2042 (a)	14.981	760	0,03	1,774 % fällig am 20.06.2043 (a)	2.193	104	0,00
				2,000 % fällig am 25.01.2051 (a)	4.889	414	0,02	1,783 % fällig am 20.04.2043 (a)	10.866	565	0,02
				2,122 % fällig am 15.01.2038 (a)	339	22	0,00	1,798 % fällig am 20.01.2047 (a)	7.578	329	0,01
				2,500 % fällig am 15.11.2027 -				1,819 % fällig am 20.07.2046 (a)	7.845	395	0,02
				25.03.2051 (a)	36.717	3.708	0,16	1,861 % fällig am 20.10.2046 (a)	6.785	316	0,01
				2,508 % fällig am 15.09.2042	1.266	1.131	0,05	1,907 % fällig am 20.05.2040 (a)	6.737	357	0,02
				2,633 % fällig am 15.10.2032	104	104	0,00	2,000 % fällig am 16.05.2041	2.612	2.637	0,11
				2,920 % fällig am 01.09.2036	1.542	1.612	0,07	2,098 % fällig am 20.07.2041 (a)	1.941	92	0,00
				3,000 % fällig am 15.03.2027 -				2,410 % fällig am 20.06.2042 (a)	2.488	128	0,01
				25.03.2051 (a)	125.411	16.204	0,68	2,460 % fällig am 20.06.2042 (a)	2.296	102	0,00
				3,314 % fällig am 15.12.2027 (a)	1.239	78	0,00	2,500 % fällig am 20.09.2027 (a)	6.838	375	0,02
				3,439 % fällig am 25.09.2024	6.100	5.583	0,23	3,000 % fällig am 20.12.2047 -			
				3,500 % fällig am 15.03.2029 -				20.11.2067	12.572	13.249	0,55
				25.07.2050 (a)	30.243	3.871	0,16	3,000 % fällig am 20.12.2049 (a)	10.487	1.255	0,05
				3,500 % fällig am 01.01.2038 -				3,250 % fällig am 20.01.2047	1.186	1.253	0,05
				01.12.2046	2.772	2.906	0,12	3,500 % fällig am 20.09.2029 -			
				4,000 % fällig am 15.10.2041 -				20.09.2046 (a)	1.848	250	0,01
				25.08.2050 (a)	34.519	5.920	0,25	3,500 % fällig am 20.03.2042 -			
				4,000 % fällig am 15.01.2043 -				20.02.2048	12.320	13.350	0,56
				15.05.2048	30.490	32.797	1,37	4,000 % fällig am 20.03.2047 -			
				4,240 % fällig am 15.11.2048 (a)	76.857	7.144	0,30	20.03.2050	32.070	34.118	1,43
				4,399 % fällig am 15.08.2040 (a)	2.973	343	0,01	4,500 % fällig am 20.05.2043 -			
				4,490 % fällig am 15.12.2048	5.831	5.888	0,25	20.09.2047 (a)	3.386	727	0,03
				4,500 % fällig am 15.02.2037 -				4,500 % fällig am 20.04.2048 -			
				25.06.2050 (a)	8.544	1.014	0,04	20.02.2049	4.514	4.813	0,20
				4,500 % fällig am 15.08.2043 -				5,000 % fällig am 20.09.2040 (a)	820	0	0,00
				01.02.2048	1.862	2.018	0,08	5,000 % fällig am 20.11.2048	2.035	2.201	0,09
				4,899 % fällig am 15.04.2042 (a)	2.206	303	0,01	5,451 % fällig am 20.09.2043 (a)	1.677	214	0,01
				5,000 % fällig am 15.05.2025 -				5,621 % fällig am 20.09.2045 (a)	3.303	598	0,03
				25.05.2048 (a)	3.564	464	0,02	5,949 % fällig am 16.04.2040 -			
				5,000 % fällig am 15.10.2042 -				16.08.2042 (a)	2.985	544	0,02
				01.03.2049	5.880	6.533	0,27	5,951 % fällig am 20.11.2049 (a)	7.059	878	0,04
				5,749 % fällig am 15.02.2041 (a)	392	74	0,00	6,000 % fällig am 20.02.2047	27	32	0,00
				5,817 % fällig am 15.09.2043 (a)	1.193	232	0,01	6,001 % fällig am 20.01.2035 -			
				5,849 % fällig am 15.07.2041 (a)	3.974	619	0,03	20.08.2049 (a)	20.440	2.795	0,12
				5,849 % fällig am 15.05.2043	63	64	0,00	6,101 % fällig am 20.03.2035 -			
				5,899 % fällig am 15.10.2041 -				20.09.2048 (a)	4.406	740	0,03
				15.08.2042 (a)	17.097	3.293	0,14	6,151 % fällig am 20.07.2044 (a)	2.278	706	0,03
				5,949 % fällig am 15.08.2041 -				6,299 % fällig am 16.01.2038 (a)	54	5	0,00
				15.11.2043 (a)	7.599	1.369	0,06	6,349 % fällig am 16.02.2040 (a)	2.611	420	0,02
				5,958 % fällig am 25.11.2049 -				6,601 % fällig am 20.05.2041 (a)	2.231	353	0,01
				25.06.2050 (a)	39.893	7.108	0,30	13,500 % fällig am 20.11.2045	534	971	0,04
				5,977 % fällig am 15.09.2044 (a)	4.542	943	0,04	Ginnie Mae, TBA			
				5,999 % fällig am 15.02.2044 (a)	310	48	0,00	2,000 % fällig am 01.07.2051	65.500	66.595	2,79
				6,008 % fällig am 25.06.2050 (a)	15.671	3.028	0,13	2,500 % fällig am 01.07.2051	82.400	85.149	3,57
				6,049 % fällig am 15.08.2025 -				3,000 % fällig am 01.08.2051	33.500	34.943	1,46
				15.10.2048 (a)	24.317	3.750	0,16	4,000 % fällig am 01.07.2051	57.800	61.062	2,56
				6,058 % fällig am 25.05.2050 (a)	4.550	807	0,03	4,500 % fällig am 01.07.2051	9.620	10.253	0,43
				6,099 % fällig am 15.03.2048 (a)	6.123	1.097	0,05	Uniform Mortgage-Backed Security			
				6,149 % fällig am 15.09.2042 (a)	1.415	250	0,01	2,000 % fällig am 01.04.2036	22.142	22.936	0,96
				6,199 % fällig am 15.10.2036 (a)	1.628	283	0,01	2,500 % fällig am 01.01.2033 -			
				6,369 % fällig am 15.11.2037 (a)	333	59	0,00	01.02.2051	81.505	84.677	3,55
				6,389 % fällig am 15.01.2042 (a)	9.440	1.981	0,08	2,950 % fällig am 01.02.2030	4.896	5.268	0,22
				6,499 % fällig am 15.07.2023 -				3,000 % fällig am 01.01.2038 -			
				15.11.2041 (a)	277	35	0,00	01.07.2060	342.155	364.280	15,26
				6,549 % fällig am 15.07.2026 (a)	1.647	161	0,01	3,000 % fällig am 01.04.2051 (j)	189.912	201.208	8,43
				6,599 % fällig am 15.09.2039 (a)	3.769	767	0,03	3,270 % fällig am 01.12.2027	5.636	6.156	0,26
				15.12.2042 (a)	3.917	820	0,03	3,500 % fällig am 01.02.2030 -			
				6,629 % fällig am 15.09.2039 (a)	3.769	767	0,03	01.06.2051	93.776	100.477	4,21
				6,749 % fällig am 15.03.2038 (a)	631	111	0,00	3,503 % fällig am 01.08.2049	1.762	1.845	0,08
				7,523 % fällig am 15.07.2043	189	197	0,01	3,510 % fällig am 01.03.2029	1.144	1.245	0,05
				7,729 % fällig am 15.12.2043	226	225	0,01	3,624 % fällig am 01.12.2048	1.832	1.917	0,08
				7,752 % fällig am 15.01.2041	731	765	0,03	3,870 % fällig am 01.07.2027	1.600	1.784	0,07
				7,799 % fällig am 15.12.2031 (a)	87	17	0,00				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
4,000 % fällig am 01.02.2037 - 01.08.2049	\$ 32.336	\$ 35.133	1,47	Cascade Funding Mortgage Trust	\$ 1.559	\$ 1.629	0,07	GS Mortgage Securities Corp. Trust	\$ 600	\$ 597	0,02
4,050 % fällig am 01.12.2028	1.939	2.248	0,09	4,000 % fällig am 25.10.2068				1,551 % fällig am 15.07.2025	2.790	2.797	0,12
4,500 % fällig am 01.12.2038 - 01.04.2059	12.854	14.303	0,60	Chase Mortgage Finance Trust	70	70	0,00	1,551 % fällig am 15.07.2031	2.000	1.982	0,08
5,000 % fällig am 01.06.2048 - 01.03.2049	2.060	2.268	0,10	3,066 % fällig am 25.03.2037 ^				1,701 % fällig am 15.11.2032	4.000	4.009	0,17
5,620 % fällig am 01.06.2041	491	576	0,02	ChaseFlex Trust	894	863	0,04	4,579 % fällig am 10.10.2032	5.821	5.858	0,25
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				0,432 % fällig am 25.05.2037				GSMPS Mortgage Loan Trust			
1,500 % fällig am 01.08.2036	52.500	53.068	2,22	Chester B1 Issuer PLC	£ 500	693	0,03	0,492 % fällig am 25.04.2036	451	389	0,02
2,000 % fällig am 01.08.2036 - 01.08.2051	341.200	351.304	14,71	1,349 % fällig am 17.01.2058	£ 500	693	0,03	7,087 % fällig am 20.10.2032	1.586	1.604	0,07
2,500 % fällig am 01.07.2036 - 01.08.2051	186.700	193.034	8,08	1,649 % fällig am 17.01.2058	500	692	0,03	GSMSC Resecuritization Trust			
3,000 % fällig am 01.08.2036 - 01.08.2051	228.773	239.379	10,03	Citigroup Commercial Mortgage Trust	\$ 386	384	0,02	5,279 % fällig am 26.04.2037	7.245	2.749	0,11
3,500 % fällig am 01.08.2036	25.000	26.691	1,12	1,201 % fällig am 15.07.2030	\$ 386	384	0,02	Harben Finance PLC	£ 9.628	13.347	0,56
4,000 % fällig am 01.07.2036	74.300	78.970	3,31	Citigroup Mortgage Loan Trust	2.046	2.064	0,09	1,281 % fällig am 20.08.2056	£ 9.628	13.347	0,56
		2.445.041	102,40	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.	28	29	0,00	1,581 % fällig am 20.08.2056	9.258	12.828	0,54
				3,029 % fällig am 25.08.2035				1,881 % fällig am 20.08.2056	4.443	6.121	0,26
				CitiMortgage Alternative Loan Trust				Hilton Orlando Trust			
				0,642 % fällig am 25.01.2037	1.988	1.647	0,07	1,951 % fällig am 15.12.2034	\$ 3.500	3.508	0,15
				6,000 % fällig am 25.11.2036	1.166	1.164	0,05	Hilton USA Trust			
				Countrywide Alternative Loan Trust				4,927 % fällig am 05.11.2035	8.201	8.307	0,35
				0,252 % fällig am 25.02.2047	409	382	0,02	HomeBanc Mortgage Trust			
				0,252 % fällig am 25.09.2047	11	11	0,00	0,902 % fällig am 25.10.2035	7.184	7.107	0,30
				0,372 % fällig am 25.10.2046	3.054	2.980	0,12	Hops Hill No. 1 PLC			
				0,519 % fällig am 20.03.2046	680	579	0,02	1,000 % fällig am 27.05.2054	£ 2.390	3.329	0,14
				0,519 % fällig am 20.05.2046 ^	2.396	2.074	0,09	1,650 % fällig am 27.05.2054	3.100	4.325	0,18
				0,732 % fällig am 25.11.2035	4.955	4.441	0,19	1,900 % fällig am 27.05.2054	3.000	4.186	0,18
				0,792 % fällig am 25.09.2035	2.424	2.305	0,10	2,400 % fällig am 27.05.2054	1.100	1.540	0,06
				1,067 % fällig am 25.06.2046	2.595	2.336	0,10	HSI Asset Securitization Corp. Trust			
				1,127 % fällig am 25.12.2035	1.729	1.686	0,07	1,052 % fällig am 25.07.2035	\$ 1.100	1.096	0,05
				1,507 % fällig am 25.11.2047 ^	4.343	3.997	0,17	IndyMac Mortgage Loan Trust			
				5,500 % fällig am 25.06.2035	191	185	0,01	2,851 % fällig am 25.12.2035	473	426	0,02
				5,500 % fällig am 25.07.2035	2.710	2.419	0,10	2,928 % fällig am 25.12.2035 ^	4.111	3.310	0,14
				5,500 % fällig am 25.10.2035	1.508	1.403	0,06	InTown Hotel Portfolio Trust			
				5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	1.918	1.460	0,06	2,401 % fällig am 15.01.2033	3.853	3.874	0,16
				5,500 % fällig am 25.12.2035	312	287	0,01	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			
				6,000 % fällig am 25.05.2036	4.226	3.404	0,14	2,273 % fällig am 15.02.2035	6.000	6.005	0,25
				6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	1.608	987	0,04	JPMorgan Alternative Loan Trust			
				6,250 % fällig am 25.05.2036	362	293	0,01	0,412 % fällig am 25.11.2036	6.188	5.908	0,25
				6,250 % fällig am 25.09.2037	647	549	0,02	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.			
				Countrywide Asset-Backed Certificates				2,241 % fällig am 15.10.2032	4.100	3.974	0,17
				0,592 % fällig am 25.03.2036	1.148	1.139	0,05	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			
				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				5,337 % fällig am 15.05.2047	5.523	4.779	0,20
				2,706 % fällig am 25.04.2035 ^	306	251	0,01	6,169 % fällig am 12.02.2051	1.115	1.009	0,04
				2,764 % fällig am 20.11.2035	4.905	4.531	0,19	JPMorgan Resecuritization Trust			
				2,858 % fällig am 20.04.2036	63	60	0,00	5,303 % fällig am 26.09.2037	1.502	1.196	0,05
				3,193 % fällig am 20.04.2036	619	501	0,02	5,750 % fällig am 26.04.2037	1.168	823	0,03
				5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	921	695	0,03	Lehman Mortgage Trust			
				6,500 % fällig am 25.11.2037 ^	2.655	1.569	0,07	6,000 % fällig am 25.12.2036	2.055	2.043	0,09
				6,500 % fällig am 25.12.2037	5.384	3.401	0,14	Lehman XS Trust			
				Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				0,332 % fällig am 25.06.2047	7.864	7.295	0,31
				5,500 % fällig am 25.10.2021	24	24	0,00	MASTR Asset Securitization Trust			
				Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 25.10.2036	882	879	0,04
				0,332 % fällig am 25.01.2047	6.592	5.999	0,25	MASTR Reperforming Loan Trust			
				Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				7,000 % fällig am 25.07.2035	1.426	1.300	0,05
				0,288 % fällig am 19.10.2036	5.863	5.236	0,22	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
				Dutch Property Finance BV				6,250 % fällig am 25.08.2036	4.444	2.718	0,11
				0,141 % fällig am 28.01.2048	£ 1.673	1.988	0,08	ML-CFC Commercial Mortgage Trust			
				Eurosail PLC				5,324 % fällig am 12.12.2049	138	138	0,01
				0,000 % fällig am 10.09.2044	800	913	0,04	Morgan Stanley Capital Trust			
				0,000 % fällig am 13.03.2045	550	633	0,03	1,351 % fällig am 15.11.2034	3.800	3.802	0,16
				0,630 % fällig am 13.06.2045	£ 1.673	2.086	0,09	1,473 % fällig am 15.11.2034	1.000	999	0,04
				1,080 % fällig am 13.06.2045	413	545	0,02	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
				Fingal Securities RMBS DAC				5,500 % fällig am 25.11.2035	1.269	1.096	0,05
				0,962 % fällig am 28.07.2055	£ 8.200	9.780	0,41	6,000 % fällig am 25.10.2037	7.118	5.261	0,22
				1,462 % fällig am 28.07.2055	21.845	26.171	1,10	Mortgage Equity Conversion Asset Trust			
				First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				0,510 % fällig am 25.02.2042	1.210	1.159	0,05
				2,515 % fällig am 25.07.2035	\$ 318	311	0,01	Motel 6 Trust			
				Freddie Mac				2,251 % fällig am 15.08.2034	126	127	0,01
				0,660 % fällig am 25.01.2051	1.714	1.715	0,07	MSCG Trust			
				1,810 % fällig am 25.01.2051	3.000	3.019	0,13	1,181 % fällig am 15.10.2037	3.400	3.407	0,14
				3,842 % fällig am 25.08.2050	1.454	1.471	0,06	Mulcair Securities DAC			
				GreenPoint Mortgage Funding Trust				0,961 % fällig am 24.04.2071	£ 5.670	6.714	0,28
				0,292 % fällig am 25.10.2046	7.532	7.398	0,31	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust			
				Grifonas Finance No. 1 PLC				2,310 % fällig am 25.10.2035	\$ 1.213	1.136	0,05
				0,050 % fällig am 28.08.2039	£ 1.276	1.488	0,06	6,017 % fällig am 25.06.2037	1.546	1.572	0,07
				GS Mortgage Securities Corp.							
				2,073 % fällig am 15.11.2032	\$ 9.250	9.267	0,39				

Aufstellung der Wertpapieranlagen Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Nomura Resecuritization Trust 0,297 % fällig am 26.11.2036	\$ 2.664	\$ 2.368	0,10	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust 5,653 % fällig am 15.02.2051	\$ 783	\$ 598	0,02	0,938 % fällig am 20.01.2037 1,038 % fällig am 20.01.2037	\$ 350	\$ 297	0,01
Precise Mortgage Funding PLC 1,249 % fällig am 12.12.2055	£ 6.500	9.104	0,38	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,897 % fällig am 25.04.2047 ^ 1,087 % fällig am 25.09.2046 1,627 % fällig am 25.01.2047	88 1.203 972	81 1.133 965	0,00 0,05 0,04	Carlyle Euro CLO DAC 0,700 % fällig am 15.01.2031	€ 2.200	2.609	0,11
Pretium Mortgage Credit Partners LLC 2,240 % fällig am 27.09.2060	\$ 4.979	4.983	0,21	1,877 % fällig am 25.11.2046 2,711 % fällig am 25.12.2036 ^ 2,880 % fällig am 25.06.2037 ^	358 2.724 4.083	353 2.691 3.984	0,01 0,11 0,17	Castlelake Aircraft Securitization Trust 4,125 % fällig am 15.06.2043	\$ 4.401	4.393	0,18
Ready Capital Mortgage Financing LLC 2,242 % fällig am 25.02.2035	7.800	7.846	0,33	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 1,117 % fällig am 25.06.2046	2.469	2.169	0,09	CBAM CLO Ltd. 1,210 % fällig am 17.04.2031	1.500	1.501	0,06
Residential Accredit Loans, Inc. Trust 0,392 % fällig am 25.08.2036 3,522 % fällig am 25.12.2035 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ 6,250 % fällig am 25.01.2037 ^	1.233 1.378 236 1.466	956 821 231 1.407	0,04 0,03 0,01 0,06	584.151	24.46			Centex Home Equity Loan Trust 0,412 % fällig am 25.06.2036	1.300	1.268	0,05
Residential Asset Securitization Trust 0,542 % fällig am 25.03.2035 0,562 % fällig am 25.10.2035 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	2.236 2.830 3.061	1.686 1.987 1.446	0,07 0,08 0,06	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				CIT Mortgage Loan Trust 1,542 % fällig am 25.10.2037 ^ 1,592 % fällig am 25.10.2037	1.815 880	1.830 895	0,08 0,04
Residential Mortgage Securities PLC 0,884 % fällig am 20.03.2050	£ 1.388	1.921	0,08	Aames Mortgage Investment Trust 0,652 % fällig am 25.04.2036	1.112	1.113	0,05	Citigroup Mortgage Loan Trust 0,252 % fällig am 25.12.2036 0,492 % fällig am 25.03.2037	4.094 3.240	2.764 3.233	0,12 0,14
Ripon Mortgages PLC 1,581 % fällig am 20.08.2056 1,881 % fällig am 20.08.2056	4.328 890	6.003 1.235	0,25 0,05	Accredited Mortgage Loan Trust 0,672 % fällig am 25.09.2035 1,112 % fällig am 25.07.2035	4.200 2.150	4.139 2.121	0,17 0,09	Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,067 % fällig am 25.05.2035	1.279	1.273	0,05
RMAC PLC 1,050 % fällig am 12.06.2046	3.090	4.292	0,18	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 1,067 % fällig am 25.11.2033	923	916	0,04	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 0,512 % fällig am 25.11.2036	748	748	0,03
Seasoned Loans Structured Transaction Trust 2,750 % fällig am 25.11.2029	\$ 17.545	18.444	0,77	Adagio CLO DAC 0,720 % fällig am 15.10.2031	€ 2.400	2.843	0,12	Columbia Cent CLO Ltd. 1,326 % fällig am 25.10.2028	4.932	4.938	0,21
Sestante Finance SRL 0,000 % fällig am 23.07.2046	€ 1.106	1.208	0,05	Aegis Asset-Backed Securities Trust 1,092 % fällig am 25.03.2035 ^	\$ 91	89	0,00	Conseco Finance Corp. 6,920 % fällig am 01.12.2030	3.861	4.193	0,18
Stratton Mortgage Funding PLC 1,451 % fällig am 25.09.2051 1,548 % fällig am 20.07.2060 1,749 % fällig am 25.09.2051 2,048 % fällig am 20.07.2060 2,548 % fällig am 20.07.2060 3,048 % fällig am 20.07.2060 3,049 % fällig am 12.03.2052	£ 3.250 8.100 5.000 2.200 2.500 3.600 1.400	4.538 11.339 6.982 3.095 3.538 5.097 1.998	0,19 0,47 0,29 0,13 0,15 0,21 0,08	Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates 1,922 % fällig am 25.12.2034	1.357	1.351	0,06	Contego CLO DAC 0,640 % fällig am 23.01.2030	€ 4.200	4.971	0,21
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 0,312 % fällig am 25.06.2037 0,392 % fällig am 25.02.2037 2,511 % fällig am 25.12.2034 2,535 % fällig am 25.02.2034 2,896 % fällig am 25.05.2035 3,129 % fällig am 25.07.2035	\$ 510 742 2.644 13 1.408 1.982	492 747 2.702 13 1.197 1.292	0,02 0,03 0,11 0,00 0,05 0,05	Ameritrust Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 0,472 % fällig am 25.04.2036 0,842 % fällig am 25.09.2035 1,187 % fällig am 25.09.2034	6.350 277 3.079	5.846 278 3.040	0,25 0,01 0,13	Cork Street CLO DAC 0,590 % fällig am 27.11.2028	3.188	3.781	0,16
Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,312 % fällig am 25.09.2047 0,632 % fällig am 25.08.2035 1,223 % fällig am 19.12.2033	4.508 663 692	4.107 709 663	0,17 0,03 0,03	Aqueduct European CLO DAC 0,640 % fällig am 20.07.2030	€ 7.400	8.790	0,37	Countrywide Asset-Backed Certificates 0,232 % fällig am 25.06.2047 ^ 0,242 % fällig am 25.04.2047 ^ 0,242 % fällig am 25.06.2047 ^ 0,282 % fällig am 25.11.2037 0,312 % fällig am 25.09.2037 ^ 0,312 % fällig am 25.09.2047 ^ 0,322 % fällig am 25.05.2037 0,342 % fällig am 25.03.2046 ^ 0,382 % fällig am 25.10.2047 0,792 % fällig am 25.03.2036 ^ 1,067 % fällig am 25.01.2036	\$ 7.210 403 329 614 3.396 1.683 5.600 7.093 10.000 2.123 98	6.870 399 327 611 3.412 1.618 5.362 6.862 9.299 2.009 99	0,29 0,02 0,01 0,03 0,14 0,07 0,22 0,29 0,39 0,08 0,00
Structured Asset Securities Corp. 0,342 % fällig am 25.07.2035	1.767	1.680	0,07	Armada Euro CLO DAC 0,720 % fällig am 15.07.2031	€ 2.400	2.841	0,12	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 0,242 % fällig am 25.03.2047 ^ 5,633 % fällig am 25.06.2035 5,859 % fällig am 25.10.2046 ^	6.584 92 30	6.492 97 31	0,27 0,00 0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 0,342 % fällig am 25.05.2036	2.562	2.101	0,09	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,312 % fällig am 25.12.2036 0,592 % fällig am 25.03.2036 1,322 % fällig am 25.02.2035	\$ 4.731 1.593 946	4.331 1.469 947	0,18 0,06 0,04	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. 1,067 % fällig am 25.10.2034 1,997 % fällig am 25.08.2034	116 441	115 441	0,00 0,02
Sutherland Commercial Mortgage Loans 3,192 % fällig am 25.05.2037	463	461	0,02	Assurant CLO Ltd. 1,438 % fällig am 20.10.2029	6.300	6.304	0,26	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 0,392 % fällig am 25.05.2036 0,872 % fällig am 25.03.2034	2.621 454	2.142 452	0,09 0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC 1,486 % fällig am 20.10.2051	£ 3.700	5.120	0,21	Attentus CDO Ltd. 0,638 % fällig am 11.10.2042	10.455	8.783	0,37	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust 3,765 % fällig am 25.02.2037	3.606	2.913	0,12
Trinity Square PLC 1,449 % fällig am 15.07.2059 1,749 % fällig am 15.07.2059 2,049 % fällig am 15.07.2059 2,799 % fällig am 15.07.2059	9.600 3.200 2.400 1.600	13.301 4.434 3.317 2.219	0,56 0,19 0,14 0,09	Bain Capital Euro DAC 0,740 % fällig am 20.01.2032	€ 5.300	6.279	0,26	CVC Cordatus Loan Fund DAC 0,650 % fällig am 15.10.2031	€ 2.500	2.971	0,12
Twin Bridges PLC 0,860 % fällig am 12.09.2044 0,960 % fällig am 12.09.2050	3.189 3.469	4.416 4.820	0,18 0,20	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 0,572 % fällig am 25.07.2036 0,632 % fällig am 25.04.2036 1,142 % fällig am 25.08.2037 1,172 % fällig am 25.12.2035 1,292 % fällig am 25.01.2045 1,967 % fällig am 25.07.2034	\$ 1.700 3.320 10.509 1.677 146 335	1.679 3.300 9.999 1.366 146 341	0,07 0,14 0,42 0,06 0,01 0,01	Denali Capital CLO LLC 1,226 % fällig am 26.10.2027	\$ 1.965	1.968	0,08
UBS Commercial Mortgage Trust 4,241 % fällig am 15.06.2051	\$ 1.700	1.942	0,08	Blackrock European CLO DAC 0,620 % fällig am 15.10.2031	€ 1.700	2.007	0,08	Dorchester Park CLO DAC 1,088 % fällig am 20.04.2028	4.058	4.061	0,17
Uropa Securities PLC 0,336 % fällig am 10.10.2040 0,436 % fällig am 10.10.2040	£ 80 40	103 53	0,00 0,00	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 0,650 % fällig am 15.07.2030	3.900	4.637	0,19	Dryden Euro CLO BV 0,660 % fällig am 15.04.2033	€ 2.100	2.482	0,10
Vericrest Opportunity Loan Transferee 2,116 % fällig am 25.04.2051	\$ 520	521	0,02	BSPT Issuer Ltd. 1,151 % fällig am 15.03.2028 2,651 % fällig am 15.03.2028 3,551 % fällig am 15.03.2028	\$ 811 2.140 965	811 2.141 960	0,03 0,09 0,04	ECMC Group Student Loan Trust 1,142 % fällig am 25.05.2067	\$ 1.270	1.294	0,05
Verus Securitization Trust 1,977 % fällig am 25.03.2060 2,338 % fällig am 25.10.2063 3,035 % fällig am 25.03.2060 3,195 % fällig am 25.10.2063 3,889 % fällig am 25.03.2060 4,199 % fällig am 25.10.2063	1.094 1.250 200 1.000 400 1.000	1.110 1.257 207 1.007 419 1.006	0,05 0,05 0,01 0,04 0,02 0,04	Cairn CLO BV 0,650 % fällig am 20.10.2028 0,780 % fällig am 15.10.2031	€ 2.779 1.700	3.303 2.016	0,14 0,08	Euro-Galaxy CLO DAC 0,620 % fällig am 24.04.2034	€ 1.400	1.658	0,07
				Capitalsource Real Estate Loan Trust 0,578 % fällig am 20.01.2037 0,838 % fällig am 20.01.2037	\$ 23 950	23 872	0,00 0,04	First Franklin Mortgage Loan Trust 0,212 % fällig am 25.11.2036 0,252 % fällig am 25.11.2036 0,402 % fällig am 25.09.2036 0,752 % fällig am 25.01.2036	\$ 10.105 6.585 7.465 1.383	9.673 6.511 7.119 1.372	0,41 0,27 0,30 0,06
								Fremont Home Loan Trust 0,332 % fällig am 25.08.2036 0,372 % fällig am 25.02.2037 1,022 % fällig am 25.07.2035	4.582 7.590 4.000	2.010 6.265 3.786	0,08 0,26 0,16
								Goodgreen Trust 3,930 % fällig am 15.10.2053	4.375	4.653	0,20

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
GSA Home Equity Trust				Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				Soundview Home Loan Trust			
0,322 % fällig am 25.04.2047	\$ 4.656	\$ 2.922	0,12	0,672 % fällig am 25.01.2036	\$ 3.034	\$ 2.991	0,13	0,232 % fällig am 25.07.2036	\$ 4.088	\$ 4.014	0,17
0,812 % fällig am 25.10.2035	1.929	1.826	0,08					0,262 % fällig am 25.07.2037	7.677	7.155	0,30
				Morgan Stanley Home Equity Loan Trust	169	111	0,00	0,262 % fällig am 25.08.2037	8.149	7.570	0,32
GSAMP Trust				0,192 % fällig am 25.04.2037				0,782 % fällig am 25.12.2035	4.500	4.339	0,18
0,362 % fällig am 25.03.2047	1.095	1.038	0,04					0,992 % fällig am 25.10.2037	8.675	7.660	0,32
0,977 % fällig am 25.07.2045 ^	6.976	6.928	0,29	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust	4.043	2.191	0,09	1,082 % fällig am 25.06.2035	838	866	0,04
				0,392 % fällig am 25.07.2036				1,392 % fällig am 25.10.2037	6.766	5.812	0,24
Harley Marine Financing LLC				National Collegiate Student Loan Trust	4.376	4.254	0,18	Sprite Ltd.			
5,682 % fällig am 15.05.2043	1.533	1.418	0,06	0,402 % fällig am 25.05.2032				4,250 % fällig am 15.12.2037	1.552	1.545	0,06
Harvest CLO DAC				Navigent Private Education Loan Trust				Structured Asset Investment Loan Trust			
0,630 % fällig am 18.11.2029	€ 130	155	0,01	2,650 % fällig am 15.12.2028	187	191	0,01	0,692 % fällig am 25.04.2036	12.000	7.135	0,30
0,640 % fällig am 15.10.2031	7.700	9.125	0,38	2,740 % fällig am 15.02.2029	25	25	0,00	0,992 % fällig am 25.05.2035	4.200	4.222	0,18
0,760 % fällig am 15.07.2031	5.000	5.947	0,25								
0,960 % fällig am 20.10.2031	2.500	2.962	0,12	NovaStar Mortgage Funding Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
1,040 % fällig am 15.07.2031	800	950	0,04	1,262 % fällig am 25.06.2035	2.000	1.985	0,08	0,222 % fällig am 25.05.2036	512	481	0,02
1,600 % fällig am 15.10.2031	5.000	5.945	0,25					0,402 % fällig am 25.08.2046	6.429	5.885	0,25
				OAK Hill European Credit Partners DAC	€ 1.500	1.780	0,07	1,217 % fällig am 25.04.2035	173	173	0,01
Home Equity Asset Trust				0,730 % fällig am 20.01.2032				Taberna Preferred Funding Ltd.			
0,412 % fällig am 25.08.2036	\$ 3.467	3.458	0,15					0,516 % fällig am 05.05.2038	7.340	6.826	0,29
0,767 % fällig am 25.02.2036	1.400	1.391	0,06	OCP CLO Ltd.				0,664 % fällig am 05.07.2035	338	301	0,01
1,382 % fällig am 25.08.2033	475	476	0,02	0,984 % fällig am 15.07.2027	\$ 218	218	0,01				
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				Option One Mortgage Loan Trust				Terwin Mortgage Trust			
0,332 % fällig am 25.08.2036		6.683	0,28	0,232 % fällig am 25.03.2037	6.645	6.217	0,26	1,037 % fällig am 25.06.2036	200	192	0,01
0,332 % fällig am 25.04.2037		7.913	0,25	OZLM Ltd.				Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.			
1,337 % fällig am 25.03.2035		2.900	0,12	1,186 % fällig am 16.05.2030	5.300	5.299	0,22	4,147 % fällig am 15.09.2038	8.966	8.938	0,37
HSI Asset Securitization Corp. Trust				Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				TICP CLO Ltd.			
0,342 % fällig am 25.05.2037	4.600	4.493	0,19	0,827 % fällig am 25.09.2035	5.100	5.065	0,21	1,028 % fällig am 20.04.2028	9.507	9.507	0,40
Invesco Euro CLO DAC				0,872 % fällig am 25.09.2035	7.700	7.438	0,31				
0,650 % fällig am 15.07.2031	€ 900	1.063	0,04	1,667 % fällig am 25.02.2035	565	571	0,02	Tralee CLO Ltd.			
				1,742 % fällig am 25.12.2034	1.972	2.003	0,08	1,298 % fällig am 20.10.2028	4.927	4.928	0,21
Jamestown CLO Ltd.				1,967 % fällig am 25.09.2034	1.167	1.174	0,05				
1,410 % fällig am 17.01.2027	\$ 66	66	0,00	Penta CLO BV	€ 1.547	1.835	0,08	TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				0,790 % fällig am 04.08.2028				1,757 % fällig am 20.09.2039	4.358	4.205	0,18
0,632 % fällig am 25.03.2036	6.153	5.760	0,24	Pepper SPARKZ Trust No.3	AUD 2.941	2.220	0,09	Venture CLO Ltd.			
0,737 % fällig am 25.10.2035	4.900	4.530	0,19	1,055 % fällig am 17.08.2028				1,064 % fällig am 15.04.2027	5.254	5.244	0,22
1,112 % fällig am 25.07.2035	1.190	1.192	0,05	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				1,238 % fällig am 20.07.2030	10.000	9.993	0,42
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				0,342 % fällig am 25.06.2047 ^	\$ 798	793	0,03	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
0,212 % fällig am 25.12.2036	6.826	4.380	0,18	0,422 % fällig am 25.07.2036	3.553	3.471	0,15	0,302 % fällig am 25.03.2037	2.189	2.097	0,09
0,362 % fällig am 25.07.2036	9.337	9.107	0,38	0,482 % fällig am 25.02.2036	2.182	2.170	0,09	0,412 % fällig am 25.07.2036	6.446	6.198	0,26
0,586 % fällig am 25.11.2036	241	226	0,01	0,632 % fällig am 25.05.2036 ^	620	597	0,03	0,602 % fällig am 25.05.2036	4.000	3.875	0,16
Jubilee CLO BV				Pretium Mortgage Credit Partners LLC				WhiteHorse Ltd.			
0,295 % fällig am 12.07.2028	€ 379	450	0,02	3,179 % fällig am 27.06.2069	2.977	2.988	0,13	1,120 % fällig am 17.04.2027	890	891	0,04
0,600 % fällig am 15.04.2030	500	592	0,02	Renaissance Home Equity Loan Trust	1.396	954	0,04	Zais CLO Ltd.			
0,610 % fällig am 15.04.2030	1.300	1.541	0,06	5,746 % fällig am 25.05.2036				1,334 % fällig am 15.04.2028	971	972	0,04
0,650 % fällig am 15.04.2031	2.900	3.434	0,14	Residential Asset Mortgage Products Trust							
Laurelin DAC				0,632 % fällig am 25.02.2036	200	193	0,01				
0,720 % fällig am 20.10.2031	6.000	7.109	0,30	1,142 % fällig am 25.08.2035	1.363	1.361	0,06				
1,800 % fällig am 20.10.2031	3.500	4.188	0,18	Residential Asset Securities Corp. Trust							
LCM LP				0,312 % fällig am 25.02.2037	8.217	7.868	0,33	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
1,228 % fällig am 20.10.2027	\$ 691	691	0,03	0,332 % fällig am 25.10.2036	3.014	2.953	0,12	U.S. TREASURY BILLS			
Lehman XS Trust				0,352 % fällig am 25.07.2036	2.482	2.471	0,10	0,006 % fällig am			
0,512 % fällig am 25.06.2046	4.891	5.040	0,21	0,527 % fällig am 25.06.2036	1.400	1.355	0,06	31.08.2021 (c)(d)(e)(l)	1.732	1.732	0,07
Long Beach Mortgage Loan Trust				0,782 % fällig am 25.11.2035	1.375	1.373	0,06	0,020 % fällig am			
0,252 % fällig am 25.10.2036	24.623	10.781	0,45	0,872 % fällig am 25.06.2034	336	319	0,01	31.08.2021 (c)(d)(e)(l)	3.729	3.728	0,16
0,692 % fällig am 25.02.2036	163	150	0,01	1,037 % fällig am 25.05.2035	736	734	0,03	0,024 % fällig am			
1,112 % fällig am 25.08.2033	379	377	0,02	3,176 % fällig am 25.08.2035	2.131	2.105	0,09	03.08.2021 (c)(d)(e)(l)	705	705	0,03
Madison Park Euro Funding DAC				Sapphire Aviation Finance Ltd.				0,025 % fällig am			
0,750 % fällig am 15.01.2032	€ 19.600	23.276	0,98	4,250 % fällig am 15.03.2040	7.994	7.842	0,33	17.08.2021 (d)(e)(l)	909	909	0,04
Man GLG Euro CLO DAC				Saxon Asset Securities Trust				Summe kurzfristige Instrumente		7.074	0,30
0,680 % fällig am 15.10.2030	4.100	4.870	0,20	0,752 % fällig am 25.11.2037	386	387	0,02	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 3.757.741	157,38	
1,680 % fällig am 15.12.2031	4.700	5.552	0,23	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust							
1,700 % fällig am 15.10.2030	5.000	5.962	0,25	0,212 % fällig am 25.09.2036	2.816	2.466	0,10	AKTIEN			
MAPS Ltd.				Segovia European CLO DAC	€ 7.400	8.776	0,37	INVESTMENTFONDS			
4,212 % fällig am 15.05.2043	\$ 3.026	3.036	0,13	0,880 % fällig am 20.07.2032 (c)				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
MASTR Asset-Backed Securities Trust				SLC Student Loan Trust	\$ 590	589	0,02	PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
0,662 % fällig am 25.01.2036	4.365	4.324	0,18	0,294 % fällig am 15.03.2027				US Dollar Short-Term Floating	482.795	4.809	0,20
0,672 % fällig am 25.12.2035	744	741	0,03	SLM Private Credit Student Loan Trust	2.522	2.474	0,10	NAV Fund (g)			
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0,454 % fällig am 15.12.2039				Summe Investmentfonds	\$ 4.809	0,20	
0,692 % fällig am 25.12.2036	3.700	3.529	0,15	SLM Student Loan Trust	€ 5	6	0,00				
1,172 % fällig am 25.10.2035	891	891	0,04	0,000 % fällig am 17.06.2024							
MidOcean Credit CLO				0,286 % fällig am 27.01.2025	\$ 26	26	0,00				
0,984 % fällig am 15.04.2027	301	301	0,01	1,384 % fällig am 15.12.2033	3.006	3.013	0,13				
Monroe Capital BSL CLO Ltd.				SMB Private Education Loan Trust	12.500	12.633	0,53				
1,270 % fällig am 22.05.2027	121	121	0,01	0,942 % fällig am 15.09.2054							
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				SoFi Consumer Loan Program LLC	12	12	0,00				
0,232 % fällig am 25.10.2036	1.177	703	0,03	3,260 % fällig am 25.08.2025							
0,342 % fällig am 25.07.2036	12.927	11.525	0,48	SoFi Professional Loan Program LLC	122	125	0,01				
0,392 % fällig am 25.07.2036	3.835	1.977	0,08	2,650 % fällig am 25.09.2040							
0,592 % fällig am 25.07.2036	3.835	2.018	0,08								
0,662 % fällig am 25.12.2035	6.879	6.395	0,27								
0,887 % fällig am 25.01.2035	942	929	0,04								

Aufstellung der Wertpapieranlagen Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
90-Day Eurodollar December Futures	Short	12.2022	555	\$ 189	0,01
90-Day Eurodollar June Futures	Short	06.2022	310	(76)	0,00
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03.2022	1.854	287	0,01
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03.2023	555	311	0,01
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09.2022	555	33	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2021	1.073	330	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2021	3.314	1.331	0,06
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	618	530	0,02
				\$ 2.935	0,12
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 2.935	0,12

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2051	£ 500	\$ (18)	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	0,100	13.01.2023	\$ 929.600	743	0,03
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	0,200	29.04.2023	119.500	87	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,250	16.06.2023	546.800	343	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,250	16.06.2024	298.200	294	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,400	30.03.2026	400	8	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	39.000	64	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	108.300	457	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022	29.700	(90)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	75.650	975	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	107.000	(1.119)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,493	23.06.2031	17.100	(28)	0,00
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.12.2028	70.400	127	0,01
Erhalt ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.12.2028	69.700	(55)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,796	08.11.2029	9.940	385	0,02
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR	1,800	13.09.2031	9.790	311	0,01
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR	1,850	07.09.2031	9.710	358	0,01
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR	1,850	22.09.2031	13.200	476	0,02
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month USD-LIBOR	1,950	04.10.2031	6.530	293	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2022	54.200	622	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,915	09.07.2028	3.500	456	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,916	02.07.2028	6.100	798	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,920	16.07.2028	4.600	600	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,924	02.07.2028	45.300	5.951	0,25
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,987	12.06.2028	22.500	2.759	0,12
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	3,113	21.11.2028	5.800	799	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	3,142	20.11.2028	16.700	2.337	0,10
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	3,177	01.11.2028	12.700	1.820	0,08
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 16.300	(29)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	2.400	40	0,00
					\$ 19.764	0,83
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ 19.764	0,83	

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,011 %	23.08.2021	26.500	\$ 247	\$ 66	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,470	01.11.2021	135.700	95	292	0,01
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,360	02.08.2021	4.500	27	63	0,00
BPS	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,023	29.06.2023	34.890	1.856	1.706	0,07
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,019	03.09.2021	68.500	1.297	139	0,01
CBK	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	13.900	79	39	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,019	19.08.2021	13.000	271	18	0,00
CLY	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,019	20.09.2021	15.900	326	44	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
DUB	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,470 %	01.11.2021	135.700	\$ 95	\$ 292	0,01
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,520	01.11.2021	143.600	111	263	0,01
FAR	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,019	20.09.2021	15.900	302	44	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,020	30.09.2021	45.900	964	106	0,01
GLM	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	20.000	107	56	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	05.08.2021	71.600	331	161	0,01
JPM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,019	20.09.2021	31.900	668	89	0,01
MYC	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	01.03.2022	279.500	273	442	0,02
	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	01.04.2022	279.500	319	531	0,02
	Put – OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	02.05.2022	279.500	330	560	0,02
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	12.08.2021	67.200	949	179	0,01
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	09.09.2021	68.600	1.303	194	0,01
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,016	15.09.2021	11.500	153	110	0,01
							\$ 10.103	\$ 5.394	0,23

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	3,000	\$ 17	\$ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,156	05.08.2021	1,000	9	3	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	1,000	9	4	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,418	07.09.2021	56,000	322	242	0,01
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,891	07.09.2021	29,000	267	156	0,01
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	100,398	07.09.2021	58,500	475	403	0,01
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	100,539	07.09.2021	58,500	475	432	0,01
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	2,500	14	9	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	102,547	07.09.2021	58,500	366	232	0,01
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,641	07.07.2021	1,000	6	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,438	07.09.2021	40,000	219	174	0,01
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,859	07.09.2021	28,000	241	148	0,01
					\$ 2.420	\$ 1.803	0,07

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,016 %	23.08.2021	26.500	\$ (93)	\$ (6)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	29.06.2023	170.970	(1.856)	(1.745)	(0,07)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	12.07.2021	32.500	(206)	(277)	(0,01)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	12.07.2021	32.500	(206)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	13.07.2021	19.000	(117)	(129)	(0,01)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	13.07.2021	19.000	(117)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	14.07.2021	22.800	(99)	(104)	(0,01)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	14.07.2021	22.800	(99)	(2)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	01.09.2021	32.100	(155)	(265)	(0,01)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	01.09.2021	32.100	(154)	(48)	0,00
BPS	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	26.07.2021	22.800	(87)	(93)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	26.07.2021	22.800	(87)	(12)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,024	03.09.2021	89.100	(517)	(19)	0,00
CBK	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,024	19.08.2021	13.000	(91)	(2)	0,00
CLY	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,024	20.09.2021	20.700	(145)	(7)	0,00
FAR	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,013	13.09.2021	17.200	(77)	(71)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,013	15.09.2021	17.000	(79)	(91)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,024	20.09.2021	20.700	(120)	(7)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,025	30.09.2021	59.600	(429)	(19)	0,00
GLM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	13.07.2021	22.800	(106)	(169)	(0,01)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	13.07.2021	22.800	(106)	(1)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	19.07.2021	36.300	(187)	(181)	(0,01)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	19.07.2021	22.800	(101)	(4)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	19.07.2021	13.500	(85)	(2)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	07.09.2021	71.600	(536)	(333)	(0,01)
JPM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,024	20.09.2021	41.400	(303)	(15)	0,00
MYC	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	01.11.2021	284.800	(1.073)	(277)	(0,01)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	2.900	(22)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	12.08.2021	134.400	(1.052)	(126)	(0,01)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	09.09.2021	89.200	(515)	(28)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	15.09.2021	23.000	(166)	(107)	(0,01)
							\$ (8.986)	\$ (4.140)	(0,17)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	3,000	\$ (13)	\$ (3)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	05.08.2021	2,000	(7)	(3)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,797	05.08.2021	2,000	(6)	(2)	0,00
GSC	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,227	07.07.2021	1,000	(5)	(2)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 101,367	05.08.2021	1.500	\$ (5)	\$ (4)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	98,914	07.09.2021	58.000	(353)	(200)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,023	07.09.2021	2.000	(13)	(7)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,023	07.09.2021	2.000	(9)	(11)	0,00
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	12.08.2021	5.000	(16)	(8)	0,00
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	4.500	(15)	(8)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,844	07.07.2021	4.000	(9)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	2.000	(13)	(3)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	2.000	(12)	(4)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,641	05.08.2021	56.000	(201)	(122)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,684	05.08.2021	40.000	(141)	(90)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,398	07.09.2021	117.000	(599)	(500)	(0,02)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,539	07.09.2021	117.000	(594)	(534)	(0,02)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,313	07.09.2021	1.500	(5)	(6)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,047	07.07.2021	1.000	(3)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	104,047	07.07.2021	1.000	(2)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	1.500	(5)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	5.000	(16)	(7)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	1.500	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	101,797	07.09.2021	117.000	(521)	(296)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	1.500	(3)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,695	07.09.2021	1.500	(5)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	1.500	(5)	(3)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,375	07.07.2021	500	(2)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,547	07.07.2021	1.100	(4)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,609	07.07.2021	3.500	(15)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,672	07.07.2021	1.000	(4)	0	0,00
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	100,219	07.07.2021	1.500	(9)	(1)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,203	07.07.2021	3.500	(13)	(6)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,219	07.07.2021	1.500	(8)	(2)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,375	07.07.2021	500	(1)	(1)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,422	07.07.2021	1.000	(4)	(1)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,547	07.07.2021	400	(1)	0	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,641	07.07.2021	2.000	(7)	(1)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,645	07.07.2021	2.500	(8)	(1)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,766	07.07.2021	1.000	(3)	0	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,172	05.08.2021	2.000	(13)	(3)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,188	05.08.2021	1.000	(3)	(2)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,406	05.08.2021	4.500	(19)	(8)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,688	05.08.2021	2.500	(8)	(6)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,938	05.08.2021	1.000	(3)	(3)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,188	05.08.2021	1.000	(2)	(4)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,406	05.08.2021	4.500	(10)	(12)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	98,859	07.09.2021	56.000	(302)	(189)	(0,01)	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,281	07.09.2021	2.000	(10)	(8)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,281	07.09.2021	3.500	(10)	(15)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,297	07.09.2021	1.500	(5)	(6)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,328	07.09.2021	3.500	(11)	(14)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,164	07.07.2021	1.000	(4)	0	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,211	07.07.2021	1.000	(4)	0	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,375	07.07.2021	1.000	(3)	0	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,703	05.08.2021	1.000	(2)	(1)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,801	05.08.2021	1.000	(4)	(1)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,078	05.08.2021	1.000	(4)	(1)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,102	05.08.2021	500	(2)	(1)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,344	05.08.2021	1.000	(3)	(1)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,586	05.08.2021	1.000	(4)	(2)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,609	05.08.2021	2.000	(6)	(4)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	101,844	07.09.2021	1.500	(4)	(4)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2051	103,844	07.09.2021	1.500	(2)	(2)	0,00	
Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,258	05.08.2021	1.000	(3)	(2)	0,00	
					\$ (3.099)	\$ (2.123)	(0,09)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 1.100	\$ (26)	\$ 37	\$ 11	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	9.500	(44)	142	98	0,01
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	5.999	(87)	152	65	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	8.200	(42)	126	84	0,01
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	600	(4)	9	5	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	7.100	(3)	77	74	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	2.500	(13)	39	26	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	30.000	(82)	394	312	0,01
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	40.100	(343)	755	412	0,02
SAL	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	70.900	(599)	1.328	729	0,03
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.600	(3)	18	15	0,00
					\$ (1.246)	\$ 3.077	\$ 1.831	0,08

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPS	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,215 %	10.08.2021	\$ 50.000	\$ 0	\$ 63	\$ 63	0,00
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,230	06.07.2021	240.000	0	372	372	0,02
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,230	08.07.2021	120.000	0	183	183	0,01
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,233	17.08.2021	100.000	0	103	103	0,01
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,233	19.08.2021	50.000	0	51	51	0,00
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,260	19.07.2021	50.000	0	54	54	0,00
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,260	05.08.2021	150.000	0	130	130	0,01
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,260	03.09.2021	102.500	0	62	62	0,00
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,260	16.09.2021	185.000	0	90	90	0,00
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,260	17.09.2021	200.000	0	96	96	0,00
						\$ 0	\$ 1.204	\$ 1.204	0,05

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	€ 2.207	\$ 2.635	\$ 18	\$ 0	\$ 18	0,00
	07.2021	£ 958	1.327	3	0	3	0,00
BRC	07.2021	\$ 1.061	£ 760	0	(12)	(12)	0,00
CBK	07.2021	AUD 2.910	\$ 2.251	66	0	66	0,00
GLM	07.2021	€ 1.254	1.520	33	0	33	0,00
HUS	07.2021	1.662	1.985	14	0	14	0,00
	07.2021	\$ 939	€ 771	0	(25)	(25)	0,00
MYI	07.2021	€ 11	\$ 13	0	0	0	0,00
	07.2021	£ 115.761	164.224	4.306	0	4.306	0,18
	07.2021	\$ 37.400	€ 31.357	0	(213)	(213)	(0,01)
	07.2021	2.341	£ 1.686	0	(12)	(12)	0,00
RBC	07.2021	€ 159.623	\$ 195.255	5.957	0	5.957	0,25
				\$ 10.397	\$ (262)	\$ 10.135	0,42

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	CAD 8.497	\$ 6.864	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,01
	07.2021	\$ 87	CAD 105	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	6.864	8.497	0	(2)	(2)	0,00
GLM	07.2021	6.955	8.435	0	(143)	(143)	(0,01)
MYI	07.2021	6.867	8.330	0	(140)	(140)	(0,01)
SCX	07.2021	87	105	0	(2)	(2)	0,00
SSB	07.2021	6.868	8.330	0	(141)	(141)	(0,01)
				\$ 2	\$ (430)	\$ (428)	(0,02)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 2.507	CHF 2.249	\$ 0	\$ (74)	\$ (74)	0,00
BRC	07.2021	CHF 1	\$ 1	0	0	0	0,00
CBK	07.2021	2.147	2.333	9	0	9	0,00
	07.2021	\$ 2.515	CHF 2.255	0	(75)	(75)	(0,01)
	08.2021	2.335	2.147	0	(9)	(9)	0,00
GLM	07.2021	CHF 30	\$ 33	1	0	1	0,00
MYI	07.2021	\$ 2.478	CHF 2.232	0	(63)	(63)	0,00
SSB	07.2021	CHF 141	\$ 154	1	0	1	0,00
UAG	07.2021	163	181	4	0	4	0,00
				\$ 15	\$ (221)	\$ (206)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 6.796	€ 5.594	\$ 0	\$ (163)	\$ (163)	(0,01)
BPS	07.2021	€ 5.338	\$ 6.374	43	0	43	0,01
	07.2021	\$ 188.663	€ 154.237	0	(5.753)	(5.753)	(0,24)
BRC	07.2021	4	4	0	0	0	0,00
GLM	07.2021	199	165	0	(4)	(4)	0,00
HUS	07.2021	€ 4.483	\$ 5.343	26	0	26	0,00
	07.2021	\$ 7.264	€ 6.006	0	(142)	(142)	(0,01)
RYL	07.2021	€ 29.233	\$ 34.802	135	0	135	0,01
SCX	07.2021	245	298	7	0	7	0,00
	07.2021	\$ 217.610	€ 177.878	0	(6.665)	(6.665)	(0,28)
TOR	07.2021	217.610	177.878	0	(6.665)	(6.665)	(0,28)
UAG	07.2021	2.207	1.815	0	(55)	(55)	0,00
				\$ 211	\$ (19.447)	\$ (19.236)	(0,80)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class Z GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 8.186	\$ 11.418	\$ 109	\$ 0	\$ 109	0,01
	07.2021	\$ 452	£ 319	0	(11)	(11)	0,00
BRC	07.2021	£ 3.785	\$ 5.310	81	0	81	0,00
GLM	07.2021	\$ 206.434	£ 146.021	0	(4.713)	(4.713)	(0,20)
HUS	07.2021	£ 153.961	\$ 213.346	657	0	657	0,03
	07.2021	\$ 61	£ 43	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	202.065	145.981	0	(381)	(381)	(0,02)
MYI	07.2021	£ 3.151	\$ 4.376	23	0	23	0,00
	07.2021	\$ 124	£ 88	0	(3)	(3)	0,00
RYL	07.2021	£ 1.120	\$ 1.578	31	0	31	0,00
SCX	07.2021	\$ 206.253	£ 145.089	0	(5.820)	(5.820)	(0,24)
SSB	07.2021	£ 145.981	\$ 201.735	69	0	69	0,00
	07.2021	\$ 81	£ 57	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	201.751	145.981	0	(68)	(68)	0,00
UAG	07.2021	206.893	146.021	0	(5.172)	(5.172)	(0,22)
				\$ 970	\$ (16.170)	\$ (15.200)	(0,64)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Class E SGD (Hedged) thesaurierend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 604	\$ 450	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	08.2021	\$ 450	SGD 604	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07.2021	456	603	0	(7)	(7)	0,00
HUS	07.2021	455	602	0	(7)	(7)	0,00
MYI	07.2021	SGD 604	\$ 450	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 450	SGD 604	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	454	602	0	(7)	(7)	0,00
SSB	07.2021	SGD 2	\$ 1	0	0	0	0,00
				\$ 1	\$ (22)	\$ (21)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (20.987) (0,88)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Ginnie Mae, TBA			
2,000 % fällig am 01.08.2051 (i)	\$ 51.000	\$ (51.851)	(2,17)
2,500 % fällig am 01.07.2051 (i)	14.450	(14.954)	(0,63)
3,500 % fällig am 01.07.2051	24.950	(26.193)	(1,10)
4,000 % fällig am 01.07.2051	500	(536)	(0,02)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,500 % fällig am 01.08.2051 (i)	17.150	(17.706)	(0,74)
3,000 % fällig am 01.07.2051 (i)	84.473	(88.058)	(3,69)
3,000 % fällig am 01.08.2051 (i)	69.600	(72.508)	(3,04)
3,500 % fällig am 01.08.2051	41.600	(43.817)	(1,83)
4,000 % fällig am 01.08.2051	71.999	(76.735)	(3,21)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (392.358)	(16,43)
Summe Anlagen		\$ 3.371.904	141,22
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (984.167)	(41,22)
Nettovermögen		\$ 2.387.737	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Reines Kapitalwertpapier.

(c) Wertpapier per Emissionstermin.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Zum 30. Juni 2021 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 88.747 als Sicherheiten verpfändet.

(k) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 670 und Barmittel in Höhe von USD 17.783 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsengehandelte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

(l) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 7.075 und Barmittel in Höhe von USD 24.824 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.756.323	\$ 1.418	\$ 3.757.741
Investmentfonds	4.809	0	0	4.809
Finanzderivate ⁽³⁾	0	1.712	0	1.712
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(392.358)	0	(392.358)
Summen	\$ 4.809	\$ 3.365.677	\$ 1.418	\$ 3.371.904

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.627.812	\$ 1.325	\$ 3.629.137
Investmentfonds	94.493	0	0	94.493
Pensionsgeschäfte	0	1.590	0	1.590
Finanzderivate ⁽³⁾	(23.353)	44.617	(5)	21.259
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(199.988)	0	(199.988)
Summen	\$ 71.140	\$ 3.474.031	\$ 1.320	\$ 3.546.491

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten	
					Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	0,060 %	14.06.2021	14.07.2021	\$ (74.595)	\$ (74.597)	(3,12)
TDM	0,080	24.06.2021	14.07.2021	(2.028)	(2.028)	(0,09)
	0,080	29.06.2021	14.07.2021	(9.126)	(9.126)	(0,38)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (85.751)	(3,59)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (688)	\$ 250	\$ (438)
BPS	(5.583)	4.900	(683)
BRC	69	0	69
CBK	46	0	46
CLY	37	0	37
DUB	729	(1.400)	(671)
FAR	(46)	0	(46)
FBF	89	(220)	(131)
GLM	(5.299)	4.720	(579)
GSC	(224)	0	(224)
GST	100	0	100
HUS	141	0	141
JPM	(34)	100	66
JPS	1.204	(1.640)	(436)
MYC	2.202	(2.996)	(794)
MYI	3.898	(3.789)	109
RBC	5.957	(5.260)	697
RYL	166	0	166
SAL	764	(922)	(158)
SCX	(12.487)	11.377	(1.110)
SSB	(140)	0	(140)
TOR	(6.665)	5.865	(800)
UAG	(5.223)	4.687	(536)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	16,48	9,71
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	137,41	170,39
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,49	3,47
Investmentfonds	0,20	4,78
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,12	(1,18)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,83	1,17
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,88)	1,09
Leerverkaufte Wertpapiere	(16,43)	(10,12)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(3,59)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,11)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	0,81	0,97
Kommunalanleihen und Wechsel	0,06	0,08
US-Regierungsbehörden	102,40	131,35
US-Schatzobligationen	0,12	0,14
Non-Agency-MBS	24,46	18,43
Forderungsbesicherte Wertpapiere	29,23	31,08
Kurzfristige Instrumente	0,30	1,52
Investmentfonds	0,20	4,78
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,12	(1,18)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,83	1,17

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswaptionen	0,23	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,07	0,00
Verkaufsoptionen		
Zinsswaptionen	(0,17)	0,00
Optionen auf Wertpapiere	(0,09)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,08	0,11
Zinsswaps	0,05	(0,04)
Devisenterminkontrakte	0,42	(0,11)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,47)	1,09
Leerverkaufte Wertpapiere	(16,43)	(10,12)
Sonstige Aktiva und Passiva	(41,22)	(79,39)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen StocksPLUS™ Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
BANKEN UND FINANZEN											
Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 6.500	\$ 7.785	0,25	Nomura Holdings, Inc. 1,851 % fällig am 16.07.2025	\$ 2.900	\$ 2.967	0,10	4,810 % fällig am 17.09.2030	900	1.017	0,03
Aviation Capital Group LLC 5,500 % fällig am 15.12.2024	100	113	0,00	2,648 % fällig am 16.01.2025	2.500	2.629	0,09	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625 % fällig am 01.03.2025	200	229	0,01
Avolon Holdings Funding Ltd. 5,125 % fällig am 01.10.2023	1.100	1.190	0,04	2,679 % fällig am 16.07.2030	2.300	2.340	0,08	Sands China Ltd. 4,600 % fällig am 08.08.2023	\$ 3.600	\$ 3.835	0,12
Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % fällig am 10.01.2025	400	419	0,01	Park Aerospace Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 15.08.2022	32	33	0,00	5,125 % fällig am 08.08.2025	4.200	4.703	0,15
Bank of America Corp. 0,455 % fällig am 24.08.2025	€ 23.500	28.361	0,92	QNB Finance Ltd. 1,256 % fällig am 12.02.2022	14.800	14.865	0,48	Skyworks Solutions, Inc. 0,900 % fällig am 01.06.2023	100	100	0,00
Barclays PLC 1,536 % fällig am 16.05.2024	\$ 1.300	1.324	0,04	Santander Holdings USA, Inc. 3,244 % fällig am 05.10.2026	900	963	0,03	1,800 % fällig am 01.06.2026	100	101	0,00
2,375 % fällig am 06.10.2023	€ 6.700	9.460	0,31	Santander UK Group Holdings PLC 4,796 % fällig am 15.11.2024	3.400	3.719	0,12	Sprint Spectrum Co. LLC 3,360 % fällig am 20.03.2023	169	170	0,01
3,125 % fällig am 17.01.2024	\$ 500	729	0,02	SL Green Operating Partnership LP 1,136 % fällig am 16.08.2021	4.300	4.301	0,14	ZF North America Capital, Inc. 4,500 % fällig am 29.04.2022	1.600	1.641	0,05
7,750 % fällig am 15.09.2023 (g)(i)	\$ 200	220	0,01	SMBC Aviation Capital Finance DAC 2,650 % fällig am 15.07.2021	800	801	0,03				
BNP Paribas S.A. 1,323 % fällig am 13.01.2027	900	890	0,03	3,000 % fällig am 15.07.2022	1.900	1.944	0,06	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
Cooperative Rabobank UA 4,625 % fällig am 29.12.2025 (g)(i)	€ 3.000	3.916	0,13	3,550 % fällig am 15.04.2024	400	425	0,01	BG Energy Capital PLC 4,000 % fällig am 15.10.2021	400	404	0,01
Country Garden Holdings Co. Ltd. 7,125 % fällig am 27.01.2022	\$ 3.100	3.193	0,10	4,125 % fällig am 15.07.2023	2.500	2.660	0,09	Pacific Gas & Electric Co. 1,750 % fällig am 16.06.2022	5.512	5.510	0,18
Credit Suisse AG 0,250 % fällig am 05.01.2026	€ 2.200	2.618	0,09	Societe Generale S.A. 7,875 % fällig am 18.12.2023 (g)(i)	400	448	0,01	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 4,125 % fällig am 12.09.2025	5.000	5.540	0,18
6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)	\$ 11.500	12.731	0,41	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,130 % fällig am 08.07.2030	5.900	5.937	0,19	Sprint Corp. 7,250 % fällig am 15.09.2021	200	203	0,01
Credit Suisse Group AG 1,359 % fällig am 12.06.2024	4.400	4.469	0,14	UBS AG 7,625 % fällig am 17.08.2022 (i)	500	538	0,02	State Grid Overseas Investment Ltd. 3,750 % fällig am 02.05.2023	5.200	5.486	0,17
7,500 % fällig am 17.07.2023 (g)(i)	1.100	1.199	0,04	UBS Group AG 1,364 % fällig am 30.01.2027	2.200	2.186	0,07				
Dell Bank International DAC 0,625 % fällig am 17.10.2022	€ 600	719	0,02	4,375 % fällig am 10.02.2031 (g)(i)	1.200	1.229	0,04	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		305.506	9,87
Deutsche Bank AG 0,750 % fällig am 17.02.2027	3.400	4.060	0,13	VICI Properties LP 3,500 % fällig am 15.02.2025	400	409	0,01	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL			
1,375 % fällig am 17.02.2032	15.000	18.069	0,58	3,750 % fällig am 15.02.2027	500	510	0,02	California State General Obligation Bonds, Series 2017 0,866 % fällig am 01.04.2047	3.900	3.904	0,13
3,961 % fällig am 26.11.2025	\$ 2.900	3.137	0,10	4,125 % fällig am 15.08.2030	500	515	0,02	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
4,250 % fällig am 14.10.2021	10.100	10.210	0,33	Wells Fargo & Co. 0,625 % fällig am 25.03.2030	€ 2.400	2.818	0,09	Fannie Mae 0,762 % fällig am 25.03.2038	498	508	0,02
Discover Bank 4,650 % fällig am 13.09.2028	3.300	3.876	0,13	1,338 % fällig am 04.05.2025	1.220	1.500	0,05	1,028 % fällig am 25.11.2022	863	865	0,03
Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 01.12.2021	€ 100	119	0,00	1,741 % fällig am 04.05.2030	1.800	2.304	0,07	3,000 % fällig am 25.10.2040	1.071	1.137	0,04
1,068 % fällig am 12.10.2021	\$ 2.000	1.998	0,06	2,879 % fällig am 30.10.2030	\$ 1.400	1.484	0,05	6,269 % fällig am 25.03.2037 (a)	377	68	0,00
2,748 % fällig am 14.06.2024	€ 700	982	0,03	INDUSTRIEWERTE							
2,979 % fällig am 03.08.2022	\$ 900	915	0,03	Bayer U.S. Finance LLC 2,750 % fällig am 15.07.2021	400	400	0,01	Freddie Mac 0,550 % fällig am 15.07.2040	743	752	0,02
3,087 % fällig am 09.01.2023	1.000	1.021	0,03	BOC Aviation USA Corp. 1,625 % fällig am 29.04.2024	500	504	0,02	0,610 % fällig am 15.03.2042	289	293	0,01
3,096 % fällig am 04.05.2023	700	715	0,02	Broadcom, Inc. 3,419 % fällig am 15.04.2033	400	421	0,01	1,328 % fällig am 25.02.2045	22	23	0,00
3,350 % fällig am 01.11.2022	700	718	0,02	3,469 % fällig am 15.04.2034	1.000	1.059	0,04	2,144 % fällig am 01.06.2035	15	16	0,00
3,375 % fällig am 13.11.2025	500	519	0,02	Charter Communications Operating LLC 1,826 % fällig am 01.02.2024	6.700	6.890	0,22	2,364 % fällig am 01.09.2035	9	10	0,00
3,813 % fällig am 12.10.2021	200	202	0,01	4,500 % fällig am 01.02.2024	1.500	1.635	0,05	2,458 % fällig am 01.09.2037	571	609	0,02
4,140 % fällig am 15.02.2023	200	208	0,01	DAE Funding LLC 2,625 % fällig am 20.03.2025	1.700	1.734	0,06	2,575 % fällig am 01.05.2031	1	1	0,00
5,584 % fällig am 18.03.2024	400	439	0,01	3,375 % fällig am 20.03.2028	1.500	1.538	0,05	4,000 % fällig am 01.01.2048	2.872	3.073	0,10
General Motors Financial Co., Inc. 1,184 % fällig am 05.01.2023	300	303	0,01	Dongfeng Motor Hong Kong International Co. Ltd. 1,150 % fällig am 23.10.2021	€ 1.600	1.906	0,06	Ginnie Mae 0,781 % fällig am 20.04.2068	5.329	5.381	0,17
Harley-Davidson Financial Services, Inc. 2,550 % fällig am 09.06.2022	1.400	1.423	0,05	Heathrow Funding Ltd. 4,875 % fällig am 15.07.2023	\$ 300	300	0,01	0,807 % fällig am 20.10.2065	9	9	0,00
Horse Gallop Finance Ltd. 3,250 % fällig am 30.05.2022	5.800	5.905	0,19	IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK) 3,625 % fällig am 15.05.2025 (c)	€ 3.500	4.222	0,14	0,857 % fällig am 20.12.2065	1.633	1.659	0,05
HSBC Holdings PLC 1,750 % fällig am 24.07.2027	€ 3.300	4.613	0,15	Imperial Brands Finance PLC 3,500 % fällig am 11.02.2023	600	621	0,02	0,877 % fällig am 20.02.2066	17	17	0,00
2,633 % fällig am 07.11.2025	\$ 3.900	4.095	0,13	Marvell Technology, Inc. 4,200 % fällig am 22.06.2023	11.025	11.725	0,38	0,907 % fällig am 20.01.2066	297	302	0,01
2,848 % fällig am 04.06.2031	1.300	1.351	0,04	Microchip Technology, Inc. 0,983 % fällig am 01.09.2024	700	697	0,02	1,031 % fällig am 20.06.2067	978	995	0,03
Lloyds Banking Group PLC 2,250 % fällig am 16.10.2024	€ 100	144	0,01	Micron Technology, Inc. 5,327 % fällig am 06.02.2029	200	242	0,01	1,107 % fällig am 20.01.2066	4.927	5.048	0,16
4,550 % fällig am 16.08.2028	\$ 1.100	1.284	0,04	Nissan Motor Co. Ltd. 3,043 % fällig am 15.09.2023	2.600	2.713	0,09	1,257 % fällig am 20.03.2066	516	531	0,02
Logicor Financing SARL 2,250 % fällig am 13.05.2025	€ 6.000	7.632	0,25	3,522 % fällig am 17.09.2025	2.000	2.137	0,07	2,125 % fällig am 20.10.2029	12	13	0,00
Nationwide Building Society 4,363 % fällig am 01.08.2024	\$ 2.400	2.576	0,08	4,345 % fällig am 17.09.2027	1.600	1.760	0,06	2,250 % fällig am 20.08.2024 - 20.07.2027	24	24	0,00
Natwest Group PLC 1,697 % fällig am 25.06.2024	€ 6.500	6.650	0,22	US-SCHATZ Obligationen							
2,000 % fällig am 04.03.2025	€ 5.400	6.736	0,22	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049	13.000	15.568	0,50	2,875 % fällig am 20.04.2026 - 20.04.2041	219	230	0,01
Nissan Motor Acceptance Corp. 1,900 % fällig am 14.09.2021	\$ 2.800	2.808	0,09	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f) 0,125 % fällig am 15.07.2030	7.914	8.738	0,28	3,000 % fällig am 20.05.2047	1.061	1.085	0,04
2,600 % fällig am 28.09.2022	1.200	1.225	0,04	Uniform Mortgage-Backed Security 1,328 % fällig am 01.07.2044	3	3	0,00	1,328 % fällig am 01.10.2034	1	1	0,00
2,650 % fällig am 13.07.2022	2.900	2.949	0,10	1,766 % fällig am 01.10.2034	1	1	0,00	1,898 % fällig am 01.11.2035	4	4	0,00
3,650 % fällig am 21.09.2021	1.000	1.007	0,03	2,180 % fällig am 01.07.2035	4	4	0,00	2,183 % fällig am 01.09.2035	11	12	0,00
				2,183 % fällig am 01.09.2035	11	12	0,00	2,259 % fällig am 01.05.2038	292	309	0,01
				2,418 % fällig am 01.01.2036	434	462	0,02	2,418 % fällig am 01.01.2036	46	57	0,00
				6,500 % fällig am 01.10.2036	46	57	0,00				
										23.501	0,76

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
0,625 % fällig am 15.02.2043	\$ 581	\$ 695	0,02	London Wall Mortgage Capital PLC	£ 400	\$ 555	0,02	Blackrock European CLO DAC	€ 1.350	\$ 1.594	0,05
0,750 % fällig am 15.07.2028	7.658	8.792	0,29	0,799 % fällig am 15.05.2051				0,620 % fällig am 15.10.2031			
0,750 % fällig am 15.02.2045	1.134	1.401	0,05					BlueMountain Fuji EUR CLO DAC			
1,000 % fällig am 15.02.2046	3.380	4.425	0,14	Luminent Mortgage Trust	\$ 206	199	0,01	0,650 % fällig am 15.07.2030	560	666	0,02
1,000 % fällig am 15.02.2049	7.077	9.546	0,31	0,492 % fällig am 25.10.2046							
1,375 % fällig am 15.02.2044	6.530	9.024	0,29	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				Cain CLO BV	1.200	1.420	0,05
U.S. Treasury Notes				0,553 % fällig am 15.06.2030	8	8	0,00	0,600 % fällig am 30.04.2031	500	593	0,02
1,375 % fällig am 30.09.2023	68.980	70.656	2,28	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0,670 % fällig am 31.01.2030	600	711	0,02
1,625 % fällig am 15.02.2026	1.100	1.141	0,04	0,512 % fällig am 25.02.2036	10	10	0,00	0,780 % fällig am 15.10.2031			
2,000 % fällig am 30.04.2024	1.800	1.880	0,06	0,552 % fällig am 25.04.2029	214	213	0,01	Carlyle Euro CLO DAC			
2,625 % fällig am 31.12.2025	3.800	4.109	0,13	0,592 % fällig am 25.11.2035	6	6	0,00	0,700 % fällig am 15.01.2031	800	949	0,03
2,875 % fällig am 30.09.2023	8.180	8.654	0,28	0,839 % fällig am 25.12.2029	183	179	0,01	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC			
2,875 % fällig am 30.11.2023	7.120	7.557	0,25	1,671 % fällig am 25.12.2032	1	1	0,00	0,750 % fällig am 15.11.2031	800	945	0,03
3,000 % fällig am 30.09.2025	9.600	10.511	0,34	2,116 % fällig am 25.12.2034	8	8	0,00	Catamaran CLO Ltd.	\$ 1.349	1.349	0,04
3,000 % fällig am 31.10.2025	9.600	10.519	0,34	Mortimer BTL PLC	£ 600	830	0,03	1,031 % fällig am 27.01.2028			
		199.928	6,46	0,750 % fällig am 23.06.2053				CBAM CLO Ltd.	1.100	1.101	0,04
NON-AGENCY-MBS				Prime Mortgage Trust	\$ 31	30	0,00	1,308 % fällig am 20.10.2029			
American Home Mortgage Assets Trust				0,492 % fällig am 25.02.2034				Chase Funding Trust	3	3	0,00
0,472 % fällig am 25.09.2046 ^	132	128	0,00	Primrose Residential	€ 2.683	3.182	0,10	0,832 % fällig am 25.10.2032			
Banc of America Funding Trust				0,200 % fällig am 24.03.2061				CIT Mortgage Loan Trust	2.731	2.760	0,09
2,707 % fällig am 20.02.2036	22	22	0,00	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust	\$ 532	403	0,01	1,442 % fällig am 25.10.2037			
2,852 % fällig am 25.05.2035	3	3	0,00	3,148 % fällig am 25.09.2035 ^				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.	1.963	1.982	0,06
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				Ripon Mortgages PLC	£ 37.512	51.936	1,68	1,742 % fällig am 25.07.2037			
2,375 % fällig am 25.01.2034	1	1	0,00	0,881 % fällig am 20.08.2056				Countrywide Asset-Backed Certificates	843	835	0,03
2,742 % fällig am 25.01.2034	8	8	0,00	Sequoia Mortgage Trust	\$ 414	425	0,01	0,232 % fällig am 25.08.2037	149	145	0,00
2,829 % fällig am 25.02.2033	0	0	0,00	0,693 % fällig am 20.12.2034				0,492 % fällig am 25.08.2034			
Bear Stearns ALT-A Trust				Southern Pacific Financing PLC	£ 93	128	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.	4	4	0,00
2,578 % fällig am 25.07.2035	1.192	982	0,03	0,264 % fällig am 10.06.2043				0,712 % fällig am 25.01.2032			
2,667 % fällig am 25.01.2036 ^	70	70	0,00	Stratton Mortgage Funding PLC	4.900	6.771	0,22	CVC Cordatus Loan Fund DAC	€ 900	1.063	0,03
3,008 % fällig am 25.09.2035 ^	8	6	0,00	0,749 % fällig am 12.12.2043				0,630 % fällig am 15.09.2031	8.800	10.441	0,34
3,115 % fällig am 25.11.2036	4.454	3.413	0,11	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust	\$ 24	23	0,00	0,650 % fällig am 21.07.2030	2.450	2.912	0,09
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				2,537 % fällig am 25.02.2034				0,650 % fällig am 15.10.2031			
0,262 % fällig am 25.06.2047	433	414	0,01	Structured Asset Mortgage Investments Trust	868	876	0,03	Denali Capital CLO LLC	\$ 1.779	1.782	0,06
0,272 % fällig am 25.10.2036	1.937	1.849	0,06	0,272 % fällig am 25.09.2047	21	21	0,00	1,226 % fällig am 26.10.2027			
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				0,593 % fällig am 19.07.2035	16	15	0,00	Dryden Euro CLO BV	€ 1.500	1.773	0,06
2,986 % fällig am 26.12.2046 ^	642	564	0,02	0,652 % fällig am 25.02.2036 ^	69	68	0,00	0,660 % fällig am 15.04.2033	1.000	1.186	0,04
3,227 % fällig am 26.01.2036 ^	2.644	2.267	0,07	1,516 % fällig am 25.12.2035 ^				0,860 % fällig am 15.05.2034 (b)			
Bruegel DAC				Taurus DEU DAC	€ 7.200	8.563	0,28	Dryden Senior Loan Fund	\$ 2.205	2.205	0,07
0,800 % fällig am 22.05.2031	€ 300	356	0,01	1,200 % fällig am 22.12.2030				1,084 % fällig am 15.10.2027			
Canada Square Funding PLC				Taurus UK DAC	£ 600	831	0,03	Euro-Galaxy CLO DAC	€ 2.100	2.487	0,08
0,829 % fällig am 17.06.2058 (b)	£ 3.200	4.429	0,14	0,899 % fällig am 17.05.2031				0,620 % fällig am 24.04.2034			
Citigroup Mortgage Loan Trust				Thornburg Mortgage Securities Trust	\$ 506	516	0,02	Gallatin CLO Ltd.	\$ 708	708	0,02
2,470 % fällig am 25.05.2035	\$ 3	3	0,00	0,732 % fällig am 25.09.2043				1,236 % fällig am 21.01.2028			
2,480 % fällig am 25.10.2035 ^	56	59	0,00	Towd Point Mortgage Funding PLC	£ 28.009	38.825	1,26	Griffith Park CLO DAC	€ 11.600	13.705	0,44
2,996 % fällig am 25.08.2035 ^	86	73	0,00	0,949 % fällig am 20.07.2045	5.041	7.001	0,23	0,720 % fällig am 21.11.2031			
Commercial Mortgage Trust				1,111 % fällig am 20.10.2051	332	461	0,02	GSAMP Trust	\$ 1.153	745	0,02
4,389 % fällig am 10.07.2045	1.000	1.063	0,04	1,249 % fällig am 20.02.2054				0,232 % fällig am 25.12.2036	1.302	1.299	0,04
Countrywide Alternative Loan Trust				Trinity Square PLC	23.800	32.936	1,07	0,572 % fällig am 25.03.2046			
0,252 % fällig am 25.02.2047	99	92	0,00	0,899 % fällig am 15.07.2059				Harvest CLO DAC	€ 1.200	1.422	0,05
0,288 % fällig am 20.12.2046 ^	76	67	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	\$ 9	9	0,00	0,640 % fällig am 15.10.2031	400	474	0,02
1,116 % fällig am 25.12.2035	933	858	0,03	0,632 % fällig am 25.12.2045	5	5	0,00	0,650 % fällig am 26.06.2030	900	1.070	0,03
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				0,672 % fällig am 25.10.2045	3	3	0,00	0,760 % fällig am 15.07.2031	2.050	2.429	0,08
0,098 % fällig am 25.06.2032	0	0	0,00	1,316 % fällig am 25.11.2042	4	4	0,00	0,960 % fällig am 20.10.2031			
0,714 % fällig am 25.03.2032	2	2	0,00	1,516 % fällig am 25.08.2042	6	6	0,00	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust	\$ 1.089	1.082	0,03
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				1,593 % fällig am 27.02.2034	8	9	0,00	0,352 % fällig am 25.06.2037	610	590	0,02
3,850 % fällig am 25.09.2057	10.420	10.868	0,35	2,409 % fällig am 25.03.2034	33	33	0,00	0,372 % fällig am 25.03.2047			
European Loan Conduit				3,076 % fällig am 25.08.2046 ^				Jubilee CLO BV	€ 1.874	2.216	0,07
1,000 % fällig am 17.02.2030	€ 2.797	3.332	0,11	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				0,252 % fällig am 15.12.2029	400	473	0,02
Finsbury Square PLC				Aqueduct European CLO DAC	€ 2.500	2.970	0,10	0,600 % fällig am 15.04.2030	1.000	1.186	0,04
1,052 % fällig am 16.06.2069	£ 1.045	1.448	0,05	0,640 % fällig am 20.07.2030				0,610 % fällig am 15.04.2030	1.200	1.421	0,05
FirstMac Mortgage Funding Trust				Ares European CLO DAC	1.200	1.422	0,05	0,650 % fällig am 15.04.2031			
0,881 % fällig am 08.03.2049	\$ 425	425	0,01	0,660 % fällig am 15.10.2030	1.000	1.186	0,04	KVK CLO Ltd.	\$ 1.827	1.828	0,06
GreenPoint Mortgage Funding Trust				0,780 % fällig am 15.10.2031				1,086 % fällig am 14.01.2028			
0,632 % fällig am 25.11.2045	77	70	0,00	Armada Euro CLO DAC	1.400	1.657	0,05	Laurelin DAC	€ 1.100	1.303	0,04
GS Mortgage Securities Corp. Trust				0,720 % fällig am 15.07.2031				0,720 % fällig am 20.10.2031			
4,074 % fällig am 10.01.2047	9.886	10.590	0,34	Atlas Senior Loan Fund Ltd.	\$ 3.876	3.876	0,13	LCM LP	\$ 2.072	2.072	0,07
GSR Mortgage Loan Trust				1,058 % fällig am 20.04.2028				1,228 % fällig am 20.10.2027			
0,442 % fällig am 25.01.2034	1	1	0,00	Bain Capital Euro DAC	€ 700	829	0,03	Long Beach Mortgage Loan Trust	5	4	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				0,740 % fällig am 20.01.2032				0,652 % fällig am 25.10.2034			
0,533 % fällig am 19.05.2035	27	26	0,00	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust	\$ 1.769	1.771	0,06	Mackay Shields Euro CLO DAC	€ 900	1.069	0,03
2,562 % fällig am 19.08.2036 ^	35	36	0,00	0,737 % fällig am 25.12.2035				1,550 % fällig am 15.08.2033			
Hawksmoor Mortgages PLC				Black Diamond CLO DAC	€ 822	976	0,03	Madison Park Euro Funding DAC	24.700	29.333	0,95
1,099 % fällig am 25.05.2053	£ 8.725	12.115	0,39	0,650 % fällig am 03.10.2029	1.000	1.187	0,04	0,750 % fällig am 15.01.2032			
Impac CMB Trust				0,860 % fällig am 20.01.2032	\$ 705	705	0,02	Man GLG Euro CLO	2.200	2.611	0,08
0,852 % fällig am 25.10.2033	\$ 0	0	0,00	1,244 % fällig am 03.10.2029				0,900 % fällig am 15.10.2032			
Lehman XS Trust											
0,452 % fällig am 25.11.2035	3.529	3.325	0,11								

Aufstellung der Wertpapieranlagen StocksPLUS™ Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Man GLG Euro CLO DAC 0,680 % fällig am 15.10.2030 0,690 % fällig am 15.12.2031 0,870 % fällig am 15.01.2030	€ 700	\$ 831	0,03	Tymon Park CLO DAC 1,050 % fällig am 21.01.2029	€ 3.100	\$ 3.674	0,12	ISRAEL TREASURY BILLS 0,000 % fällig am 06.04.2022 (d)(e)	ILS 38.000	\$ 11.661	0,38
Marathon CLO Ltd. 1,019 % fällig am 21.11.2027	\$ 1.007	1.008	0,03	Utah State Board of Regents 0,842 % fällig am 25.01.2057	\$ 1.655	1.647	0,05	0,006 % fällig am 08.08.2022 (d)(e)	5.700	1.749	0,06
MidOcean Credit CLO 0,984 % fällig am 15.04.2027	44	44	0,00	Venture CLO Ltd. 1,064 % fällig am 15.04.2027	8.219	8.205	0,26	0,011 % fällig am 06.04.2022 (d)(e)	1.600	491	0,01
Navient Student Loan Trust 1,142 % fällig am 27.12.2066	3.894	3.964	0,13	WhiteHorse Ltd. 1,120 % fällig am 17.04.2027	424	424	0,01	U.S. TREASURY BILLS 0,005 % fällig am 08.07.2021 (d)(e)	\$ 40.000	40.000	1,29
OAK Hill European Credit Partners DAC 0,740 % fällig am 20.10.2031	€ 1.900	2.250	0,07	Wind River CLO Ltd. 1,054 % fällig am 15.10.2027	474	474	0,02	0,005 % fällig am 20.07.2021 (d)(e)	250.000	249.994	8,08
Oak Hill European Credit Partners Ltd. 0,900 % fällig am 22.07.2030	350	416	0,01	Z Capital Credit Partners CLO Ltd. 1,134 % fällig am 16.07.2027	843	844	0,03	0,010 % fällig am 14.09.2021 (d)(e)(j)	50.000	49.996	1,61
OCP CLO Ltd. 0,984 % fällig am 15.07.2027 0,996 % fällig am 26.10.2027 1,308 % fällig am 20.07.2029	\$ 171 1.461 1.100	171 1.462 1.101	0,01 0,05 0,04	Zais CLO Ltd. 1,334 % fällig am 15.04.2028	2.692	2.696	0,09	0,015 % fällig am 26.08.2021 (d)(e)	120.000	119.993	3,88
Option One Mortgage Loan Trust 0,312 % fällig am 25.04.2037	2.543	2.041	0,07			198.306	6,41	0,027 % fällig am 28.10.2021 (d)(e)(j)	3.600	3.599	0,12
OZLM Ltd. 1,236 % fällig am 30.04.2027 1,266 % fällig am 30.07.2027	1.564 5.248	1.564 5.249	0,05 0,17	STAATSEMISSIONEN Israel Government International Bond 0,750 % fällig am 31.07.2022	ILS 11.900	3.681	0,12	0,042 % fällig am 05.10.2021 (d)(e)	31.200	31.197	1,01
Palmer Square Loan Funding Ltd. 1,056 % fällig am 15.11.2026	1.706	1.707	0,05	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028	¥ 3.279.055	30.312	0,98	0,044 % fällig am 23.09.2021 (d)(e)	33.500	33.496	1,08
Pepper SPARKZ Trust No. 3 1,062 % fällig am 17.08.2028	AUD 4.017	3.033	0,10	Oman Government International Bond 3,875 % fällig am 08.03.2022	\$ 2.000	2.030	0,06	0,046 % fällig am 23.09.2021 (d)(e)	7.200	7.199	0,23
Segovia European CLO DAC 0,880 % fällig am 20.07.2032 (b)	€ 1.200	1.423	0,05	Saudi Government International Bond 2,900 % fällig am 22.10.2025	1.700	1.822	0,06	0,047 % fällig am 19.10.2021 (d)(e)	49.300	49.292	1,59
SLM Student Loan Trust 0,000 % fällig am 17.06.2024	8	10	0,00			37.845	1,22	Summe kurzfristige Instrumente		584.766	18,89
South Carolina Student Loan Corp. 1,135 % fällig am 03.09.2024	\$ 51	51	0,00	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE Federal Home Loan Bank 0,020 % fällig am 15.05.2048	20.200	20.200	0,65	Summe übertragbare Wertpapiere	\$	1.710.044	55,26
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 1,067 % fällig am 25.12.2035	238	238	0,01	KURZFRISTIGE SCHULDITITEL 0,030 % fällig am 14.07.2021 (d)(e)	70.000	69.999	2,26	AKTIEN INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
TICP CLO Ltd. 1,028 % fällig am 20.04.2028	6.311	6.310	0,20	0,030 % fällig am 15.07.2021 (d)(e)	10.000	10.000	0,33	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	27.925.476	278.166	8,99
Toro European CLO DAC 0,650 % fällig am 15.04.2030	€ 3.500	4.150	0,13	0,030 % fällig am 27.07.2021 (d)(e)	20.000	20.000	0,65	Summe Investmentfonds	\$	278.166	8,99
Towd Point Mortgage Trust 2,750 % fällig am 25.10.2057	\$ 10.262	10.517	0,34	Pacific Gas and Electric Co. 1,531 % fällig am 15.11.2021	8.100	8.117	0,26				
Tralee CLO Ltd. 1,298 % fällig am 20.10.2028	8.376	8.378	0,27			128.316	4,15				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BOS	0,040 %	29.06.2021	06.07.2021	\$ 200.000	U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.05.2048	\$ (205.371)	\$ 200.000	\$ 200.000	6,46
BPS	0,040	30.06.2021	01.07.2021	225.000	Ginnie Mae 3,500 % – 4,000 % fällig am 20.09.2044 – 20.06.2049	(231.888)	225.000	225.000	7,27
DEU	0,030	30.06.2021	01.07.2021	130.000	U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.08.2044	(134.809)	130.000	130.000	4,20
GSC	0,030	30.06.2021	01.07.2021	191.500	Fannie Mae 2,500 % fällig am 01.07.2051	(200.574)	191.500	191.500	6,19
MFK	0,030	30.06.2021	01.07.2021	250.000	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029	(255.661)	250.000	250.000	8,08
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.028.303)	\$ 996.500	\$ 996.500	32,20

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 173,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	100	\$ (19)	0,00
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2021	5.956	16.837	0,54
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	50	(66)	0,00

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 171,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	100	\$ 13	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2021	734	225	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	1.936	(547)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	2.106	(1.517)	(0,05)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	311	1.452	0,05
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	271	(2.469)	(0,08)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	7	(12)	0,00
				\$ 13.897	0,45

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call – CBOT U.S. Treasury 5-Year Note August 2021 Futures	\$ 123,500	23.07.2021	485	\$ (122)	\$ (112)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 13.785	0,44

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 1.100	\$ 3	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2021	1.900	(11)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.06.2022	700	(4)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2022	600	3	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	1.000	2	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.12.2022	400	1	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	800	1	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	800	6	0,00
Kinder Morgan, Inc.	1,000	20.12.2021	100	0	0,00
				\$ 1	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 8.200	\$ (37)	0,00
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	6.100	62	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000	20.12.2025	2.600	20	0,00
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	16.000	175	0,01
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	5.700	12	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	101.000	243	0,01
iTraxx Crossover 35 5-Year Index	5,000	20.06.2026	€ 23.000	317	0,01
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	27.400	49	0,00
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	67.200	91	0,00
				\$ 932	0,03

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2031	£ 19.900	\$ 72	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	7.700	(44)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	0,636	21.12.2023	CAD 28.700	(188)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	0,637	21.12.2023	34.400	(225)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	0,375	06.07.2024	\$ 404.200	(2.380)	(0,08)
Zahlung ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	0,407	21.07.2024	182.400	(979)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	181.800	1.545	0,05
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	40.600	240	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	96.900	104	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	17.06.2023	284.900	1.622	0,05
Erhalt ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,219	06.07.2031	94.600	1.906	0,06
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025	107.800	2.277	0,08
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	220.900	(11.973)	(0,39)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	13.000	(782)	(0,02)
Erhalt ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,277	21.07.2031	39.000	597	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen StocksPLUS™ Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625 %	06.01.2030	\$ 13.600	\$ 654	0,02	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	22.01.2050	5.100	688	0,02	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,875	07.02.2050	300	42	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.01.2050	900	125	0,01	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.03.2050	1.900	272	0,01	
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 21.100	(14)	0,00	
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	7.700	55	0,00	
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,380	18.06.2028	¥ 3.070.000	190	0,01	
Erhalt	CPTFEMU	1,135	15.02.2026	€ 53.800	1.930	0,06	
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	£ 44.200	(1.328)	(0,04)	
						\$ (5.594)	(0,18)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (4.661)	(0,15)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BRC	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,350 %	01.11.2021	214.100	\$ 520	\$ 462	0,01

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	\$ 100,156	05.08.2021	2.500	\$ 23	\$ 8	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000 %	20.10.2021	700	\$ (3)	\$ (2)	0,00
BPS	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	600	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	2.100	(3)	(2)	0,00
BRC	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	1.200	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	7.300	(11)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	1.200	(1)	0	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.400	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	2.800	(3)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	1.600	(2)	(1)	0,00
DUB	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	5.700	(6)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.700	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	3.000	(3)	(3)	0,00
FBF	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	1.200	(1)	0	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	1.300	(1)	0	0,00
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	7.700	(8)	(5)	0,00
	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	2.700	(3)	(2)	0,00
JPM	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	2.200	(3)	(2)	0,00
	Put – OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	1.600	(2)	(1)	0,00
						\$ (56)	\$ (25)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BRC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,122 %	01.11.2021	13.900	\$ (166)	\$ (26)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,164	01.11.2021	28.500	(363)	(40)	0,00
						\$ (529)	\$ (66)	0,00	

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
FAR	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	\$ 102,297	05.08.2021	4.700	\$ (17)	\$ (7)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,797	05.08.2021	4.700	(14)	(6)	0,00
GSC	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,367	05.08.2021	600	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,023	07.09.2021	1.300	(8)	(5)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,023	07.09.2021	1.300	(6)	(7)	0,00
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	102,234	12.08.2021	2.500	(8)	(4)	0,00
	Put – OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	5.000	(31)	(8)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	700	(2)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	700	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	1.100	(2)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,695	07.09.2021	900	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	900	(3)	(2)	0,00
					\$ (97)	\$ (45)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
CBK	AXA Equitable Holdings, Inc.	1,000 %	20.06.2023	\$ 3.000	\$ (81)	\$ 113	\$ 32	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2025	3.500	61	22	83	0,00
					\$ (20)	\$ 135	\$ 115	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	20.268	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 175.889	21.07.2021	\$ 0	\$ 5.285	\$ 5.285	0,17
BPS	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	12.026	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	101.766	07.07.2021	0	5.702	5.702	0,18
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	10.820	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	93.629	13.10.2021	0	3.064	3.064	0,10
BRC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	1	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	45.789	04.08.2021	0	3.873	3.873	0,13
CBK	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	22.039	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	181.568	15.09.2021	0	15.366	15.366	0,50
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	20.753	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	170.973	23.02.2022	0	14.614	14.614	0,47
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	15.070	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	130.405	20.04.2022	0	4.233	4.233	0,14
FAR	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	24.542	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	202.189	07.07.2021	0	17.132	17.132	0,55
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	5.558	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	45.789	04.08.2021	0	3.873	3.873	0,13
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	7.445	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	61.327	16.03.2022	0	5.167	5.167	0,17
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	32.517	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	286.963	22.06.2022	0	3.808	3.808	0,12
GST	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	1	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	17.828	23.02.2022	0	1.503	1.503	0,05
HUS	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	3.943	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	34.597	08.06.2022	0	656	656	0,02
RBC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	22.650	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	196.802	18.05.2022	0	5.680	5.680	0,18
							\$ 0	\$ 89.956	\$ 89.956	2,91

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2021	\$ 337	RUB 25.326	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
	09.2021	746	54.402	0	(9)	(9)	0,00
BPS	07.2021	DKK 1.845	\$ 295	1	0	1	0,00
	07.2021	£ 237	329	2	0	2	0,00
	07.2021	NZD 212	154	6	0	6	0,00
	07.2021	\$ 1.275	€ 1.068	0	(9)	(9)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen StocksPLUS™ Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
	07.2021	\$ 28	TRY 241	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	08.2021	AUD 5.582	\$ 4.358	167	0	167	0,01
	08.2021	\$ 6.800	MXN 145.028	454	0	454	0,01
	11.2021	MXN 7.067	\$ 350	1	0	1	0,00
BRC	07.2021	¥ 3.458.900	31.625	461	0	461	0,02
	07.2021	\$ 5	TRY 45	0	0	0	0,00
CBK	07.2021	DKK 1.656	\$ 263	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	\$ 12.280	CAD 15.102	0	(84)	(84)	0,00
	07.2021	278	RUB 21.456	15	0	15	0,00
	08.2021	CAD 15.102	\$ 12.279	84	0	84	0,00
	08.2021	\$ 307	RUB 23.088	7	0	7	0,00
	09.2021	5.623	ZAR 77.327	0	(258)	(258)	(0,01)
	04.2022	ILS 39.600	\$ 12.101	0	(106)	(106)	0,00
	06.2022	5.700	1.759	0	0	0	0,00
	08.2022	12.075	3.723	0	(7)	(7)	0,00
DUB	08.2021	\$ 16	COP 58.665	0	0	0	0,00
GLM	07.2021	BRL 26.507	€ 4.489	40	0	40	0,00
	07.2021	€ 4.085	BRL 26.507	438	0	438	0,01
	07.2021	£ 111.201	\$ 157.208	3.590	0	3.590	0,12
	07.2021	\$ 5.222	BRL 26.299	19	0	19	0,00
	07.2021	557	RUB 43.009	30	0	30	0,00
	07.2021	8	TRY 64	0	0	0	0,00
	08.2021	BRL 26.299	\$ 5.205	0	(19)	(19)	0,00
	08.2021	€ 4.471	BRL 26.507	0	(41)	(41)	0,00
	08.2021	\$ 690	RUB 51.232	8	(2)	6	0,00
	09.2021	TWD 519.341	\$ 18.956	229	0	229	0,01
	09.2021	\$ 949	RUB 69.540	0	(7)	(7)	0,00
	09.2021	2.722	ZAR 37.472	0	(122)	(122)	0,00
HUS	07.2021	€ 1.705	\$ 2.034	12	0	12	0,00
	07.2021	£ 11.560	16.366	396	0	396	0,01
	07.2021	\$ 170.244	£ 122.998	0	(329)	(329)	(0,01)
	08.2021	£ 120.578	\$ 166.902	315	0	315	0,01
	08.2021	\$ 692	RUB 52.102	16	0	16	0,00
	09.2021	391	28.644	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07.2021	140	TRY 1.232	0	0	0	0,00
	09.2021	7.220	IDR 104.062.689	0	(126)	(126)	0,00
MYI	07.2021	BRL 26.299	\$ 4.912	0	(330)	(330)	(0,01)
	07.2021	€ 15.114	18.027	103	0	103	0,00
	07.2021	\$ 276	RUB 21.115	13	0	13	0,00
	08.2021	1.069	AUD 1.370	0	(40)	(40)	0,00
SCX	07.2021	CAD 322	\$ 259	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	€ 177.368	216.984	6.644	0	6.644	0,21
	12.2021	\$ 18.745	SGD 24.815	0	(292)	(292)	(0,01)
SOG	07.2021	316	RUB 24.507	19	0	19	0,00
	08.2021	384	28.954	10	0	10	0,00
TOR	07.2021	CAD 14.780	\$ 12.233	298	0	298	0,01
UAG	07.2021	€ 631	768	19	0	19	0,00
	07.2021	\$ 409	MXN 8.205	2	0	2	0,00
	07.2021	923	RUB 70.707	42	0	42	0,00
	09.2021	386	28.299	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 13.449	\$ (1.790)	\$ 11.659	0,38

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2021	€ 340	\$ 409	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
BPS	07.2021	7.713	9.351	204	0	204	0,01
	07.2021	\$ 223.101	€ 182.368	0	(6.831)	(6.831)	(0,22)
BRC	07.2021	24	20	0	(1)	(1)	0,00
HUS	07.2021	€ 349	\$ 416	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 1.056	€ 874	0	(19)	(19)	0,00
MYI	07.2021	17.432	14.642	0	(68)	(68)	0,00
SCX	07.2021	261.288	213.581	0	(8.002)	(8.002)	(0,26)
TOR	07.2021	261.288	213.581	0	(8.002)	(8.002)	(0,26)
UAG	07.2021	€ 1.104	\$ 1.343	34	0	34	0,00
				\$ 246	\$ (22.923)	\$ (22.677)	(0,73)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 81	£ 59	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
MYI	07.2021	\$ 81	£ 59	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	£ 63	\$ 87	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 81	£ 59	0	0	0	0,00
	08.2021	87	63	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 79.386	2,57
Summe Anlagen						\$ 3.073.220	99,31
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 21.495	0,69
Nettovermögen						\$ 3.094.715	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(h) Mit dem Fonds verbunden.

(i) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.623 und Barmittel in Höhe von USD 6.730 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 92.083 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.710.044	\$ 0	\$ 1.710.044
Investmentfonds	278.166	0	0	278.166
Pensionsgeschäfte	0	996.500	0	996.500
Finanzderivate ⁽³⁾	16.753	71.757	0	88.510
Summen	\$ 294.919	\$ 2.778.301	\$ 0	\$ 3.073.220

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.725.827	\$ 0	\$ 2.725.827
Investmentfonds	317.877	0	0	317.877
Pensionsgeschäfte	0	928.169	0	928.169
Finanzderivate ⁽³⁾	28.846	131.530	0	160.376
Summen	\$ 346.723	\$ 3.785.526	\$ 0	\$ 4.132.249

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 5.287	\$ (4.990)	\$ 297
BPS	2.758	(3.560)	(802)
BRC	4.723	(4.300)	423
CBK	33.978	(32.939)	1.039
DUB	(5)	0	(5)
FAR	29.967	(28.910)	1.057
GLM	4.163	(3.840)	323
GSC	(13)	0	(13)
GST	1.496	(1.470)	26
HUS	1.046	(858)	188
JPM	(140)	0	(140)
MYC	0	(860)	(860)
MYI	(322)	262	(60)
RBC	5.680	(5.340)	340
SCX	(1.651)	1.361	(290)
SOG	29	0	29
TOR	(7.704)	6.730	(974)
UAG	94	0	94

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	28,79	22,23
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	26,34	54,64
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,13	0,16
Investmentfonds	8,99	8,98
Pensionsgeschäfte	32,20	26,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,44	0,82
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,15)	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate	2,57	3,65

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	9,87	9,75
Kommunalanleihen und Wechsel	0,13	0,11
US-Regierungsbehörden	0,76	4,95
US-Schatzobligationen	6,46	10,55
Non-Agency-MBS	6,92	3,99
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,41	4,52
Staatsemissionen	1,22	1,73
Kurzfristige Instrumente	23,49	41,43
Investmentfonds	8,99	8,98
Pensionsgeschäfte	32,20	26,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,45	0,82
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,03	0,00
Zinsswaps	(0,18)	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,01	0,42
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	0,00	(0,32)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Total Return Swaps auf Indizes	2,91	3,31
Devisenterminkontrakte	0,38	(0,14)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,73)	0,37
Sonstige Aktiva und Passiva	0,69	(16,77)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				US-SCHATZOBIGATIONEN				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSELBANKEN UND FINANZEN				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				1,342 % fällig am 25.08.2037			
China Construction Bank New Zealand Ltd.	\$	100	0,95	4,000 % fällig am 01.08.2051	\$	700	7,12	\$	35	35	0,33
CPI Property Group S.A.	€	100	1,23	NON-AGENCY-MBS				Contego CLO DAC			
Dell Bank International DAC		100	1,14	Banc of America Alternative Loan Trust				0,640 % fällig am 23.01.2030			
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$	50	0,49	Banc of America Mortgage Trust				€			
Park Aerospace Holdings Ltd.		50	0,50	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				€			
QNB Finance Ltd.		200	1,92	Chase Mortgage Finance Trust				€			
VICI Properties LP		100	0,97	Countrywide Alternative Loan Trust				€			
Wells Fargo & Co.	€	100	1,17	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				€			
			8,37	GSR Mortgage Loan Trust				€			
INDUSTRIEWERTE				STAAITSEMISSIONEN				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
Aker BP ASA	\$	150	1,51	Precise Mortgage Funding PLC				U.S. TREASURY BILLS			
AP Moller - Maersk A/S		25	0,26	Pretium Mortgage Credit Partners LLC				0,020 % fällig am 10.08.2021 (a)(b)			
Boeing Co.		104	1,04	Structured Asset Mortgage Investments Trust				0,032 % fällig am 23.09.2021 (a)(b)			
Expedia Group, Inc.		44	0,49	Structured Asset Securities Corp.				0,046 % fällig am 20.07.2021 (a)(b)			
Fairstone Financial, Inc.		12	0,11	Vericrest Opportunity Loan Transferee				0,047 % fällig am 13.07.2021 (a)(b)			
T-Mobile USA, Inc.		100	0,96	Ares European CLO DAC				Summe kurzfristige Instrumente			
			4,37	Armada Euro CLO DAC				Summe Übertragbare Wertpapiere			
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				AKTIEN			
Pacific Gas & Electric Co.		5	0,05	Ares European CLO DAC				INVESTMENTFONDS			
Sprint Corp.		150	1,46	Freddie Mac				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
			1,51	Freddie Mac				BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			14,25	Freddie Mac				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)			
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				AKTIEN				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)			
Freddie Mac		63	0,60	Summe Investmentfonds				\$ 1.004 9,58			
				PENSIONSGESCHÄFTE							

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	0,030 %	30.06.2021	01.07.2021	\$ 1.900	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.08.2028	\$ (1.941)	\$ 1.900	\$ 1.900	18,12
	0,040	30.06.2021	01.07.2021	1.000	Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.07.2049	(1.023)	1.000	1.000	9,54
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (2.964)	\$ 2.900	\$ 2.900	27,66

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 173,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	1	\$ 0	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 171,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2021 Futures ⁽¹⁾	Short	07.2021	1	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2021	3	\$ (1)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	5	(1)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	5	4	0,04
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	1	6	0,05
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	2	(19)	(0,18)
				<u>\$ (11)</u>	<u>(0,11)</u>

(1) Future-Style-Option.

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call – CBOT U.S. Treasury 5-Year Note August 2021 Futures	\$ 123,500	23.07.2021	4	\$ (1)	\$ (1)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					<u>\$ (12)</u>	<u>(0,12)</u>

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Boeing Co.	1,000 %	20.12.2021	\$ 100	\$ 0	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000 %	20.06.2026	\$ 100	\$ 1	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	100	2	0,02
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	800	2	0,02
iTraxx Crossover 35 5-Year Index	5,000	20.06.2026	€ 100	2	0,02
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	400	1	0,01
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	300	1	0,00
				<u>\$ 9</u>	<u>0,08</u>

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2051	£ 100	\$ (1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,700	03.01.2022	BRL 3.400	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,572	02.01.2023	900	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	0,636	21.12.2023	CAD 100	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	0,637	21.12.2023	200	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,688	17.03.2026	CNY 100	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,690	17.03.2026	200	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,700	17.03.2026	200	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,705	17.03.2026	200	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,770	17.03.2026	200	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,810	17.03.2026	300	0	0,00
Zahlung ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	0,407	21.07.2024	\$ 900	(5)	(0,05)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	400	2	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,740	15.02.2027	100	(2)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022	500	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	17.06.2022	100	0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025	100	(2)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2027	300	10	0,09
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	200	11	0,11
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	100	(6)	(0,06)
Erhalt ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,277	21.07.2031	200	3	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2021	800	(8)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	200	(8)	(0,08)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2024	100	(1)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 280	0	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	90	1	0,01
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,350	17.03.2051	¥ 14.000	3	0,03
Erhalt	CPTFEMU	1,314	15.04.2026	€ 100	0	0,00
Erhalt	UKRPI	3,334	15.08.2025	£ 100	2	0,02
Zahlung	UKRPI	3,475	15.08.2030	100	(4)	(0,04)
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	100	0	0,00

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	UKRPI		3,490 %	15.09.2028	£ 100	\$ 1	0,01
Zahlung	UKRPI		3,650	15.12.2030	100	(1)	(0,01)
						\$ (10)	(0,09)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (1)	(0,01)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
UAG	Call – OTC USD versus TWD	TWD 28,490	25.01.2022	87	\$ 1	\$ 0	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
CBK	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,019 %	18.03.2024	700	\$ 6	\$ 5	0,05

VERKAUFSOPTIENEN

CREDIT DEFAULT SWAPIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GST	Put – OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800 %	20.10.2021	100	\$ 0	\$ 0	0,00

DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Put – OTC USD versus MXN	MXN 19,120	16.12.2021	94	\$ (2)	\$ (1)	(0,01)
	Call – OTC USD versus MXN	23,100	16.12.2021	94	(2)	(1)	(0,01)
MYI	Put – OTC USD versus CNH	CNH 6,400	16.12.2021	83	(1)	0	0,00
	Call – OTC USD versus CNH	7,000	16.12.2021	83	(1)	0	0,00
	Put – OTC USD versus MXN	MXN 19,000	09.12.2021	71	(1)	0	0,00
	Call – OTC USD versus MXN	23,000	09.12.2021	71	(1)	0	0,00
UAG	Call – OTC USD versus TWD	TWD 29,500	25.01.2022	174	(1)	(1)	(0,01)
					\$ (9)	\$ (3)	(0,03)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens	
CBK	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,028 %	18.03.20	24	1.400	\$ (7)	\$ (4)	(0,04)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	166	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 1.405	07.07.2021	\$ 0	\$ 78	\$ 78	0,75	
BRC	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	258	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.126	04.08.2021	0	180	180	1,71	
GST	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	63	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	557	22.09.2021	0	7	7	0,07	
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	520	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	4.290	23.02.2022	0	356	356	3,39	
HUS	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	168	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.431	06.10.2021	0	70	70	0,67	
								\$ 0	\$ 691	\$ 691	6,59

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (Forts.)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2021	€ 1.070	\$ 1.300	\$ 30	\$	0 \$ 30	0,28
	08.2021	\$ 2	RUB 165	0		0 0	0,00
	09.2021	42	IDR 604.838	0	(1)	(1)	(0,01)
	09.2021	4	RUB 316	0	0	0	0,00
CBK	07.2021	2	126	0	0	0	0,00
	08.2021	2	151	0	0	0	0,00
	09.2021	39	ZAR 538	0	(2)	(2)	(0,02)
	10.2021	PEN 97	\$ 26	1	0	1	0,01
GLM	07.2021	BRL 101	€ 17	0	0	0	0,00
	07.2021	€ 16	BRL 101	2	0	2	0,02
	07.2021	\$ 19	97	0	0	0	0,00
	07.2021	3	RUB 253	0	0	0	0,00
	08.2021	BRL 97	\$ 19	0	0	0	0,00
	08.2021	€ 17	BRL 101	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 3	RUB 211	0	0	0	0,00
	09.2021	8	574	0	0	0	0,00
	09.2021	33	ZAR 462	0	(1)	(1)	(0,01)
HUS	08.2021	CAD 6	\$ 5	0	0	0	0,00
	08.2021	£ 117	165	4	0	4	0,04
	08.2021	\$ 5	RUB 340	0	0	0	0,00
	09.2021	40	MXN 850	2	0	2	0,02
JPM	10.2021	45	943	2	0	2	0,02
MYI	07.2021	2	RUB 124	0	0	0	0,00
SOG	07.2021	2	144	0	0	0	0,00
	08.2021	3	189	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	BRL 97	\$ 18	0	(1)	(1)	(0,01)
UAG	07.2021	\$ 5	RUB 408	0	0	0	0,00
	09.2021	2	165	0	0	0	0,00
				\$ 41	\$	(5) \$ 36	0,34

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MYI	07.2021	\$ 137	€ 112	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	(0,03)
RBC	07.2021	141	115	0	(4)	(4)	(0,04)
SCX	07.2021	150	123	0	(5)	(5)	(0,04)
				\$ 0	\$ (12)	\$ (12)	(0,11)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 81	£ 59	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	(0,01)
MYI	07.2021	81	59	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	£ 63	\$ 87	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 81	£ 59	0	0	0	0,00
	08.2021	87	63	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 712 6,79

Summe Anlagen

\$ 11.222 107,03

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (737) (7,03)

Nettovermögen

\$ 10.485 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von USD 205 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.619	\$ 0	\$ 6.619
Investmentfonds	618	386	0	1.004
Pensionsgeschäfte	0	2.900	0	2.900
Finanzderivate ⁽³⁾	0	699	0	699
Summen	\$ 618	\$ 10.604	\$ 0	\$ 11.222

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.839	\$ 0	\$ 5.839
Investmentfonds	418	386	0	804
Pensionsgeschäfte	0	3.039	0	3.039
Finanzderivate ⁽³⁾	3	59	0	62
Summen	\$ 421	\$ 9.323	\$ 0	\$ 9.744

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 106	\$ 0	\$ 106
BRC	180	(180)	0
GLM	(1)	0	(1)
GST	363	(260)	103
HUS	76	0	76
JPM	2	0	2
MYI	(3)	0	(3)
RBC	(4)	0	(4)
SCX	(5)	0	(5)
SSB	(1)	0	(1)
UAG	(1)	0	(1)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	32,34	23,43
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	29,71	41,19
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,08	4,75
Investmentfonds	9,58	9,55
Pensionsgeschäfte	27,66	36,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,12)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,01)	(0,17)
Freiverkehrsfinauzderivate	6,79	0,87

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	14,25	15,55
US-Regierungsbehörden	7,72	18,99
US-Schatzobligationen	5,69	8,72
Non-Agency-MBS	8,32	6,13
Forderungsbesicherte Wertpapiere	10,70	7,82
Staatsemissionen	0,24	0,36
Kurzfristige Instrumente	16,21	11,80
Investmentfonds	9,58	9,55
Pensionsgeschäfte	27,66	36,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,11)	0,04
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,08	k. A.
Zinsswaps	(0,09)	(0,17)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	0,05	0,24
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	k. A.
Devisenoptionen	(0,03)	(0,10)
Zinsswapoptionen	(0,04)	(0,18)
Total Return Swaps auf Indizes	6,59	1,06
Devisenterminkontrakte	0,34	(0,24)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,12)	0,09
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,03)	(15,77)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS				
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE															
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG															
Alice France S.A.				Sunshine Luxembourg SARL	321	322	0,04	3.961 % fällig am 26.11.2025	\$	1.850	2,001	0,26			
4,155 % fällig am 14.08.2026	\$	293	0,292	4,500 % fällig am 01.10.2026				4,250 % fällig am 14.10.2021		2.670	2,699	0,35			
Aramark Services, Inc.				Syniverse Holdings, Inc.	159	157	0,02	EPR Properties			214	0,03			
1,854 % fällig am 11.03.2025	93	92	0,01	6,000 % fällig am 09.03.2023				4,500 % fällig am 01.06.2027			16	0,00			
Avantor Funding, Inc.				Univision Communications, Inc.	1.140	1.139	0,15	4,750 % fällig am 15.12.2026			24	0,00			
3,000 % fällig am 21.11.2024	11	11	0,00	2,854 % fällig am 15.03.2024				4,950 % fällig am 15.04.2028			26	0,00			
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				Whatabrands LLC	29	29	0,00	Fairfax Financial Holdings Ltd.			81	93	0,01		
2,250 % fällig am 12.02.2027	666	659	0,09	2,832 % fällig am 31.07.2026				4,625 % fällig am 29.04.2030			27	31	0,00		
2,500 % fällig am 15.01.2025	1.400	1.398	0,18	Windstream Services LLC	21	21	0,00	4,850 % fällig am 17.04.2028			200	241	0,03		
Axalta Coating Systems U.S. Holdings, Inc.				7,250 % fällig am 21.09.2027				Ford Motor Credit Co. LLC			400	409	0,05		
1,897 % fällig am 01.06.2024	25	25	0,00	Wyndham Hotels & Resorts, Inc.	97	97	0,01	3,087 % fällig am 09.01.2023	€	200	600	617	0,08		
Bausch Health Cos., Inc.				1,854 % fällig am 30.05.2025				3,550 % fällig am 07.10.2022	\$	400	600	617	0,08		
2,854 % fällig am 27.11.2025	113	112	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
3,104 % fällig am 02.06.2025	11	11	0,00	BANKEN UND FINANZEN											
BWAY Holding Co.				Ally Financial, Inc.	41	59	0,01	GLP Capital LP			3.748	4,043	0,52		
3,354 % fällig am 03.04.2024	38	38	0,01	8,000 % fällig am 01.11.2031				4,000 % fällig am 15.01.2031			39	44	0,01		
Caesars Resort Collection LLC				Ambac LSNi LLC	731	732	0,09	5,250 % fällig am 01.06.2025			186	217	0,03		
2,854 % fällig am 23.12.2024	386	383	0,05	6,000 % fällig am 12.02.2023				5,300 % fällig am 15.01.2029			130	141	0,02		
4,604 % fällig am 21.07.2025	1.795	1.804	0,23	Avolon Holdings Funding Ltd.	59	61	0,01	Goodman U.S. Finance Three LLC			200	204	0,03		
Carnival Corp.				3,250 % fällig am 15.02.2027				3,700 % fällig am 13.03.2028			200	204	0,03		
8,500 % fällig am 30.06.2025	993	1.017	0,13	5,125 % fällig am 01.10.2023				Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S			750	764	0,10		
CommScope, Inc.				5,500 % fällig am 15.01.2023				Horse Gallop Finance Ltd.			4.700	4.937	0,64		
3,346 % fällig am 06.04.2026	197	196	0,03	Banca Carige SpA	€	700	833	0,11	3,250 % fällig am 30.05.2022			3.500	3.500	0,38	
Core & Main LP				1,161 % fällig am 25.10.2021				Host Hotels & Resorts LP			4.700	4.937	0,64		
3,750 % fällig am 01.08.2024	29	29	0,00	Banco Bradesco S.A.	\$	261	267	0,03	3,500 % fällig am 15.09.2030			1.700	1.904	0,25	
Cornerstone Building Brands, Inc.				2,850 % fällig am 27.01.2023				HSBC Holdings PLC			€	200	269	0,03	
3,750 % fällig am 12.04.2028	281	282	0,04	Banco BTG Pactual S.A.	200	210	0,03	3,973 % fällig am 22.05.2030			€	400	621	0,08	
Dell International LLC				4,500 % fällig am 10.01.2025				4,750 % fällig am 04.07.2029 (h)(j)	€		€	400	621	0,08	
2,000 % fällig am 19.09.2025	115	115	0,02	Banco de Credito del Peru	PEN	1.100	297	0,04	5,875 % fällig am 28.09.2026 (h)(j)	€	1.100	1.432	0,18		
Diamond Resorts Corp.				4,650 % fällig am 17.09.2024				6,000 % fällig am 29.09.2023 (h)(j)	€		\$	530	609	0,08	
4,750 % fällig am 02.09.2023	828	829	0,11	Banco Espirito Santo S.A.	€	100	19	0,00	6,500 % fällig am 23.03.2028 (h)(j)	\$					
Emerald TopCo, Inc.				2,625 % fällig am 08.05.2017 ^				IMMOFINANZ AG			€	200	245	0,03	
3,604 % - 3,686 % fällig am 24.07.2026	40	40	0,01	Banco Santander S.A.				2,625 % fällig am 27.01.2023			€	200	245	0,03	
Envision Healthcare Corp.				4,750 % fällig am 19.03.2025 (h)(j)				Indian Railway Finance Corp. Ltd.			\$	200	203	0,03	
3,854 % fällig am 10.10.2025	2.709	2.326	0,30	6,250 % fällig am 11.09.2021 (h)(j)				3,249 % fällig am 21.02.2030							
Forest City Enterprises LP				Bank of Ireland Group PLC	1.761	2.472	0,32	ING Groep NV							
3,604 % fällig am 08.12.2025	70	68	0,01	7,500 % fällig am 19.05.2025 (h)(j)				5,750 % fällig am 16.11.2026 (h)(j)			400	443	0,06		
HCA, Inc.				Barclays Bank PLC	\$	349	381	0,05	International Lease Finance Corp.			178	186	0,02	
TBD % fällig am 18.03.2026	0	0	0,00	7,625 % fällig am 21.11.2022 (j)				8,625 % fällig am 15.01.2022							
Hilton Worldwide Finance LLC				Barclays PLC				Kilroy Realty LP				13	14	0,00	
1,842 % fällig am 22.06.2026	326	323	0,04	3,125 % fällig am 17.01.2024	£	1.100	1.603	0,21	3,050 % fällig am 15.02.2030						
iHeartCommunications, Inc.				4,972 % fällig am 16.05.2029	\$	400	469	0,06	Legal & General Group PLC			€	1.000	1.552	0,20
3,104 % fällig am 01.05.2026	5.907	5.865	0,76	7,125 % fällig am 15.06.2025 (h)(j)	£	200	316	0,04	5,625 % fällig am 24.03.2031	£					
Intelsat Jackson Holdings S.A.				7,250 % fällig am 15.03.2023 (h)(j)				Lloyds Banking Group PLC			AUD	400	328	0,04	
3,600 % - 6,500 % fällig am 13.07.2022	214	217	0,03	7,750 % fällig am 15.09.2023 (h)(j)	\$	200	209	0,03	4,000 % fällig am 07.03.2025						
8,000 % fällig am 27.11.2023	410	417	0,05	7,875 % fällig am 15.03.2022 (h)(j)	£	1.700	2.523	0,33	7,500 % fällig am 27.09.2025	\$		400	469	0,06	
Lealand Finance Company B.V.				7,875 % fällig am 15.09.2022 (h)(j)				Morgan Stanley				700	568	0,07	
3,096 % fällig am 30.06.2024	26	17	0,00	BGC Partners, Inc.	\$	96	101	0,01	7,500 % fällig am 02.04.2032 (k)						
Lealand Finance Company B.V. (1,093 % Bar oder 3,000 % PIK)				3,750 % fällig am 01.10.2024				Nationwide Building Society			£	1.000	1.551	0,20	
1,093 % - 3,000 % fällig am 30.06.2025 (c)	137	63	0,01	5,375 % fällig am 24.07.2023				5,750 % fällig am 20.06.2027 (h)(j)			200	305	0,04		
MH Sub LLC				Brixmor Operating Partnership LP	170	171	0,02	5,875 % fällig am 20.12.2024 (h)(j)							
3,604 % fällig am 13.09.2024	87	86	0,01	1,226 % fällig am 01.02.2022				Natwest Group PLC			\$	1.200	1.375	0,18	
Nascar Holdings, Inc.				CBL & Associates LP	42	24	0,00	4,445 % fällig am 08.05.2030				500	586	0,08	
2,854 % fällig am 19.10.2026	32	32	0,00	5,950 % fällig am 15.12.2026 ^				4,892 % fällig am 18.05.2029			1.400	1.662	0,21		
Ortho-Clinical Diagnostics S.A.				China Construction Bank Corp.	€	300	356	0,05	5,076 % fällig am 27.01.2030			1.000	1.117	0,14	
3,089 % fällig am 30.06.2025	10	10	0,00	0,060 % fällig am 24.09.2021				6,000 % fällig am 29.12.2025 (h)(j)			600	712	0,09		
PUG LLC				Corestate Capital Holding S.A.	700	723	0,09	8,000 % fällig am 10.08.2025 (h)(j)			2.186	2.207	0,28		
3,604 % fällig am 12.02.2027	45	45	0,01	3,500 % fällig am 15.04.2023				8,625 % fällig am 15.08.2021 (h)(j)							
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				Corp. Andina de Fomento	MXN	1.706	86	0,01	Navient Corp.			3.900	4.118	0,53	
3,854 % fällig am 16.11.2025	87	87	0,01	3,950 % fällig am 15.10.2021 (g)				5,500 % fällig am 25.01.2023			145	140	0,02		
Sequa Mezzanine Holdings LLC				CPI Property Group S.A.	€	600	776	0,10	5,625 % fällig am 01.08.2033			277	289	0,04	
7,750 % fällig am 28.11.2023	1.143	1.152	0,15	Credit Suisse AG				6,500 % fällig am 15.06.2022							
10,000 % fällig am 23.07.2025	1.896	1.839	0,24	6,500 % fällig am 08.08.2023 (j)	\$	1.915	2.120	0,27	Newmark Group, Inc.			110	121	0,02	
Sequa Mezzanine Holdings LLC (11,750 % Bar oder 6,750 % PIK)				Credit Suisse Group AG				6,125 % fällig am 15.11.2023							
11,750 % fällig am 28.04.2024	164	162	0,02	3,869 % fällig am 12.01.2029	1.670	1.841	0,24	Nissan Motor Acceptance Corp.			12	12	0,00		
Sinclair Television Group, Inc.				7,250 % fällig am 12.09.2025 (h)(j)	200	226	0,03	1,078 % fällig am 13.01.2022			21	21	0,00		
2,610 % fällig am 30.09.2026	0	0	0,00	7,500 % fällig am 17.07.2023 (h)(j)	400	436	0,06	1,900 % fällig am 14.09.2021							
Sotera Health Holdings LLC				CTR Partnership LP	50	51	0,01	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			0	0	0,00		
3,250 % fällig am 11.12.2026	189	189	0,02	5,250 % fällig am 01.06.2025				2,000 % fällig am 01.10.2047	DKK						
SS&C Technologies, Inc.				Deutsche Bank AG	€	2.800	3.373	0,43	Nykredit Realkredit A/S			0	0	0,00	
1,854 % fällig am 16.04.2025	\$	154	\$	1,375 % fällig am 17.02.2032				2,000 % fällig am 01.10.2047							

Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Omega Healthcare Investors, Inc. 3,625 % fällig am 01.10.2029 4,500 % fällig am 01.04.2027	\$ 110 2.340	\$ 118 2.620	0,02 0,34	American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	\$ 3.457	\$ 3.664	0,47	8,500 % fällig am 15.10.2024 ^ 9,750 % fällig am 15.07.2025 ^	\$ 3.753 1.469	\$ 2.228 858	0,29 0,11
OneMain Finance Corp. 5,625 % fällig am 15.03.2023 6,125 % fällig am 15.05.2022 6,125 % fällig am 15.03.2024	5.646 1.280 166	6.038 1.333 179	0,78 0,17 0,02	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,500 % fällig am 01.06.2050 4,600 % fällig am 01.06.2060	407 141	496 174	0,06 0,02	Intelsat Luxembourg S.A. 7,750 % fällig am 01.06.2021 ^	507	19	0,00
Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.03.2023 5,250 % fällig am 15.08.2022 5,500 % fällig am 15.02.2024	393 1.495 22	413 1.565 24	0,05 0,20 0,00	B.C. Unlimited Liability Co. 4,250 % fällig am 15.05.2024 4,375 % fällig am 15.01.2028	72 30	73 30	0,01 0,00	Kraft Heinz Foods Co. 3,750 % fällig am 01.04.2030 4,250 % fällig am 01.03.2031 5,500 % fällig am 01.06.2050	268 336 4.323	295 382 5.623	0,04 0,05 0,73
Physicians Realty LP 3,950 % fällig am 15.01.2028	25	27	0,00	Boeing Co. 5,805 % fällig am 01.05.2050 5,930 % fällig am 01.05.2060	1.200 1.300	1.619 1.799	0,21 0,23	Level 3 Financing, Inc. 3,875 % fällig am 15.11.2029	130	139	0,02
QNB Finance Ltd. 1,256 % fällig am 12.02.2022	4.200	4.218	0,54	Bombardier, Inc. 6,000 % fällig am 15.10.2022 6,125 % fällig am 15.01.2023 7,500 % fällig am 15.03.2025 7,875 % fällig am 15.04.2027	130 104 16 301	130 110 17 313	0,02 0,01 0,00 0,04	Marriott International, Inc. 4,625 % fällig am 15.06.2030	28	32	0,00
Sabra Health Care LP 4,800 % fällig am 01.06.2024	36	39	0,01	Broadcom Corp. 3,875 % fällig am 15.01.2027	110	122	0,02	Marriott Ownership Resorts, Inc. 6,125 % fällig am 15.09.2025	75	80	0,01
Santander Holdings USA, Inc. 4,400 % fällig am 13.07.2027	43	48	0,01	Broadcom, Inc. 3,469 % fällig am 15.04.2034 4,110 % fällig am 15.09.2028	121 46	128 52	0,02 0,01	Melco Resorts Finance Ltd. 5,375 % fällig am 04.12.2029	930	984	0,13
Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % fällig am 24.06.2024 (h)(j) 7,375 % fällig am 24.06.2022 (h)(j)	£ 200 1.254	309 1.832	0,04 0,24	Carnival Corp. 11,500 % fällig am 01.04.2023	894	1.007	0,13	MGM China Holdings Ltd. 5,875 % fällig am 15.05.2026	3.110	3.269	0,42
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 6,125 % fällig am 07.02.2022	\$ 200	207	0,03	CCO Holdings LLC 4,500 % fällig am 15.08.2030 4,750 % fällig am 01.03.2030	210 238	219 252	0,03 0,03	Micron Technology, Inc. 5,327 % fällig am 06.02.2029	80	97	0,01
Sitka Holdings LLC 4,643 % fällig am 06.07.2026 (b)	731	731	0,09	Centene Corp. 4,250 % fällig am 15.12.2027	84	89	0,01	Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % fällig am 15.12.2030	£ 27	42	0,01
SL Green Operating Partnership LP 3,250 % fällig am 15.10.2022	16	16	0,00	Charter Communications Operating LLC 4,800 % fällig am 01.03.2050	221	254	0,03	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.05.2027 3,625 % fällig am 15.06.2030 3,875 % fällig am 15.11.2029	€ 200 214 476	273 302 681	0,04 0,04 0,09
SMBC Aviation Capital Finance DAC 4,125 % fällig am 15.07.2023	1.100	1.170	0,15	Citrix Systems, Inc. 3,300 % fällig am 01.03.2030	38	40	0,01	NetScout Systems, Inc. 4,625 % fällig am 15.05.2029 4,875 % fällig am 15.06.2030 5,375 % fällig am 15.11.2029	\$ 300 200 72	445 238 88	0,06 0,03 0,01
Societe Generale S.A. 6,750 % fällig am 06.04.2028 (h)(j) 7,375 % fällig am 04.10.2023 (h)(j)	200 700	227 765	0,03 0,10	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. 7,750 % fällig am 15.04.2028	2.825	2.963	0,38	Noble Finance Co. (11,000 % Bar oder 15,000 % PIK) 11,000 % fällig am 15.02.2028 (c)	700 59	748 65	0,10 0,01
Stichting AK Rabobank Certificaten 2,188 % (h)	€ 511	817	0,11	Community Health Systems, Inc. 5,625 % fällig am 15.03.2027 6,625 % fällig am 15.02.2025 8,000 % fällig am 15.03.2026	3.660 448 682	3.912 474 736	0,50 0,06 0,09	NXP BV 4,300 % fällig am 18.06.2029	110	126	0,02
Sunac China Holdings Ltd. 8,350 % fällig am 19.04.2023	\$ 200	207	0,03	Connect Finco SARRL 6,750 % fällig am 01.10.2026	78	83	0,01	Occidental Petroleum Corp. 1,606 % fällig am 15.08.2022	106	106	0,01
Tesco Property Finance PLC 5,744 % fällig am 13.04.2040 6,052 % fällig am 13.10.2039	£ 190 927	352 1.710	0,05 0,22	Continental Airlines Pass-Through Trust 4,150 % fällig am 11.10.2025	8	9	0,00	Ortho-Clinical Diagnostics, Inc. 7,375 % fällig am 01.06.2025	16	17	0,00
TP ICAP Ltd. 5,250 % fällig am 29.05.2026	500	790	0,10	Corning, Inc. 5,450 % fällig am 15.11.2079	76	107	0,01	Pelabuhan Indonesia Persero PT 4,500 % fällig am 02.05.2023	200	213	0,03
U.S. Capital Funding Ltd. 0,468 % fällig am 10.07.2043	\$ 6.720	5.913	0,76	DAE Funding LLC 4,500 % fällig am 01.08.2022 5,000 % fällig am 01.08.2024 5,250 % fällig am 15.11.2021	600 296 381	603 305 384	0,08 0,04 0,05	Petroleos de Venezuela S.A. 5,375 % fällig am 12.04.2027 ^ 5,500 % fällig am 12.04.2037 ^ 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ 6,000 % fällig am 15.11.2026 ^ 9,750 % fällig am 17.05.2035 ^	707 762 642 518 280	32 34 29 23 13	0,00 0,00 0,00 0,00 0,00
UBS Group AG 5,125 % fällig am 29.07.2026 (h)(j) 5,750 % fällig am 19.02.2022 (h)(j)	1.000 € 1.500	1.091 1.837	0,14 0,24	Delta Air Lines, Inc. 7,000 % fällig am 01.05.2025	900	1.051	0,14	Petroleos Mexicanos 5,350 % fällig am 12.02.2028 5,950 % fällig am 28.01.2031 6,490 % fällig am 23.01.2027 6,500 % fällig am 13.03.2027 6,500 % fällig am 23.01.2029	60 830 410 330 2.165	59 807 434 349 2.231	0,01 0,10 0,06 0,05 0,29
UniCredit Spa 7,830 % fällig am 04.12.2023 9,250 % fällig am 03.06.2022 (h)(j)	\$ 3.650 € 2.800	4.231 3.563	0,55 0,46	Diamond Resorts International, Inc. 7,750 % fällig am 01.09.2023	573	591	0,08	6,750 % fällig am 21.09.2047 6,840 % fällig am 23.01.2030 6,950 % fällig am 28.01.2060 7,690 % fällig am 23.01.2050	40 1.838 804 160	35 1.896 713 154	0,00 0,24 0,09 0,02
VICI Properties LP 3,500 % fällig am 15.02.2025 3,750 % fällig am 15.02.2027 4,125 % fällig am 15.08.2030 4,250 % fällig am 01.12.2026 4,625 % fällig am 01.12.2029	\$ 473 582 549 400 400	484 594 565 417 426	0,06 0,08 0,07 0,05 0,05	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A. 4,700 % fällig am 07.05.2050	200	226	0,03	Roadster Finance DAC 2,375 % fällig am 08.12.2032	€ 100	127	0,02
Volkswagen Financial Services NV 1,875 % fällig am 07.09.2021	€ 100	138	0,02	Exela Intermediate LLC 10,000 % fällig am 15.07.2023	78	52	0,01	Royal Caribbean Cruises Ltd. 10,875 % fällig am 01.06.2023 11,500 % fällig am 01.06.2025	\$ 448 688	511 794	0,07 0,10
Voyager Aviation Holdings LLC 8,500 % fällig am 09.05.2026	\$ 33	30	0,00	Expedia Group, Inc. 6,250 % fällig am 01.05.2025	17	20	0,00	Sands China Ltd. 3,800 % fällig am 08.01.2026 4,375 % fällig am 18.06.2030 4,600 % fällig am 08.08.2023 5,125 % fällig am 08.08.2025 5,400 % fällig am 08.08.2028	200 200 200 200 400	214 217 213 224 465	0,03 0,03 0,03 0,03 0,06
			111.689	14,40							
INDUSTRIEWERTE											
AA Bond Co. Ltd. 2,875 % fällig am 31.07.2043	£ 100	139	0,02	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,949 % fällig am 24.01.2024 6,510 % fällig am 07.03.2022	€ 500 \$ 702	624 731	0,08 0,09	Seagate HDD Cayman 4,125 % fällig am 15.01.2031	62	63	0,01
Aeroporti di Roma SpA 1,750 % fällig am 30.07.2031	€ 2.762	3.418	0,44	iHeartCommunications, Inc. 6,375 % fällig am 01.05.2026	681	726	0,09	Six Flags Theme Parks, Inc. 7,000 % fällig am 01.07.2025	48	52	0,01
Airbus SE 2,375 % fällig am 09.06.2040	300	414	0,05	IMCD NV 2,500 % fällig am 26.03.2025	€ 100	124	0,02	Southwest Airlines Co. 5,125 % fällig am 15.06.2027	193	227	0,03
Altice France S.A. 7,375 % fällig am 01.05.2026 8,125 % fällig am 01.02.2027	\$ 1.143 12	1.190 13	0,15 0,00	Intelsat Connect Finance S.A. 9,500 % fällig am 15.02.2023 ^	\$ 170	57	0,01	Tenet Healthcare Corp. 4,625 % fällig am 15.07.2024	15	15	0,00
American Airlines Pass-Through Trust 3,350 % fällig am 15.04.2031	34	34	0,00	Intelsat Jackson Holdings S.A. 5,500 % fällig am 01.08.2023 ^ 8,000 % fällig am 15.02.2024	450 568	258 588	0,03 0,08				

Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	
NON-AGENCY-MBS												
American Home Mortgage Assets Trust 1,036 % fällig am 25.11.2046	\$	4.886	0,27	Argent Securities Trust 0,392 % fällig am 25.07.2036	\$	5.976	0,77	TruPS Financials Note Securitization Ltd. 1,705 % fällig am 20.09.2039	\$	2.698	0,34	
Banc of America Funding Corp. 3,848 % fällig am 25.09.2048		3.284	0,44	Asset-Backed Funding Certificates Trust 0,917 % fällig am 25.08.2033		173	0,02	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 0,302 % fällig am 25.03.2037		13	0,00	
Banc of America Funding Trust 2,886 % fällig am 20.05.2036	^	50	0,01	Basic Asset-Backed Securities Trust 0,712 % fällig am 25.04.2036		288	0,04			115.658	14,91	
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust 2,123 % fällig am 15.02.2033		391	0,05	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 0,262 % fällig am 25.10.2036		108	0,01	STAATSEMISSIONEN				
3,173 % fällig am 15.02.2033		2.400	0,31	0,242 % fällig am 25.11.2039		525	0,07	Argentina Government International Bond 0,125 % fällig am 09.07.2030		5.595	0,26	
Bear Stearns Mortgage Funding Trust 0,312 % fällig am 25.08.2036		1.149	0,15	Castlelake Aircraft Securitization Trust 4,125 % fällig am 15.06.2043		1.180	0,15	0,125 % fällig am 09.07.2035		3.879	0,16	
CitiMortgage Alternative Loan Trust 6,000 % fällig am 25.12.2036	^	289	0,04	Conseco Finance Corp. 6,280 % fällig am 01.09.2030		780	0,11	0,125 % fällig am 09.01.2038		2.406	0,12	
Countrywide Alternative Loan Trust 0,232 % fällig am 25.06.2037		2.353	0,29	Countrywide Asset-Backed Certificates 0,312 % fällig am 25.05.2037		6.171	0,77	0,125 % fällig am 09.07.2041		2.517	0,12	
1,392 % fällig am 25.10.2035	^	305	0,03	0,342 % fällig am 25.11.2047	^	4.992	0,56	0,125 % fällig am 09.07.2046		115	0,01	
5,900 % fällig am 25.09.2035	^	2.572	0,31	1,157 % fällig am 25.08.2035		2.024	0,26	1,000 % fällig am 09.07.2029		377	0,02	
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0,752 % fällig am 25.02.2035		828	0,10	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 3,264 % fällig am 25.01.2037	^	189	0,01	15,500 % fällig am 17.10.2026	ARS	3.906	0,00	
Countrywide Home Loan Repperforming REMIC Trust 6,000 % fällig am 25.11.2034	^	363	0,05	Fieldstone Mortgage Investment Trust 0,332 % fällig am 25.11.2036		2.033	0,19	34,069 % fällig am 04.10.2022		730	0,00	
Euroseal PLC 0,784 % fällig am 13.09.2045	£	4.094	0,72	First Franklin Mortgage Loan Trust 0,767 % fällig am 25.11.2035		1.500	0,19	36,104 % fällig am 03.04.2022		54.986	0,04	
1,034 % fällig am 13.06.2045		1.907	0,34	Fremont Home Loan Trust 0,242 % fällig am 25.01.2037		1.652	0,12	Australia Government International Bond 1,750 % fällig am 21.06.2051	AUD	2.200	0,19	
GreenPoint Mortgage Funding Trust 0,292 % fällig am 25.10.2046	\$	558	0,07	0,452 % fällig am 25.04.2036		173	0,02	Autonomous City of Buenos Aires Argentina 37,374 % fällig am 29.03.2024	ARS	35.890	0,02	
Grifonas Finance No. 1 PLC 0,000 % fällig am 28.08.2039	€	277	0,04	Gallatin CLO Ltd. 1,834 % fällig am 15.07.2027		800	0,10	37,875 % fällig am 22.02.2028		27.495	0,02	
GSMPS Mortgage Loan Trust 7,087 % fällig am 20.10.2032	\$	1.796	0,23	GSAMP Trust 0,462 % fällig am 25.03.2047		9.000	7,753	39,117 % fällig am 23.01.2022		1.359	0,00	
GSMSC Resecuritization Trust 8,757 % fällig am 26.04.2037		7.245	0,35	Harley Marine Financing LLC 5,682 % fällig am 15.05.2043		271	0,03	China Development Bank 2,890 % fällig am 22.06.2025	CNY	10.600	1,622	
HomeBanc Mortgage Trust 2,387 % fällig am 25.04.2037		44	0,01	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 0,252 % fällig am 25.11.2036		4.903	0,60	2,890 % fällig am 22.06.2025		2.000	0,31	
JPMorgan Mortgage Trust 2,806 % fällig am 25.08.2036	^	46	0,01	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,342 % fällig am 25.07.2036		1.563	0,20	3,430 % fällig am 14.01.2027		1.800	0,28	
1,830 % fällig am 25.01.2037	^	117	0,01	Legacy Mortgage Asset Trust 1,843 % fällig am 28.01.2070		4.707	0,61	3,680 % fällig am 26.02.2026		12.600	1,983	
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 1,192 % fällig am 25.09.2037		7.300	0,46	Lehman XS Trust 0,892 % fällig am 25.10.2035		73	0,01	3,740 % fällig am 10.09.2025		16.000	2,523	
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 0,352 % fällig am 25.04.2035		115	0,01	Long Beach Mortgage Loan Trust 0,692 % fällig am 25.01.2036		3.351	0,40	4,150 % fällig am 26.10.2025		8.900	1,427	
RBSGC Mortgage Loan Trust 6,000 % fällig am 25.01.2037	^	23	0,00	LP Credit Card ABS Master Trust 1,661 % fällig am 20.08.2024		1.310	0,17	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,875 % fällig am 16.04.2050	\$	300	0,04	
Residential Accredited Loans, Inc. Trust 0,302 % fällig am 25.06.2037		66	0,01	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust 3,342 % fällig am 25.03.2032		1.364	0,18	Export-Credit Bank of Turkey 8,250 % fällig am 24.01.2024		200	0,03	
Sandwell Commercial Finance PLC 0,631 % fällig am 30.09.2037	£	33	0,01	MASTR Asset-Backed Securities Trust 0,612 % fällig am 25.06.2036		458	0,06	Guatemala Government International Bond 5,375 % fällig am 24.04.2032		200	0,23	
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 1,516 % fällig am 25.05.2035	\$	162	0,02	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,202 % fällig am 25.02.2037		841	0,06	6,125 % fällig am 01.06.2050		200	245	
3,176 % fällig am 25.09.2035		75	0,01	0,242 % fällig am 25.02.2037		2.609	0,20	Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060		2.400	2,739	
Sutherland Commercial Mortgage Loans 3,192 % fällig am 25.05.2037		496	0,06	0,342 % fällig am 25.03.2037		9.556	0,68	4,500 % fällig am 03.04.2120		200	253	
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,948 % fällig am 25.12.2046	^	2.908	0,35	0,632 % fällig am 25.03.2036		2.605	0,33	Peru Government International Bond 5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN	922	0,14	
1,843 % fällig am 25.08.2046		1.050	0,13	New Century Home Equity Loan Trust 0,872 % fällig am 25.03.2035		72	0,01	5,350 % fällig am 12.08.2040		750	185	
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,542 % fällig am 25.05.2035	^	387	0,04	2,117 % fällig am 25.05.2034	^	853	0,11	5,400 % fällig am 12.08.2034		2.467	705	
Wells Fargo Alternative Loan Trust 6,250 % fällig am 25.07.2037	^	1.703	0,22	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,412 % fällig am 25.01.2036	^	5.365	0,69	5,940 % fällig am 12.02.2029		2.467	705	
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 2,781 % fällig am 25.10.2036	^	18	0,00	Renaissance Home Equity Loan Trust 4,934 % fällig am 25.08.2035		43	0,01	6,150 % fällig am 12.08.2032		13.334	3,561	
		39.917	5,15	Residential Asset Securities Corp. Trust 0,332 % fällig am 25.09.2036		1.221	0,16	6,350 % fällig am 12.08.2028		615	180	
				0,677 % fällig am 25.03.2036		1.855	0,24	6,950 % fällig am 12.08.2031		296	87	
				Saxon Asset Securities Trust 1,842 % fällig am 25.12.2037		2.742	0,36	8,200 % fällig am 12.08.2026		1.090	354	
				Soundview Home Loan Trust 4,402 % fällig am 25.06.2036	^	7.522	0,93	Provincia de Buenos Aires 37,854 % fällig am 12.04.2025	ARS	14.289	73	
				1,092 % fällig am 25.09.2037		7.194	0,75	37,954 % fällig am 31.05.2022		8.442	48	
				1,127 % fällig am 25.05.2035		1.500	0,19	Qatar Government International Bond 4,400 % fällig am 16.04.2050	\$	400	488	
				Structured Asset Investment Loan Trust 0,872 % fällig am 25.07.2035		83	0,01	5,103 % fällig am 23.04.2048		200	266	
				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 0,262 % fällig am 25.12.2036		264	0,03	Republic of Greece Government International Bond 3,500 % fällig am 30.01.2023	€	31	39	
				1,217 % fällig am 25.07.2035		1.220	0,16	3,750 % fällig am 30.01.2028		58	84	
								3,900 % fällig am 30.01.2033		61	97	
								4,000 % fällig am 30.01.2037		36	62	
								4,200 % fällig am 30.01.2042		11	21	
								Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033		2.735	3,225	
								Russia Government International Bond 0,000 % fällig am 24.04.2024	RUB	187.500	2,552	
								7,150 % fällig am 12.11.2025		214.863	2,975	
								7,950 % fällig am 07.10.2026		82.843	1,186	
								Serbia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.05.2027	€	258	341	
								South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029	\$	400	425	
								5,750 % fällig am 30.09.2049		400	410	
								8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	2.600	173	
								8,250 % fällig am 31.03.2032		4.300	275	
								8,750 % fällig am 28.02.2048		2.100	124	
								8,875 % fällig am 28.02.2035		3.000	191	
								10,500 % fällig am 21.12.2026		123.300	9,814	
								Turkey Government International Bond 4,250 % fällig am 13.03.2025	\$	1.800	1,770	
											0,23	
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE												
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,372 % fällig am 25.07.2036		6.632	0,83									
Aegis Asset-Backed Securities Trust 1,092 % fällig am 25.03.2035	^	871	0,11									
Ameriquest Mortgage Securities Trust 0,432 % fällig am 25.04.2036		2.648	0,34									
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,067 % fällig am 25.07.2035		3.990	0,51									

Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Steams Holdings LLC 'B' (d)(k)	147.250	\$ 212		Schneider Electric SE	604	\$ 95	0,01	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	76.200	2.629	0,34	Siemens AG	4.672	742	0,10	AGL Energy Ltd.	34.454	\$ 212	0,03
Suncorp Group Ltd.	12.446	104	0,01	Siemens Energy AG (d)	1.413	43	0,01	Dominion Energy, Inc.	3.052	224	0,03
Swiss Re AG	14.783	1.336	0,17	Sojitz Corp.	86.400	262	0,03	Duke Energy Corp.	2.766	273	0,04
Toronto-Dominion Bank	1.157	81	0,01	Sumitomo Corp.	73.000	980	0,13	E.ON SE	16.323	189	0,03
U.S. Bancorp	1.836	105	0,01	Union Pacific Corp.	962	212	0,03	Endesa S.A.	15.350	373	0,05
UnipolSai Assicurazioni SpA	35.936	104	0,01	United Parcel Service, Inc. 'B'	1.323	275	0,04	Enel SpA	36.470	339	0,04
Unum Group	3.785	107	0,01	Wartsila Oyj Abp	27.642	411	0,05	Exelon Corp.	2.396	106	0,01
Voyager Aviation Holdings LLC	15	0	0,00			13.841	1,79	Naturgy Energy Group S.A.	34.368	885	0,11
Wells Fargo & Co.	31.780	1.439	0,19	INFORMATIONSTECHNOLOGIE				PPL Corp.	19.735	552	0,07
Westpac Banking Corp.	4.938	96	0,01	Broadcom, Inc.	542	258	0,03	Red Electrica Corp. S.A.	4.955	92	0,01
Zurich Insurance Group AG	2.982	1.199	0,15	Canon, Inc.	113.200	2.561	0,33	Snam SpA	15.635	90	0,01
		26.284	3,39	Cisco Systems, Inc.	22.429	1.189	0,15	Southern Co.	4.843	293	0,04
				Corning, Inc.	3.716	152	0,02	SSE PLC	4.773	99	0,01
GESUNDHEITSWESEN				Hewlett Packard Enterprise Co.	26.448	386	0,05			3.727	0,48
AbbVie, Inc.	43.352	4.883	0,63	HP, Inc.	12.644	382	0,05			198.686	25,62
Amgen, Inc.	2.726	664	0,09	International Business Machines Corp.	27.147	3.979	0,51	BEZUGSRECHTE			
Astellas Pharma, Inc.	6.200	108	0,01	Juniper Networks, Inc.	3.798	104	0,02	ACS Actividades de			
Bayer AG	5.224	318	0,04	Konica Minolta, Inc.	44.900	249	0,03	Construccion y Servicios			
Bristol-Myers Squibb Co.	4.558	305	0,04	NetApp, Inc.	4.096	335	0,04	S.A. - Exp. 9. Juli 2021	26.276	37	0,00
Cardinal Health, Inc.	5.713	326	0,04	Nippon Electric Glass Co. Ltd.	10.200	240	0,03	OPTIONSSCHEINE			
Eli Lilly & Co.	525	121	0,02	QUALCOMM, Inc.	2.161	309	0,04	Guaranteed Rate, Inc. -			
Gilead Sciences, Inc.	24.952	1.718	0,22	Seagate Technology Holdings PLC	7.804	686	0,09	Exp. 31. Dezember 2060	705	85	0,01
Johnson & Johnson	8.270	1.362	0,17	Seiko Epson Corp.	20.800	366	0,05	Windstream Holdings II, LLC -			
Merck & Co., Inc.	9.990	777	0,10	Texas Instruments, Inc.	1.554	299	0,04	Exp. 21. September 2055	2.586	58	0,01
Novartis AG	6.819	623	0,08	Tokyo Electron Ltd.	300	130	0,02			143	0,02
Organon & Co. (d)	917	28	0,00	VTEch Holdings Ltd.	11.800	124	0,02	VORZUGSWERTPAPIERE			
Pfizer, Inc.	94.712	3.709	0,48	Western Digital Corp. (d)	1.373	98	0,01	Nationwide Building Society			
Roche Holding AG	2.047	772	0,10	Xerox Holdings Corp.	5.630	132	0,02	10,250 %	6.220	1.615	0,21
Sanofi	2.942	309	0,04			11.979	1,55	Schaeffler AG			
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.	15.200	511	0,07					0,000 %	20.964	194	0,03
		16.534	2,13					Voyager Aviation Holdings LLC			
				BAUSTOFFE				9,500 %	93	29	0,00
INDUSTRIEWERTE				Amcor PLC	8.775	101	0,01			1.838	0,24
3M Co.	6.185	1.229	0,16	BASF SE	31.073	2.453	0,32	REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS			
ABB Ltd.	15.420	524	0,07	BHP Group Ltd.	173.746	6.328	0,82	AGNC Investment Corp.	36.390	615	0,08
ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A.	26.574	712	0,09	BHP Group PLC	40.183	1.187	0,15	Annaly Capital			
Adecco Group AG	7.746	528	0,07	Covestro AG	1.661	107	0,01	Management, Inc.	131.941	1.172	0,15
AGC, Inc.	700	29	0,00	Dow, Inc.	21.442	1.357	0,18	H&R Real Estate			
Amada Co. Ltd.	13.100	133	0,02	Eastman Chemical Co.	760	89	0,01	Investment Trust	7.053	91	0,01
Aurizon Holdings Ltd.	69.259	193	0,03	Evonik Industries AG	2.844	95	0,01	Host Hotels & Resorts, Inc.	6.110	104	0,01
Bouygues S.A.	2.664	99	0,01	Evrax PLC	76.437	626	0,08	Iron Mountain, Inc.	24.783	1.049	0,14
Caterpillar, Inc.	590	128	0,02	Fortescue Metals Group Ltd.	90.073	1.575	0,20	Japan Retail Fund			
Cie de Saint-Gobain	3.338	220	0,03	International Paper Co.	15.233	934	0,12	Investment Corp.	122	132	0,02
CK Hutchison Holdings Ltd.	21.000	163	0,02	LyondellBasell Industries NV 'A'	17.090	1.758	0,23	Klepierre S.A.	6.287	162	0,02
Cummins, Inc.	673	164	0,02	Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	13.800	116	0,02	New Residential			
Deutsche Post AG	2.270	155	0,02	Mitsui Chemicals, Inc.	3.000	104	0,01	Investment Corp.	40.742	431	0,06
Eaton Corp. PLC	1.169	173	0,02	Nitto Denko Corp.	1.400	104	0,01	RioCan Real Estate			
Emerson Electric Co.	1.416	136	0,02	Norsk Hydro ASA	17.270	110	0,01	Investment Trust	7.205	128	0,02
Hitachi Ltd.	4.600	264	0,03	Rio Tinto Ltd.	33.158	3.147	0,41	Simon Property Group, Inc.	4.282	559	0,07
Hochtief AG	1.383	106	0,01	Rio Tinto PLC	41.777	3.446	0,45	Stockland	24.666	86	0,01
Illinois Tool Works, Inc.	438	98	0,01	Solvay S.A.	799	102	0,01	Unibail-Rodamco-Westfield	12.088	1.048	0,13
ITOCHU Corp.	7.800	225	0,03	Sumitomo Chemical Co. Ltd.	24.500	130	0,02	Uniti Group, Inc.	2.036	22	0,00
Kajima Corp.	7.900	100	0,01	Ube Industries Ltd.	5.000	102	0,01	Ventas, Inc.	7.014	401	0,05
Komatsu Ltd.	10.700	265	0,03	UPM-Kymmene Oyj	8.105	307	0,04	VEREIT, Inc.	3.319	152	0,02
Kone Oyj 'B'	1.287	105	0,01	voestalpine AG	2.417	99	0,01	VICI Properties, Inc.	114.584	3.554	0,46
ManpowerGroup, Inc.	589	70	0,01			24.377	3,14	Weyerhaeuser Co.	4.174	144	0,02
Marubeni Corp.	108.300	944	0,12						9.850	1,27	
Mitsubishi Corp.	102.000	2.789	0,36	IMMOBILIEN							
Mitsubishi Electric Corp.	11.400	166	0,02	Daito Trust Construction Co. Ltd.	5.100	557	0,07				
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	9.200	272	0,04	Daiwa House Industry Co. Ltd.	2.800	84	0,01				
Mitsui & Co. Ltd.	13.400	302	0,04								
NSK Ltd.	15.300	130	0,02								
Royal Mail PLC (d)	49.942	399	0,05								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
ARGENTINA TREASURY BILLS			
(3,480) % fällig am 13.09.2021 (e)(f) ARS	29.290	\$ 173	0,02
38,001 % fällig am 30.07.2021 (e)(f)	12.084	69	0,01
Summe kurzfristige Instrumente		242	0,03
Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 997.912	128,68
AKTIEN			
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)			
	87.473	871	0,11
Summe Investmentfonds		\$ 871	0,11

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	103	\$ (46)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	107	209	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	41	(51)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	899	772	0,10
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	147	(717)	(0,09)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	135	(1.245)	(0,16)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	9	(15)	0,00
				\$ (1.093)	(0,14)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (1.093)	(0,14)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 300	\$ 19	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2022	€ 1.400	(35)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	2.000	94	0,01
				\$ 78	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-28 5-Year Index	1,000 %	20.12.2022	\$ 1.880	\$ 74	0,01
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000	20.06.2023	940	21	0,00
CDX.EM-30 5-Year Index	1,000	20.12.2023	3.478	166	0,02
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000	20.06.2024	1.034	39	0,01
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	744	31	0,00
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	3.300	7	0,00
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	2.500	26	0,00
CDX.HY-34 5-Year Index	5,000	20.06.2025	276	18	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000	20.12.2025	2.400	35	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	15.700	194	0,03
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 5.400	35	0,01
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	6.500	10	0,00
				\$ 656	0,09

Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt ⁽⁵⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750%	15.09.2031	£ 7.200	\$ (69)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,840	03.01.2022	BRL 1.900	5	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,848	03.01.2022	1.600	4	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022	8.100	20	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,860	03.01.2022	8.100	20	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,865	03.01.2022	2.900	7	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	1.200	3	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,880	03.01.2022	5.200	13	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,883	03.01.2022	4.700	11	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,884	03.01.2022	1.000	2	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,886	03.01.2022	1.500	4	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,060	03.01.2022	48.200	(95)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	12.000	28	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,700	03.01.2022	296.800	(324)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,978	03.01.2022	10.300	(11)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,040	03.01.2022	10.600	(10)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,830	02.01.2023	10.900	53	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,836	02.01.2023	8.500	42	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,855	02.01.2023	2.800	14	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,170	02.01.2023	74.400	(43)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	\$ 32.900	70	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	25.488	179	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	16.200	(374)	(0,05)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	13.442	380	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,940	08.06.2026	2.000	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	17.06.2022	6.300	(126)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	1.766	59	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,235	12.05.2028	700	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2027	12.000	(366)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	47.620	(1.560)	(0,20)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	4.300	206	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,491	21.01.2051	900	(49)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2021	800	(9)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	2.000	(87)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,590	09.02.2051	7.200	(246)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	16.01.2050	3.100	104	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	03.02.2050	3.900	141	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,740	16.12.2026	1.100	(37)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.01.2030	8.600	(242)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	22.01.2050	7.600	61	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,875	07.02.2050	400	(9)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,895	18.10.2049	700	(2)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,910	17.10.2049	700	(6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.12.2029	2.600	(136)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.02.2030	5.000	(213)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.03.2030	2.500	(145)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.01.2050	1.400	(71)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	11.12.2049	7.100	(747)	(0,10)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	12.03.2050	3.400	(382)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2024	6.000	(52)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2024	10.900	(958)	(0,12)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2024	41.600	(1.660)	(0,21)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2026	32.300	(2.263)	(0,29)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,915	01.02.2026	ZAR 5.200	(11)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,020	11.02.2026	2.000	(5)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,970	10.03.2026	600	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	19.09.2023	86.800	(289)	(0,04)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	19.09.2028	78.300	339	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,000	15.03.2024	5.100	(29)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,250	15.03.2024	22.800	(119)	(0,02)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD 460	28	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	18.640	1.275	0,16
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024	1.600	53	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025	19.492	663	0,09
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024	650	6	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	18.06.2024	400	(4)	0,00
Erhalt ⁽⁵⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 4.300	3	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	18.03.2030	6.200	(18)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	2.300	38	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	100	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	200	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	100	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024	200	0	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,453	29.12.2023	200	0	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,020	20.09.2028	¥ 5.480.000	114	0,02
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,000	15.03.2029	3.500.000	59	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIE	4,580	10.06.2022	MXN 21.800	9	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	4,650	10.05.2022	84.100	25	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	4,740	03.06.2022	21.100	7	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	4,825	27.05.2022	8.600	2	0,00

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,120	06.05.2025	MXN 10.800	\$ (24)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,160	06.06.2025	9.300	(21)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,280	23.05.2025	3.700	(8)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,280	30.05.2025	9.000	(18)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,430	17.11.2021	2.900	10	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,535	04.05.2027	18.500	(53)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,610	07.07.2021	4.200	12	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,780	29.09.2022	12.930	43	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,795	02.06.2023	3.600	13	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,798	06.09.2021	20.000	55	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,810	02.05.2022	1.200	4	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,850	02.05.2022	5.300	16	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,900	20.07.2021	24.700	60	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,950	30.01.2026	12.300	45	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,980	26.08.2024	500	2	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,990	30.01.2026	15.000	54	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,080	10.03.2026	20.700	74	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,350	01.09.2023	3.300	9	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,490	08.09.2026	13.700	41	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,620	18.02.2030	600	2	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,710	20.09.2029	500	2	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,750	31.08.2021	7.900	9	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,150	11.06.2027	28.100	64	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,165	06.09.2032	3.000	8	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,199	03.12.2021	300	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,200	11.06.2027	2.900	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,350	17.11.2021	2.300	1	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,360	21.08.2037	3.100	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,370	11.10.2027	14.800	30	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,380	04.11.2026	400	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,380	14.08.2037	700	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,388	17.11.2021	1.800	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,480	18.06.2037	1.300	3	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,520	18.04.2023	30.200	45	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,530	18.04.2023	24.900	36	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,530	21.04.2023	3.100	4	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,538	23.02.2022	9.800	3	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,545	18.04.2023	19.100	27	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,603	14.04.2025	49.000	103	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,610	23.01.2023	18.100	32	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,610	15.04.2025	3.000	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,640	03.01.2023	2.200	3	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,645	03.01.2023	4.900	7	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,670	05.03.2025	52.900	117	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,700	02.05.2023	7.100	12	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,710	07.03.2025	6.400	15	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,715	07.03.2025	6.300	15	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,745	05.01.2023	3.400	5	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,800	28.12.2027	2.900	(8)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,805	06.02.2023	7.800	12	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,818	17.02.2027	11.400	16	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,820	06.02.2023	7.900	14	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,865	27.12.2022	5.000	8	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,865	02.02.2027	11.900	15	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,875	16.12.2022	2.800	4	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,880	27.12.2022	79.700	87	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,910	30.12.2027	600	(2)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,984	10.12.2027	6.800	(24)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,990	21.12.2027	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		8,005	21.12.2027	37.500	(109)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,010	04.02.2027	5.200	6	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		8,030	31.01.2028	4.600	(16)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		8,050	31.01.2028	3.400	(13)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,090	15.01.2027	13.000	14	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		8,103	04.01.2038	5.600	(26)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,120	15.01.2027	2.700	3	0,00
						\$ (5.867)	(0,76)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (5.133)	(0,66)

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Rückertlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,700 %	20.10.2021	6.700	\$ 10	\$ 6	0,00

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,641	07.07.2021	13.000	\$ 72	\$ 2	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.10.2021	6.700	\$ (6)	\$ (3)	0,00

DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus INR	INR 81.000	27.04.2022	357	\$ (6)	\$ (3)	0,00
GLM	Call - OTC USD versus CAD	CAD 1,265	11.02.2022	3.257	(33)	(40)	(0,01)
JPM	Call - OTC USD versus INR	INR 80.000	27.01.2022	151	(2)	(1)	0,00
MYI	Call - OTC USD versus INR	81.500	22.04.2022	1.338	(24)	(12)	0,00
UAG	Call - OTC USD versus INR	81.000	02.05.2022	356	(5)	(4)	0,00
					\$ (70)	\$ (60)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015 %	14.07.2021	1.200	\$ (5)	\$ (6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	14.07.2021	1.200	(5)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,013	11.08.2021	500	(2)	(1)	0,00
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	11.08.2021	500	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	16.07.2021	800	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	16.07.2021	800	(2)	(1)	0,00
BRC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	26.07.2021	300	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	26.07.2021	300	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	26.07.2021	300	(2)	(2)	0,00
FAR	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	26.07.2021	300	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	02.09.2021	1.300	(6)	(10)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	02.09.2021	1.300	(6)	(2)	0,00
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	11.08.2021	200	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	11.08.2021	200	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	9.700	(72)	0	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	15.07.2021	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	15.07.2021	500	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	10.08.2021	700	(10)	(16)	(0,01)
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	10.08.2021	700	(10)	(1)	0,00
							\$ (136)	\$ (51)	(0,01)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
FAR	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	13.000	\$ (57)	\$ (12)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Russia Government International Bond	1,000 %	20.12.2021	\$ 200	\$ (8)	\$ 9	\$ 1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	100	(6)	6	0	0,00
BRC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	100	(6)	7	1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	100	(6)	6	0	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	5,140	(169)	195	26	0,01
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	(9)	6	(3)	0,00

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinsatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 200	\$ (2)	\$ 3	\$ 1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	2	(2)	0	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	700	(11)	22	11	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	400	(3)	4	1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	100	(5)	5	0	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	(9)	5	(4)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	(19)	32	13	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	(7)	18	11	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	3.920	(86)	126	40	0,01
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.500	9	13	22	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(5)	5	0	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(6)	7	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.300	(38)	38	0	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	3.200	(50)	96	46	0,01
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2023	200	(6)	9	3	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	4	(1)	1	0	0,00
JPM	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.400	(29)	49	20	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	400	(3)	4	1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.400	(87)	93	6	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	800	(44)	43	(1)	0,00
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	(5)	13	8	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	1.000	(14)	22	8	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.500	(14)	22	8	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2023	2.800	(53)	90	37	0,01
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2022	4.600	(96)	119	23	0,00
					\$ (786)	\$ 1.066	\$ 280	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinsatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110 %	25.05.2046	\$ 430	\$ (85)	\$ 71	\$ (14)	0,00
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(6)	10	4	0,00
	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17.01.2047	393	(18)	21	3	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	2.200	(138)	160	22	0,01
FBF	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	25	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	752	(11)	14	3	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(5)	6	1	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	16.000	(8)	174	166	0,02
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	7.300	(38)	113	75	0,01
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	752	4	(1)	3	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	6.400	(361)	426	65	0,01
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	300	(12)	15	3	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	9	5	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	200	(11)	13	2	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	600	(47)	54	7	0,00
MYC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	681	(134)	113	(21)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	9	5	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	334	(8)	9	1	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	7	1	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	2.075	17	5	22	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	1.200	6	6	12	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	0	3	3	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	15.498	15	153	168	0,02
UAG	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	7	1	0,00
					\$ (860)	\$ 1.397	\$ 537	0,07

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
ÄZD	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,445 %	17.06.2025	CNY 17.500	\$ 0	\$ (29)	\$ (29)	0,00
CBK	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,845	23.01.2025	2.000	0	2	2	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,850	23.01.2025	2.900	0	3	3	0,00
UAG	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,833	23.01.2025	3.000	0	3	3	0,00
							\$ 0	\$ (21)	\$ (21)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BRC	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR plus festgelegter Spread	\$ 300	20.09.2021	\$ 0	\$ 6	\$ 6	0,00

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2021	AUD 200	\$ 150	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2021	MXN 5.696	\$ 288	3	0	3	0,00
	07.2021	\$ 735	€ 616	0	(5)	(5)	0,00
	07.2021	49	PEN 185	0	0	0	0,00
	08.2021	195	RUB 14.697	4	0	4	0,00
	09.2021	CNY 12.410	\$ 1.929	19	0	19	0,00
	09.2021	INR 27.436	\$ 373	7	0	7	0,00
	09.2021	\$ 388	RUB 28.333	0	(5)	(5)	0,00
BPS	07.2021	€ 723	\$ 877	19	0	19	0,00
	07.2021	¥ 78.041	\$ 714	10	0	10	0,00
	07.2021	TRY 624	\$ 73	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 3.594	CAD 4.330	0	(98)	(98)	(0,01)
	07.2021	6.028	€ 5.049	0	(41)	(41)	(0,01)
	07.2021	632	£ 455	0	(4)	(4)	0,00
	07.2021	126	MXN 2.502	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	90	RUB 6.726	2	0	2	0,00
	07.2021	400	TRY 3.375	0	(14)	(14)	0,00
	08.2021	PEN 1.540	\$ 417	14	0	14	0,00
	11.2021	MXN 17.306	\$ 857	2	0	2	0,00
BRC	07.2021	TRY 1.058	\$ 123	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 153	TRY 1.289	0	(5)	(5)	0,00
BSS	07.2021	49	PEN 184	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2021	AUD 2.526	\$ 1.954	57	0	57	0,01
	07.2021	CLP 50.105	\$ 68	0	0	0	0,00
	07.2021	MXN 10.052	\$ 495	0	(9)	(9)	0,00
	07.2021	PEN 7.116	\$ 1.849	21	(30)	(9)	0,00
	07.2021	RUB 21.898	\$ 302	3	0	3	0,00
	07.2021	TRY 2.046	\$ 235	2	(2)	0	0,00
	07.2021	\$ 70	CLP 50.105	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	3.573	PEN 13.938	68	0	68	0,01
	07.2021	230	RUB 17.792	13	0	13	0,00
	08.2021	PEN 7.403	\$ 1.954	20	(4)	16	0,00
	08.2021	\$ 457	PEN 1.816	19	0	19	0,00
	08.2021	242	RUB 18.170	5	0	5	0,00
	09.2021	PEN 4.353	\$ 1.163	23	0	23	0,00
	09.2021	\$ 2.002	CLP 1.434.584	1	(36)	(35)	0,00
	09.2021	373	PEN 1.451	7	0	7	0,00
	09.2021	ZAR 17.262	\$ 1.256	59	0	59	0,01
	10.2021	PEN 286	\$ 79	4	0	4	0,00
	12.2021	7.115	\$ 1.912	51	0	51	0,01
	12.2021	\$ 1.206	INR 92.466	13	0	13	0,00
	02.2022	ZAR 1.508	\$ 99	0	(4)	(4)	0,00
	04.2022	\$ 4	INR 347	0	0	0	0,00
GLM	07.2021	£ 22.253	\$ 31.460	717	0	717	0,09
	07.2021	MXN 4.505	\$ 227	1	0	1	0,00
	07.2021	PEN 675	\$ 170	0	(7)	(7)	0,00
	07.2021	TRY 234	\$ 27	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 355	€ 293	0	(8)	(8)	0,00
	07.2021	462	RUB 35.665	25	0	25	0,00
	07.2021	165	TRY 1.384	0	(6)	(6)	0,00
	08.2021	170	PEN 675	7	0	7	0,00
	08.2021	581	RUB 43.063	7	(2)	5	0,00
	09.2021	492	\$ 36.067	0	(4)	(4)	0,00
	09.2021	ZAR 8.967	\$ 651	29	0	29	0,00
	10.2021	\$ 6.026	MXN 122.318	26	0	26	0,00
	02.2022	CAD 764	\$ 633	16	0	16	0,00
	04.2022	\$ 397	INR 31.257	8	0	8	0,00
HUS	07.2021	330	€ 270	0	(10)	(10)	0,00
	07.2021	30.172	£ 21.798	0	(59)	(59)	(0,01)
	07.2021	280	PEN 1.085	4	0	4	0,00
	07.2021	64	TRY 540	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	£ 21.020	\$ 29.096	55	0	55	0,01
	08.2021	\$ 473	RUB 35.599	11	0	11	0,00
	09.2021	809	CNH 5.197	0	(8)	(8)	0,00
	09.2021	87	PEN 343	3	0	3	0,00
	09.2021	204	RUB 14.918	0	(2)	(2)	0,00
	10.2021	PEN 752	\$ 204	7	0	7	0,00
	10.2021	\$ 8.111	MXN 168.297	236	0	236	0,03
	12.2021	PEN 238	\$ 64	2	0	2	0,00
	12.2021	\$ 523	INR 40.254	8	0	8	0,00
	02.2022	ZAR 7.084	\$ 490	9	0	9	0,00
JPM	07.2021	MXN 18.572	\$ 929	0	(2)	(2)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2021	PEN 183	\$ 46	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07.2021	TRY 3.279	\$ 382	6	0	6	0,00
	07.2021	\$ 19	PEN 74	0	0	0	0,00
	07.2021	269	TRY 2.253	0	(10)	(10)	0,00
	08.2021	46	PEN 183	2	0	2	0,00
	09.2021	5.685	IDR 81.898.763	0	(101)	(101)	(0,01)
	12.2021	349	INR 26.350	0	(2)	(2)	0,00
	02.2022	ZAR 647	\$ 42	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07.2021	BRL 33.145	\$ 6.575	0	(30)	(30)	0,00
	07.2021	\$ 16.358	€ 13.715	0	(93)	(93)	(0,01)
	07.2021	6	PEN 24	0	0	0	0,00
	07.2021	187	RUB 14.346	9	0	9	0,00
	08.2021	6.554	BRL 33.145	30	0	30	0,00
	09.2021	42	PEN 167	2	0	2	0,00
	09.2021	450	ZAR 6.453	0	(2)	(2)	0,00
	04.2022	26.359	\$ 335	0	(7)	(7)	0,00
RYL	02.2022	ZAR 5.083	\$ 330	0	(16)	(16)	0,00
SCX	07.2021	€ 32.481	39.736	1.215	0	1.215	0,16
	07.2021	PEN 1.712	452	7	(2)	5	0,00
	07.2021	TRY 1.564	182	3	0	3	0,00
	07.2021	\$ 46	PEN 179	1	0	1	0,00
	09.2021	46	184	2	0	2	0,00
	12.2021	PEN 148	\$ 40	1	0	1	0,00
	12.2021	\$ 2.410	INR 181.019	0	(24)	(24)	0,00
SSB	07.2021	BRL 2.632	\$ 494	0	(30)	(30)	0,00
	07.2021	\$ 6.703	BRL 35.777	426	0	426	0,06
TOR	02.2022	ZAR 1.145	\$ 75	0	(3)	(3)	0,00
UAG	07.2021	\$ 706	RUB 54.163	33	0	33	0,01
	08.2021	3.503	NOK 28.958	0	(136)	(136)	(0,02)
	09.2021	201	RUB 14.738	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	ZAR 10.814	\$ 764	14	0	14	0,00
				\$ 3.371	\$ (831)	\$ 2.540	0,33

ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II, Class T EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€ 1.099	\$ 1.315	\$ 12	\$ 0	\$ 12	0,00
	07.2021	HKD 18.905	2.436	2	0	2	0,00
	07.2021	MXN 24	1	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 2.343	€ 1.930	0	(54)	(54)	(0,01)
	07.2021	2.435	HKD 18.905	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	963	SGD 1.293	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	ZAR 281	\$ 20	0	0	0	0,00
	08.2021	HKD 18.905	2.436	1	0	1	0,00
	08.2021	SGD 1.293	963	1	0	1	0,00
	08.2021	\$ 20	ZAR 281	0	0	0	0,00
BPS	07.2021	AUD 5.312	\$ 4.123	135	0	135	0,02
	07.2021	CNY 3.622	560	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	€ 3.722	4.514	100	0	100	0,01
	07.2021	¥ 1.403.484	12.832	187	0	187	0,03
	07.2021	SGD 1.293	978	15	0	15	0,00
	07.2021	\$ 203.217	€ 166.115	0	(6.221)	(6.221)	(0,80)
	07.2021	422	IDR 6.055.856	0	(5)	(5)	0,00
	07.2021	1	MXN 24	0	0	0	0,00
	07.2021	20	ZAR 281	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	MXN 24	\$ 1	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 558	CNY 3.622	1	0	1	0,00
BRC	07.2021	SEK 19.538	\$ 2.357	72	0	72	0,01
	07.2021	\$ 156	€ 129	0	(3)	(3)	0,00
CBK	07.2021	CHF 5.110	\$ 5.700	171	0	171	0,02
	07.2021	€ 9.990	11.886	39	0	39	0,01
	07.2021	IDR 6.055.856	416	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	ILS 706	217	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 5.551	CHF 5.110	0	(22)	(22)	0,00
	07.2021	558	€ 461	0	(12)	(12)	0,00
	08.2021	CHF 5.110	\$ 5.556	22	0	22	0,00
	08.2021	\$ 414	IDR 6.055.856	1	0	1	0,00
MYI	07.2021	BRL 2.498	\$ 498	0	0	0	0,00
	07.2021	€ 13.090	15.584	61	0	61	0,01
	07.2021	\$ 199	INR 14.813	0	0	0	0,00
	08.2021	INR 14.813	\$ 199	0	0	0	0,00
	08.2021	\$ 497	BRL 2.498	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	DKK 9.487	\$ 1.539	26	0	26	0,00
	07.2021	€ 5.020	5.971	17	0	17	0,00
	07.2021	\$ 568	CNY 3.622	0	(7)	(7)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
SSB	07.2021	\$ 260.434	€ 212.901	\$ 0	\$ (7.955)	\$ (7.955)	(1,03)		
	07.2021	€ 3.004	\$ 3.622	59	0	59	0,01		
	07.2021	\$ 471	BRL 2.498	27	0	27	0,00		
	07.2021	5.674	€ 4.653	0	(156)	(156)	(0,02)		
	07.2021	7.918	£ 5.730	0	(3)	(3)	0,00		
TOR	08.2021	£ 5.730	\$ 7.919	3	0	3	0,00		
	07.2021	CAD 7.674	6.352	154	0	154	0,02		
UAG	07.2021	\$ 257.693	€ 210.643	0	(7.892)	(7.892)	(1,02)		
	07.2021	£ 5.730	\$ 8.119	203	0	203	0,03		
	07.2021	INR 14.813	203	4	0	4	0,00		
	07.2021	RUB 1.222	17	0	0	0	0,00		
	07.2021	\$ 2.713	AUD 3.577	0	(28)	(2)	0,00		
	08.2021	AUD 3.577	\$ 2.714	28	0	28	0,00		
						\$ 1.342	\$ (22.363)	\$ (21.021)	(2,71)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (17.797)	(2,29)		

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	\$ 10.800	\$ (11.171)	(1,44)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (11.171)	(1,44)
Summe Anlagen		\$ 963.589	124,26
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (188.112)	(24,26)
Nettovermögen		\$ 775.477	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (i) Mit dem Fonds verbunden.
- (j) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (k) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Morgan Stanley 7,500 % fällig am 02.04.2032	15.03.2021	\$ 601	\$ 568	0,07
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	278	955	0,12
Noble Corp.	05.02.2021 - 08.02.2021	333	611	0,08
Stearns Holdings LLC 'B'	15.03.2021	258	212	0,03
		\$ 1.470	\$ 2.346	0,30

(l) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 36.217 als Sicherheiten verpfändet.

(m) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.825 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 13.641 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 18.034 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert¹

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 112.724	\$ 880.306	\$ 4.882	\$ 997.912
Investmentfonds	871	0	0	871
Finanzderivate ⁽³⁾	97	(24.120)	0	(24.023)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(11.171)	0	(11.171)
Summen	\$ 113.692	\$ 845.015	\$ 4.882	\$ 963.589

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 124.485	\$ 1.132.288	\$ 5.714	\$ 1.262.487
Investmentfonds	4.768	0	0	4.768
Pensionsgeschäfte	0	528	0	528
Finanzderivate ⁽³⁾	379	8.092	0	8.471
Summen	\$ 129.632	\$ 1.140.908	\$ 5.714	\$ 1.276.254

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
GRE	0,050 %	10.06.2021	12.07.2021	\$ (15.316)	\$ (15.317)	(1,97)
	0,060	06.05.2021	07.07.2021	(18.836)	(18.837)	(2,43)
	0,070	18.06.2021	02.07.2021	(2.401)	(2.401)	(0,31)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (36.555)	(4,71)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	% des Nettovermögens
BPG	(0,100) %	30.06.2021	01.07.2021	\$(1.834)	\$ (1.834)	(0,24)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (1.834)	(0,24)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (29)	\$ 0	\$ (29)
BOA	(41)	130	89
BPS	(5.906)	5.200	(706)
BRC	70	0	70
BSS	(1)	0	(1)
CBK	520	(440)	80
DUB	29	(270)	(241)
FAR	(24)	0	(24)
FBF	4	0	4
GLM	765	(660)	105
GST	394	(340)	54
HUS	304	(360)	(56)
JPM	(83)	0	(83)
MEI	14	0	14
MYC	52	(76)	(24)
MYI	(42)	0	(42)
RYL	(16)	0	(16)
SAL	207	(260)	(53)
SCX	(6.716)	5.910	(806)
SSB	326	(330)	(4)
TOR	(7.741)	6.790	(951)
UAG	117	0	117

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	68,63	64,44
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	55,10	59,53
Sonstige übertragbare Wertpapiere	4,95	5,56
Investmentfonds	0,11	0,49
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,14)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,66)	(1,09)
Freiverkehrsfinanzderivate	(2,29)	1,92
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,44)	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(4,71)	(5,39)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,24)	(0,29)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	2,86	3,18
Unternehmensanleihen und Wechsel	28,88	28,81
Kommunalanleihen und Wechsel	0,33	0,22
US-Regierungsbehörden	25,62	32,58
US-Schatzobligationen	16,29	13,05
Non-Agency-MBS	5,15	6,49
Forderungsbesicherte Wertpapiere	14,91	13,56
Staatsemissionen	7,46	6,27
Stammaktien	25,62	23,76
Bezugsrechte	0,00	0,01
Optionsscheine	0,02	0,16
Vorzugswertpapiere	0,24	0,18
Real Estate Investment Trusts	1,27	1,13
Kurzfristige Instrumente	0,03	0,13
Investmentfonds	0,11	0,49
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,14)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,09	0,10
Zinsswaps	(0,76)	(1,18)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Devisenoptionen	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,01)	0,00
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	0,04
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,07	0,07
Zinsswaps	0,00	0,00
Total Return Swaps auf Indizes	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,33	0,05
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,71)	1,77
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,44)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(24,26)	(30,94)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BANKEN UND FINANZEN				BANKEN UND FINANZEN				BANKEN UND FINANZEN			
AerCap Ireland Capital DAC 4,450 % fällig am 01.10.2025	\$ 4.800	\$ 5.289	0,10	Cooperative Rabobank UA 2,625 % fällig am 22.07.2024	\$ 6.600	\$ 6.954	0,13	Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % fällig am 04.12.2024	€ 1.100	\$ 1.338	0,02
AIB Group PLC 2,875 % fällig am 30.05.2031	€ 8.800	11.173	0,21	CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 12.05.2026	€ 27.100	35.026	0,65	0,750 % fällig am 16.03.2028	10.200	12.172	0,23
alstria office REIT-AG 1,500 % fällig am 23.06.2026	6.000	7.476	0,14	2,750 % fällig am 22.01.2028	€ 400	566	0,01	JPMorgan Chase & Co. 3,900 % fällig am 15.07.2025	\$ 1.700	1.881	0,03
Altearea S.C.A. 1,875 % fällig am 17.01.2028	13.000	15.985	0,30	Credit Agricole S.A. 1,907 % fällig am 16.06.2026	\$ 4.700	4.794	0,09	KBC Group NV 0,375 % fällig am 16.06.2027	€ 3.200	3.831	0,07
American Campus Communities Operating Partnership LP 3,750 % fällig am 15.04.2023	\$ 1.250	1.311	0,02	3,750 % fällig am 24.04.2023	6.100	6.455	0,12	Kojamo Oyj 0,875 % fällig am 28.05.2029	500	595	0,01
American Tower Corp. 3,375 % fällig am 15.05.2024	3.500	3.746	0,07	Credit Suisse Group AG 1,359 % fällig am 16.12.2024	13.200	13.408	0,25	1,875 % fällig am 27.05.2027	2.700	3.432	0,06
Assicurazioni Generali SpA 2,429 % fällig am 14.07.2031	€ 1.800	2.304	0,04	3,750 % fällig am 26.03.2025	3.070	3.332	0,06	Kookmin Bank 0,052 % fällig am 15.07.2025	8.100	9.701	0,18
Atrium European Real Estate Ltd. 3,000 % fällig am 11.09.2025	11.600	14.915	0,28	7,125 % fällig am 29.07.2022 (d)(f)	200	209	0,00	4,500 % fällig am 01.02.2029 (f)	\$ 8.200	9.377	0,17
AvalonBay Communities, Inc. 3,200 % fällig am 15.01.2028	\$ 4.100	4.456	0,08	Daiwa Securities Group, Inc. 3,129 % fällig am 19.04.2022	9.000	9.202	0,17	LeasePlan Corp. NV 0,250 % fällig am 23.02.2026	€ 15.000	17.741	0,33
Aviation Capital Group LLC 4,125 % fällig am 01.08.2025	9.080	9.819	0,18	Deutsche Bank AG 1,000 % fällig am 19.11.2025	€ 17.200	20.832	0,39	Lendlease Finance Ltd. 3,400 % fällig am 27.10.2027	AUD 24.900	19.816	0,37
AXA S.A. 1,375 % fällig am 07.10.2041	€ 5.800	6.881	0,13	1,375 % fällig am 10.06.2026	4.450	5.546	0,10	3,700 % fällig am 31.03.2031	4.800	3.828	0,07
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,875 % fällig am 18.09.2023	\$ 6.300	6.325	0,12	1,625 % fällig am 20.01.2027	7.400	9.234	0,17	Lloyds Banking Group PLC 4,375 % fällig am 22.03.2028	\$ 1.200	1.380	0,03
6,000 % fällig am 15.01.2026 (d)(f)	€ 15.000	20.360	0,38	1,750 % fällig am 19.11.2030	14.500	18.190	0,34	7,625 % fällig am 27.06.2023 (d)(f)	€ 57.070	86.478	1,60
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028	6.300	7.368	0,14	2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 9.000	12.993	0,24	Logicor Financing SARL 1,500 % fällig am 14.11.2022	€ 8.500	10.266	0,19
Banco Santander S.A. 0,625 % fällig am 24.06.2029	5.200	6.164	0,11	2,625 % fällig am 12.02.2026	€ 600	780	0,01	1,625 % fällig am 15.07.2027	1.100	1.376	0,03
1,125 % fällig am 23.06.2027	7.300	9.031	0,17	3,300 % fällig am 16.11.2022	\$ 16.600	17.203	0,32	2,250 % fällig am 13.05.2025	13.000	16.536	0,31
Bank of America Corp. 1,197 % fällig am 24.10.2026	\$ 17.700	17.551	0,33	3,961 % fällig am 26.11.2025	6.800	7.356	0,14	3,250 % fällig am 13.11.2028	13.000	17.951	0,33
3,419 % fällig am 20.12.2028	3.750	4.087	0,08	4,250 % fällig am 14.10.2021	16.700	16.882	0,31	Mid-America Apartments LP 3,600 % fällig am 01.06.2027	\$ 300	334	0,01
Bank of Ireland Group PLC 0,375 % fällig am 10.05.2027	€ 12.300	14.516	0,27	Digital Euro Finco BV 0,125 % fällig am 15.10.2022	€ 2.300	2.739	0,05	3,750 % fällig am 15.06.2024	2.061	2.230	0,04
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,250 % fällig am 29.06.2028	500	592	0,01	0,625 % fällig am 15.07.2025	4.600	5.565	0,10	4,300 % fällig am 15.10.2023	2.200	2.364	0,04
1,148 % fällig am 20.07.2023	\$ 6.400	6.504	0,12	1,000 % fällig am 15.01.2032	1.000	1.176	0,02	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,978 % fällig am 09.06.2024	€ 3.200	3.921	0,07
Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022 (f)	952	1.039	0,02	Digital Dutch Finco BV 0,125 % fällig am 15.10.2022	€ 2.300	2.739	0,05	1,412 % fällig am 17.07.2025	\$ 11.200	11.312	0,21
Barclays PLC 1,500 % fällig am 03.09.2023	€ 1.900	2.337	0,04	Digital Intrepid Holding BV 0,625 % fällig am 15.07.2031	10.300	11.820	0,22	Mizuho Financial Group, Inc. 0,849 % fällig am 08.09.2024	17.100	17.192	0,32
1,700 % fällig am 03.11.2026	€ 5.400	7.578	0,14	5,125 % fällig am 30.11.2024	\$ 3.154	3.170	0,06	1,178 % fällig am 10.07.2024	13.900	14.101	0,26
2,852 % fällig am 07.05.2026	\$ 12.900	13.636	0,25	Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust 1,125 % fällig am 30.11.2024	\$ 3.154	3.170	0,06	2,555 % fällig am 13.09.2025	12.000	12.574	0,23
3,684 % fällig am 10.01.2023	1.700	1.729	0,03	Essex Portfolio LP 3,375 % fällig am 15.04.2026	1.000	1.085	0,02	3,752 % fällig am 19.07.2023	AUD 10.400	8.266	0,15
4,610 % fällig am 15.02.2023	11.800	12.103	0,22	Europäische Investitionsbank 0,750 % fällig am 15.11.2024	€ 9.700	13.562	0,25	Morgan Stanley 3,875 % fällig am 27.01.2026	\$ 4.100	4.586	0,09
BNP Paribas S.A. 2,219 % fällig am 09.06.2026	13.300	13.716	0,25	Federal Realty Investment Trust 3,250 % fällig am 15.07.2027	\$ 600	647	0,01	MPT Operating Partnership LP 2,550 % fällig am 05.12.2023	€ 1.300	1.846	0,03
CA Immobilien Anlagen AG 1,000 % fällig am 27.10.2025	€ 7.100	8.613	0,16	Ford Motor Credit Co. LLC 1,391 % fällig am 15.02.2023	12.200	12.158	0,23	Nationwide Building Society 3,766 % fällig am 08.03.2024	\$ 7.100	7.459	0,14
CaixaBank S.A. 0,375 % fällig am 18.11.2026	7.000	8.319	0,15	1,744 % fällig am 19.07.2024	€ 7.600	9.161	0,17	Natwest Group PLC 0,750 % fällig am 15.11.2025	€ 15.000	18.161	0,34
0,750 % fällig am 26.05.2028	2.100	2.507	0,05	2,748 % fällig am 14.06.2024	€ 4.600	6.454	0,12	0,780 % fällig am 26.02.2030	15.000	17.809	0,33
Capital One Financial Corp. 4,250 % fällig am 30.04.2025	\$ 7.400	8.252	0,15	3,339 % fällig am 28.03.2022	\$ 2.600	2.646	0,05	8,625 % fällig am 15.08.2021 (d)(f)	\$ 2.400	2.423	0,04
Castellum AB 0,750 % fällig am 04.09.2026	€ 9.700	11.588	0,21	3,340 % fällig am 07.01.2022	12.200	12.319	0,23	NatWest Markets PLC 0,362 % fällig am 27.09.2021	€ 5.800	6.892	0,13
2,125 % fällig am 20.11.2023	4.500	5.599	0,10	3,370 % fällig am 17.11.2023	15.300	15.880	0,29	NE Property BV 1,875 % fällig am 09.10.2026	10.700	13.063	0,24
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % fällig am 27.01.2028	13.300	15.636	0,29	3,550 % fällig am 07.10.2022	9.100	9.356	0,17	3,375 % fällig am 14.07.2027	8.800	11.616	0,22
Ceetrus S.A. 2,750 % fällig am 26.11.2026	8.800	11.415	0,21	4,375 % fällig am 06.08.2023	500	529	0,01	Nissan Motor Acceptance Corp. 3,650 % fällig am 21.09.2021	\$ 1.000	1.007	0,02
Citigroup, Inc. 1,250 % fällig am 06.07.2026	5.000	6.193	0,11	GE Capital Funding LLC 4,400 % fällig am 15.05.2030	15.500	18.076	0,34	3,875 % fällig am 21.09.2023	3.500	3.706	0,07
2,572 % fällig am 03.06.2031 (g)	\$ 4.000	4.116	0,08	General Motors Financial Co., Inc. 4,250 % fällig am 15.05.2023	14.900	15.843	0,29	Nomura Holdings, Inc. 2,679 % fällig am 16.07.2030	7.300	7.426	0,14
2,876 % fällig am 24.07.2023	3.280	3.365	0,06	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	€ 7.100	9.133	0,17	OneMain Finance Corp. 6,125 % fällig am 15.05.2022	4.200	4.374	0,08
4,044 % fällig am 01.06.2024	2.400	2.557	0,05	GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2030	\$ 2.600	2.794	0,05	6,875 % fällig am 15.03.2025	1.800	2.034	0,04
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	€ 15.000	17.864	0,33	5,300 % fällig am 15.01.2029	2.000	2.335	0,04	Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.03.2023	6.800	7.149	0,13
Clarion Funding PLC 1,250 % fällig am 13.11.2032	€ 5.500	7.316	0,14	Goodman HK Finance 4,375 % fällig am 19.06.2024	5.045	5.474	0,10	Piper Sandler Cos. 5,200 % fällig am 15.10.2023	8.500	8.521	0,16
				Goodman U.S. Finance Four LLC 4,500 % fällig am 15.10.2037	6.900	7.984	0,15	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A. Via PKO Finance AB 4,630 % fällig am 26.09.2022	18.900	19.798	0,37
				Grupo Aval Ltd. 4,750 % fällig am 26.09.2022	17.000	17.507	0,32	Prologis International Funding S.A. 1,625 % fällig am 17.06.2032	€ 1.000	1.284	0,02
				GSPA Monetization Trust 6,422 % fällig am 09.10.2029	11.949	12.977	0,24	RCI Banque S.A. 2,000 % fällig am 11.07.2024	18.600	23.234	0,43
				Host Hotels & Resorts LP 4,500 % fällig am 01.02.2026	7.800	8.577	0,16	Reliance Standard Life Global Funding 3,850 % fällig am 19.09.2023	\$ 6.950	7.439	0,14
				Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,835 % fällig am 13.12.2027	3.300	3.568	0,07	Sagax AB 1,125 % fällig am 30.01.2027	€ 11.700	14.185	0,26
				ING Groep NV 1,125 % fällig am 07.12.2028	€ 9.100	12.328	0,23				
				1,400 % fällig am 01.07.2026	\$ 11.000	11.036	0,20				

Aufstellung der Wertpapieranlagen Total Return Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB				Boeing Co				Motorola Solutions, Inc.			
1,000 % fällig am 12.08.2027	€ 8.100	\$ 9.719	0,18	1,167 % fällig am 04.02.2023	\$ 8.800	\$ 8.837	0,16	2,300 % fällig am 15.11.2030	\$ 12.400	\$ 12.196	0,23
1,125 % fällig am 04.09.2026	12.600	15.339	0,28	2,750 % fällig am 01.02.2026	19.000	19.860	0,37	NetApp, Inc.			
Santander Holdings USA, Inc.				Broadcom, Inc.				1,875 % fällig am 22.06.2025	9.154	9.418	0,17
3,450 % fällig am 02.06.2025	\$ 8.200	8.816	0,16	2,600 % fällig am 15.02.2033	16.000	15.664	0,29	2,700 % fällig am 22.06.2030	5.200	5.433	0,10
SATO Oyj				3,459 % fällig am 15.09.2026	12.716	13.857	0,26	Netflix, Inc.			
1,375 % fällig am 24.02.2028	€ 2.600	3.203	0,06	4,110 % fällig am 15.09.2028	12.732	14.336	0,27	4,625 % fällig am 15.05.2029	€ 1.700	2.523	0,05
SBB Treasury Oyj				4,150 % fällig am 15.11.2030	5.400	6.062	0,11	Nidec Corp.			
1,125 % fällig am 26.11.2029	1.000	1.182	0,02	4,300 % fällig am 15.11.2032	4.800	5.472	0,10	0,046 % fällig am 30.03.2026	10.000	11.862	0,22
Shinhan Bank Co. Ltd.				5,000 % fällig am 15.04.2030	2.200	2.598	0,05	Nissan Motor Co. Ltd.			
0,250 % fällig am 16.10.2024	14.000	16.771	0,31	Burberry Group PLC				4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 2.500	2.750	0,05
Societe Generale S.A.				1,125 % fällig am 21.09.2025	£ 4.000	5.516	0,10	4,810 % fällig am 17.09.2030	15.800	17.854	0,33
1,488 % fällig am 14.12.2026	\$ 14.100	13.982	0,26	Campbell Soup Co.				Novartis Finance S.A.			
Society of Lloyd's				4,150 % fällig am 15.03.2028	\$ 1.600	1.827	0,03	0,000 % fällig am 23.09.2028 (b)	€ 8.000	9.379	0,17
4,750 % fällig am 30.10.2024	£ 19.600	30.030	0,56	Centene Corp.				NXP BV			
Standard Chartered PLC				4,625 % fällig am 15.12.2029	5.000	5.505	0,10	3,875 % fällig am 18.06.2026	\$ 9.900	10.975	0,20
1,456 % fällig am 14.01.2027	\$ 15.800	15.674	0,29	Central Nippon Expressway Co. Ltd.				4,625 % fällig am 01.06.2023	1.979	2.128	0,04
4,247 % fällig am 20.01.2023	1.800	1.837	0,03	0,616 % fällig am 15.02.2022	27.200	27.260	0,51	Pearson Funding PLC			
Stifel Financial Corp.				0,735 % fällig am 02.11.2021	8.750	8.764	0,16	3,750 % fällig am 04.06.2030	£ 4.500	6.948	0,13
4,000 % fällig am 15.05.2030	12.900	14.329	0,27	2,567 % fällig am 02.11.2021	46.600	46.919	0,87	Royalty Pharma PLC			
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				Chanel Ceres PLC				1,200 % fällig am 02.09.2025	\$ 3.000	2.975	0,05
1,474 % fällig am 08.07.2025	6.800	6.872	0,13	0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 17.000	20.343	0,38	SEB S.A.			
Tesco Property Finance PLC				1,000 % fällig am 31.07.2031	10.200	12.160	0,23	1,375 % fällig am 16.06.2025	€ 5.000	6.122	0,11
5,744 % fällig am 13.04.2040	£ 4.936	9.156	0,17	Charter Communications Operating LLC				Siemens Financieringsmaatschappij NV			
5,801 % fällig am 13.10.2040	2.213	4.109	0,08	4,908 % fällig am 23.07.2025	\$ 17.900	20.291	0,38	1,200 % fällig am 11.03.2026	\$ 2.200	2.203	0,04
UBS AG				Cheniere Corpus Christi Holdings LLC				Sprint Spectrum Co. LLC			
5,125 % fällig am 15.05.2024 (f)	\$ 21.200	23.418	0,43	5,125 % fällig am 30.06.2027	8.700	10.126	0,19	4,738 % fällig am 20.03.2025	2.742	2.949	0,05
UBS Group AG				Choice Hotels International, Inc.				Stora Enso Oyj			
5,125 % fällig am 29.07.2026 (d)(f)	1.300	1.418	0,03	3,700 % fällig am 01.12.2029	1.500	1.630	0,03	0,625 % fällig am 02.12.2030	€ 4.400	5.205	0,10
UniCredit SpA				Conagra Brands, Inc.				Sutter Health			
2,200 % fällig am 22.07.2027	€ 9.700	12.242	0,23	4,300 % fällig am 01.05.2024	4.800	5.268	0,10	2,294 % fällig am 15.08.2030	\$ 12.700	12.830	0,24
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 26.900	31.184	0,58	CVS Health Corp.				Syngenta Finance NV			
Unipol Gruppo SpA				2,625 % fällig am 15.08.2024	5.300	5.596	0,10	3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 7.000	9.257	0,17
3,250 % fällig am 23.09.2030	€ 20.900	27.951	0,52	3,000 % fällig am 15.08.2026	3.600	3.886	0,07	Sysco Corp.			
Vesteda Finance BV				D.R. Horton, Inc.				5,650 % fällig am 01.04.2025	\$ 697	808	0,01
1,500 % fällig am 24.05.2027	3.400	4.316	0,08	4,750 % fällig am 15.02.2023	4.900	5.182	0,10	T-Mobile USA, Inc.			
Volkswagen Bank GmbH				Daimler Finance North America LLC				3,875 % fällig am 15.04.2030	3.175	3.560	0,07
0,934 % fällig am 01.08.2022	1.300	1.562	0,03	0,750 % fällig am 01.03.2024	10.000	10.024	0,19	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.			
1,250 % fällig am 01.08.2022	4.800	5.786	0,11	1,450 % fällig am 02.03.2026	5.000	5.025	0,09	2,050 % fällig am 31.03.2030	700	695	0,01
1,875 % fällig am 31.01.2024	34.600	43.050	0,80	2,550 % fällig am 15.08.2022	4.700	4.812	0,09	Tesco Corporate Treasury Services PLC			
Volkswagen Financial Services NV				Dell International LLC				0,375 % fällig am 27.07.2029	€ 7.400	8.580	0,16
1,125 % fällig am 18.09.2023	£ 15.400	21.457	0,40	5,450 % fällig am 15.06.2023	17.200	18.665	0,35	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV			
1,625 % fällig am 30.11.2022	7.600	10.643	0,20	Delta Air Lines Pass-Through Trust				1,250 % fällig am 31.03.2023	3.400	3.950	0,07
Volkswagen Leasing GmbH				2,000 % fällig am 10.12.2029	3.479	3.506	0,06	6,000 % fällig am 15.04.2024	\$ 15.700	16.688	0,31
1,000 % fällig am 16.02.2023	€ 2.100	2.537	0,05	Emory University				Tomator Oyj			
Wells Fargo & Co.				2,143 % fällig am 01.09.2030	10.400	10.633	0,20	1,250 % fällig am 14.10.2026	€ 5.600	6.922	0,13
2,393 % fällig am 02.06.2028	\$ 5.500	5.708	0,11	Energy Transfer LP				United Airlines Pass-Through Trust			
3,000 % fällig am 22.04.2026	1.600	1.721	0,03	4,500 % fällig am 15.04.2024	5.300	5.773	0,11	2,875 % fällig am 07.04.2030	\$ 3.586	3.671	0,07
Workspace Group PLC				Entergy Louisiana LLC				VMware, Inc.			
2,250 % fällig am 11.03.2028	£ 7.600	10.454	0,19	2,350 % fällig am 15.06.2032	14.000	14.189	0,26	2,950 % fällig am 21.08.2022	3.000	3.078	0,06
		1.614.994	29,93	EQM Midstream Partners LP				Volkswagen Group of America Finance LLC			
				4,750 % fällig am 15.07.2023	2.917	3.049	0,06	4,750 % fällig am 13.11.2028	3.000	3.559	0,07
INDUSTRIEWERTE				Expedia Group, Inc.				Walt Disney Co.			
Activision Blizzard, Inc.				3,800 % fällig am 15.02.2028	3.790	4.124	0,08	2,650 % fällig am 13.01.2031	6.200	6.514	0,12
2,500 % fällig am 15.09.2050	\$ 2.900	2.610	0,05	General Motors Co.							
Altice France S.A.				6,125 % fällig am 01.10.2025 (g)	11.900	14.096	0,26				
7,375 % fällig am 01.05.2026	220	229	0,00	Global Switch Finance BV							
Amdocs Ltd.				1,375 % fällig am 07.10.2030	€ 1.700	2.061	0,04	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
2,538 % fällig am 15.06.2030	7.600	7.609	0,14	Gray Oak Pipeline LLC				Alabama Power Co.			
Amgen, Inc.				3,450 % fällig am 15.10.2027	\$ 12.600	13.265	0,25	1,450 % fällig am 15.09.2030	4.500	4.302	0,08
2,600 % fällig am 19.08.2026	11.750	12.483	0,23	Hyatt Hotels Corp.				AT&T, Inc.			
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.				3,135 % fällig am 01.09.2022	6.000	6.023	0,11	1,650 % fällig am 01.02.2028	18.100	17.977	0,33
4,500 % fällig am 01.06.2050	12.700	15.482	0,29	Imperial Brands Finance PLC				2,300 % fällig am 01.06.2027	12.600	13.043	0,24
Arrow Electronics, Inc.				3,125 % fällig am 26.07.2024	12.000	12.637	0,23	2,750 % fällig am 01.06.2031	4.800	4.995	0,09
4,500 % fällig am 01.03.2023	7.300	7.682	0,14	Informa PLC				3,300 % fällig am 01.02.2052	11.900	11.607	0,22
Atlantia SpA				2,125 % fällig am 06.10.2025	€ 15.300	19.343	0,36	Avangrid, Inc.			
1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 26.700	32.629	0,60	International Flavors & Fragrances, Inc.				3,800 % fällig am 01.06.2029	2.615	2.954	0,06
Babcock International Group PLC				2,300 % fällig am 01.11.2030	\$ 11.900	11.848	0,22	DTE Energy Co.			
1,375 % fällig am 13.09.2027	8.300	10.020	0,19	3,200 % fällig am 01.05.2023	5.400	5.623	0,10	1,050 % fällig am 01.06.2025	2.600	2.601	0,05
Bacardi Ltd.				Kansas City Southern				Duke Energy Progress LLC			
4,450 % fällig am 15.05.2025	\$ 15.300	17.026	0,32	3,125 % fällig am 01.06.2026	7.050	7.635	0,14	3,375 % fällig am 01.09.2023	100	107	0,00
Bayer U.S. Finance LLC				Marks & Spencer PLC				Edison International			
1,129 % fällig am 15.12.2023	8.000	8.118	0,15	3,750 % fällig am 19.05.2026	£ 7.500	10.791	0,20	3,550 % fällig am 15.11.2024	10.200	10.854	0,20
Boardwalk Pipelines LP				Motability Operations Group PLC				EDP Finance BV			
3,400 % fällig am 15.02.2031	7.700	8.180	0,15	0,125 % fällig am 20.07.2028	€ 2.400	2.827	0,05	1,710 % fällig am 24.01.2028	12.700	12.597	0,23

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Enel Finance International NV				1,316 % fällig am 25.10.2044	\$ 26	\$ 27	0,00	6,000 % fällig am 01.05.2024 -			
1,000 % fällig am 20.10.2027	£ 2.300	\$ 3.124	0,06	1,328 % fällig am 25.02.2045	67	68	0,00	01.02.2041	\$ 2.010	\$ 2.354	0,04
1,125 % fällig am 17.10.2034	€ 11.000	13.653	0,25	1,336 % fällig am 25.08.2022 (a)	45.545	527	0,01	6,500 % fällig am 01.04.2022 -			
ESB Finance DAC				1,516 % fällig am 25.07.2044	157	162	0,00	01.03.2037	96	112	0,00
1,125 % fällig am 11.06.2030	200	251	0,00	1,974 % fällig am 01.09.2035	34	35	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
Evergy, Inc.				2,301 % fällig am 01.11.2035	47	48	0,00	2,000 % fällig am 01.07.2036 -			
2,450 % fällig am 15.09.2024	\$ 12.600	13.204	0,25	2,369 % fällig am 01.09.2028	25	1	0,00	01.09.2051	613.600	620.218	11,50
FirstEnergy Corp.				2,583 % fällig am 01.01.2028	1	1	0,00	2,500 % fällig am 01.09.2051	108.600	111.879	2,07
7,375 % fällig am 15.11.2031	450	617	0,01	2,625 % fällig am 01.07.2032	4	4	0,00	3,500 % fällig am 01.08.2036 -			
IPALCO Enterprises, Inc.				2,653 % fällig am 01.07.2027	1	1	0,00	01.08.2051	79.130	83.477	1,55
3,700 % fällig am 01.09.2024	5.500	5.924	0,11	2,688 % fällig am 01.07.2030	0	0	0,00	4,500 % fällig am 01.07.2036	100	105	0,00
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				2,750 % fällig am 15.09.2040	491	516	0,01				
2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD 2.000	1.514	0,03	4,000 % fällig am 01.10.2029 -							
2,244 % fällig am 15.06.2067	\$ 791	739	0,01	01.10.2047	1.353	1.455	0,03	US-SCHATZOBIGATIONEN			
Pacific Gas & Electric Co.				4,500 % fällig am 01.04.2029 -				U.S. Treasury Bonds			
1,750 % fällig am 16.06.2022	10.800	10.796	0,20	01.07.2033	197	213	0,00	1,375 % fällig am 15.11.2040	163.600	147.023	2,73
2,100 % fällig am 01.08.2027	3.200	3.111	0,06	5,500 % fällig am 01.03.2023 -				1,375 % fällig am 15.08.2050 (h)	137.800	116.209	2,15
3,150 % fällig am 01.01.2026	12.500	12.902	0,24	01.06.2039	2.747	3.189	0,06	1,625 % fällig am 15.11.2050 (h)	70.900	63.699	1,18
3,300 % fällig am 15.03.2027 ^	2.800	2.902	0,05	6,000 % fällig am 01.10.2027 -				1,875 % fällig am 15.02.2041 (i)	19.400	18.997	0,35
3,300 % fällig am 01.12.2027 ^	4.800	4.939	0,09	01.05.2040	6.297	7.374	0,14	2,000 % fällig am 15.02.2050	26.200	25.748	0,48
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	5.700	5.986	0,11	6,500 % fällig am 15.09.2028	72	82	0,00	2,500 % fällig am 15.02.2045	6.100	6.602	0,12
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	3.600	3.778	0,07	9,403 % fällig am 15.03.2044	13.863	15.948	0,30	2,875 % fällig am 15.08.2045	5.200	6.013	0,11
4,250 % fällig am 01.08.2023	1.300	1.378	0,03	Ginnie Mae				3,000 % fällig am 15.05.2042	2.900	3.396	0,06
4,650 % fällig am 01.08.2028	2.400	2.644	0,05	0,580 % fällig am 20.09.2065	2.019	2.030	0,04	3,000 % fällig am 15.11.2044	205.100	241.521	4,48
4,750 % fällig am 15.02.2044 ^	1.700	1.724	0,03	0,627 % fällig am 20.08.2062	1.731	1.741	0,03	3,125 % fällig am 15.11.2041	15.300	18.244	0,34
Puget Energy, Inc.				0,707 % fällig am 20.08.2065	25.166	25.447	0,47	3,125 % fällig am 15.02.2043	5.600	6.693	0,13
4,100 % fällig am 15.06.2030	10.400	11.659	0,22	0,907 % fällig am 20.01.2066	12.775	13.001	0,24	3,125 % fällig am 15.08.2044	23.500	28.210	0,52
San Diego Gas & Electric Co.				1,031 % fällig am 20.06.2067	4.210	4.276	0,08	3,375 % fällig am 15.05.2044	47.300	58.994	1,09
3,600 % fällig am 01.09.2023	100	106	0,00	1,080 % fällig am 20.11.2067	8.286	8.430	0,16	3,625 % fällig am 15.02.2044	24.700	31.933	0,59
Sprint Communications, Inc.				2,000 % fällig am 20.02.2028 -				3,750 % fällig am 15.08.2041	18.600	24.171	0,45
6,000 % fällig am 15.11.2022	2.900	3.074	0,06	20.01.2032	31	32	0,00	3,750 % fällig am 15.11.2043	5.000	6.565	0,12
Sprint Corp.				2,125 % fällig am 20.10.2026 -				4,375 % fällig am 15.11.2039	10.100	14.054	0,26
7,250 % fällig am 15.09.2021	5.800	5.898	0,11	20.12.2034	35	37	0,00	U.S. Treasury Notes			
7,875 % fällig am 15.09.2023	3.400	3.867	0,07	2,250 % fällig am 20.07.2025 -				1,750 % fällig am 30.06.2024	16.700	17.346	0,32
Telefonica Chile S.A.				20.07.2034	63	65	0,00				
3,875 % fällig am 12.10.2022	19.300	19.929	0,37	2,875 % fällig am 20.04.2030	7	7	0,00	NON-AGENCY-MBS			
VTR Comunicaciones Spa				3,000 % fällig am 15.10.2049	1.600	1.665	0,03	American Home Mortgage Investment Trust			
5,125 % fällig am 15.01.2028	898	940	0,02	5,000 % fällig am 15.03.2034 -				0,452 % fällig am 25.12.2046	162	156	0,00
WEC Energy Group, Inc.				15.08.2047	822	942	0,02	1,749 % fällig am 25.02.2044	1.360	1.390	0,03
1,375 % fällig am 15.10.2027	5.000	4.889	0,09	6,000 % fällig am 20.09.2038	3	3	0,00	2,171 % fällig am 25.02.2045	95	96	0,00
				8,000 % fällig am 20.05.2031	11	13	0,00	Angel Oak Mortgage Trust			
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		220.585	4,09	Ginnie Mae, TBA				1,469 % fällig am 25.06.2065	3.289	3.311	0,06
		2.601.587	48,22	2,000 % fällig am 01.08.2051	5.500	5.592	0,10	Ashford Hospitality Trust			
				2,500 % fällig am 01.07.2051	12.800	13.229	0,25	1,073 % fällig am 15.06.2035	8.900	8.920	0,17
				4,000 % fällig am 01.08.2051	13.000	13.915	0,26	Banc of America Funding Trust			
				5,000 % fällig am 01.07.2051	13.400	15.111	0,28	2,224 % fällig am 25.06.2034	26	26	0,00
				Small Business Administration				2,852 % fällig am 25.05.2035	2.048	2.076	0,04
				5,870 % fällig am 01.07.2028	17	19	0,00	2,854 % fällig am 20.09.2035 ^	1.221	1.161	0,02
				6,220 % fällig am 01.12.2028	786	882	0,02	Banc of America Mortgage Trust			
				Uniform Mortgage-Backed Security				2,483 % fällig am 25.07.2034	235	240	0,00
				Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2008				2,982 % fällig am 25.07.2035 ^	309	309	0,01
				6,300 % fällig am 01.12.2021	45	46	0,00	BankUnited Trust			
				Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2008				0,692 % fällig am 25.09.2045	1.178	1.191	0,02
				5,630 % fällig am 01.01.2022	1.120	1.141	0,02	Barclays Commercial Mortgage Securities Trust			
				Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015				4,314 % fällig am 15.12.2051	8.000	9.314	0,17
				7,750 % fällig am 01.01.2042	901	1.029	0,02	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
				Los Angeles Community College District, California General Obligation				2,500 % fällig am 25.04.2033	17	18	0,00
				Notes, Series 2020				2,520 % fällig am 25.04.2034	214	210	0,00
				1,606 % fällig am 01.08.2028	15.800	15.847	0,29	2,568 % fällig am 25.04.2034	354	337	0,01
				Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds,				2,742 % fällig am 25.01.2034	227	235	0,00
				Series 2020				2,752 % fällig am 25.12.2035	176	186	0,00
				3,301 % fällig am 01.06.2033	7.125	7.406	0,14	2,780 % fällig am 25.11.2030	2	2	0,00
				University of California Revenue Notes, Series 2020				2,849 % fällig am 25.04.2034	124	124	0,00
				0,883 % fällig am 15.05.2025	5.500			2,893 % fällig am 25.02.2034	87	88	0,00
								3,128 % fällig am 25.07.2034	8	8	0,00
								Bear Stearns ALT-A Trust			
								0,412 % fällig am 25.02.2034	61	60	0,00
								2,624 % fällig am 25.05.2035	525	538	0,01
								3,008 % fällig am 25.09.2035 ^	514	402	0,01
								Citigroup Mortgage Loan Trust			
								0,572 % fällig am 25.11.2036	121	122	0,00
								2,530 % fällig am 25.10.2035	48	49	0,00
								3,234 % fällig am 25.09.2037 ^	142	141	0,00
								Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
								2,220 % fällig am 25.09.2035	1.571	1.644	0,03
								Commercial Mortgage Trust			
								3,144 % fällig am 10.03.2048	7.444	7.757	0,14
								3,545 % fällig am 10.02.2036	11.300	12.254	0,23
								3,590 % fällig am 10.11.2047	12.200	13.146	0,24

Aufstellung der Wertpapieranlagen Total Return Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS		
Countrywide Alternative Loan Trust				2,876 % fällig am 21.11.2034	2.749	2.779	0,05	Wachovia Mortgage Loan Trust LLC					
0,542 % fällig am 25.08.2037	11.187	4.170	0,08	MASTR Reperforming Loan Trust				2,400 % fällig am 20.05.2036	\$	516	529	0,01	
1,552 % fällig am 25.11.2035	9.053	9.017	0,17	7,000 % fällig am 25.05.2035	\$	674	616	0,01	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
5,500 % fällig am 25.02.2036	3.956	3.820	0,07	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0,632 % fällig am 25.07.2045		547	539	0,01	
5,500 % fällig am 25.05.2036	2.529	2.470	0,05	0,592 % fällig am 25.11.2035	435	433	0,01	0,672 % fällig am 25.10.2045	5.031	5.034	0,09		
5,750 % fällig am 25.02.2037	3.893	2.932	0,05	2,809 % fällig am 25.02.2035	1.055	1.068	0,02	0,712 % fällig am 25.01.2045	255	255	0,00		
6,000 % fällig am 25.02.2036	5.632	4.506	0,08	2,974 % fällig am 25.06.2035	440	450	0,01	0,732 % fällig am 25.01.2045	2.340	2.329	0,04		
6,000 % fällig am 25.04.2036 ^	221	141	0,00	Melife Securitization Trust				2,389 % fällig am 25.09.2036 ^	1.480	1.389	0,03		
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^	6.304	5.135	0,10	3,750 % fällig am 25.03.2057	10.279	10.741	0,20	2,997 % fällig am 25.01.2037	6.021	5.789	0,11		
6,000 % fällig am 25.08.2036	1.203	1.218	0,02	Mortgage Equity Conversion Asset Trust				3,143 % fällig am 25.02.2037 ^	1.112	1.115	0,02		
6,000 % fällig am 25.11.2036 ^	317	256	0,01	0,580 % fällig am 25.05.2042	5.488	5.265	0,10	Warwick Finance Residential Mortgages PLC					
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	4.815	3.991	0,07	MortgageIT Trust				0,000 % fällig am 21.12.2049 (b)	£	0	655	0,01	
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				0,652 % fällig am 25.10.2035	1.269	1.271	0,02	0,999 % fällig am 21.12.2049	14.830	20.550	0,38		
0,492 % fällig am 25.04.2046	1.179	1.112	0,02	Mulcair Securities DAC				1,699 % fällig am 21.12.2049	2.030	2.821	0,05		
2,125 % fällig am 19.07.2031	0	0	0,00	0,461 % fällig am 24.04.2071	13.758	16.374	0,30	2,199 % fällig am 21.12.2049	1.015	1.412	0,03		
2,195 % fällig am 20.02.2036 ^	100	89	0,00	NAAC Reperforming Loan REMIC Trust				2,699 % fällig am 21.12.2049	580	806	0,02		
2,665 % fällig am 20.02.2035	229	232	0,00	7,000 % fällig am 25.10.2034 ^	\$	613	615	0,01	3,199 % fällig am 21.12.2049	580	803	0,02	
2,711 % fällig am 20.10.2035	2.928	2.916	0,05	7,500 % fällig am 25.03.2034 ^	741	763	0,01	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
2,800 % fällig am 25.11.2034	504	510	0,01	NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				0,542 % fällig am 25.05.2035 ^	\$	744	628	0,01	
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	308	222	0,00	6,500 % fällig am 25.02.2035 ^	2.548	2.557	0,05	1,770 % fällig am 25.02.2031	1	1	0,00		
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				New Residential Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 25.11.2035 ^	645	609	0,01		
0,432 % fällig am 25.06.2035	190	183	0,00	3,500 % fällig am 25.12.2057	10.749	11.176	0,21						
4,767 % fällig am 25.01.2034 ^	19	19	0,00	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust									
6,500 % fällig am 25.11.2034 ^	43	43	0,00	1,162 % fällig am 25.02.2035	775	792	0,02						
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				Paragon Mortgages PLC									
2,736 % fällig am 25.06.2033	6	6	0,00	0,000 % fällig am 15.11.2038	€	823	960	0,02	Accredited Mortgage Loan Trust				
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				Pepper Residential Securities Trust				0,652 % fällig am 25.04.2036	3.129	3.104	0,06		
6,000 % fällig am 25.11.2035 ^	2.420	1.002	0,02	1,210 % fällig am 16.09.2059	AUD	12.459	9.419	0,17	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				Precise Mortgage Funding PLC				0,212 % fällig am 25.10.2036	266	142	0,00		
2,561 % fällig am 26.04.2038	2.021	2.028	0,04	0,000 % fällig am 12.12.2055 (b)	£	0	5.730	0,252 % fällig am 25.08.2036 ^	6.593	2.141	0,04		
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				Prime Mortgage Trust				Aegis Asset-Backed Securities Trust					
5,750 % fällig am 25.04.2036 ^	953	690	0,01	0,492 % fällig am 25.02.2034	\$	110	106	0,00	0,752 % fällig am 25.06.2035	938	936	0,02	
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	2.263	1.817	0,03	Primrose Residential				Ameriquest Mortgage Securities Trust					
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	649	391	0,01	0,200 % fällig am 24.03.2061	€	15.901	18.855	0,35	0,677 % fällig am 25.03.2036	1.860	1.853	0,03	
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				Residential Accredited Loans, Inc. Trust				Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
0,422 % fällig am 25.08.2037 ^	3.584	3.067	0,06	0,492 % fällig am 25.05.2037 ^	\$	3.324	2.486	0,05	0,737 % fällig am 25.01.2036	8.324	8.318	0,15	
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 25.04.2036	3.476	3.363	0,06	0,797 % fällig am 25.01.2036	9.408	9.403	0,17		
2,506 % fällig am 19.07.2044	15	14	0,00	Residential Asset Securitization Trust				1,022 % fällig am 25.05.2035	7.300	7.319	0,14		
Eurohome UK Mortgages PLC				6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	2.588	1.386	0,03	1,112 % fällig am 25.10.2034	3.000	3.000	0,06		
0,231 % fällig am 15.06.2044	£	3.318	4.506	6,500 % fällig am 25.09.2036 ^	735	409	0,01	1,202 % fällig am 25.03.2035	4.705	4.718	0,09		
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				Arbour CLO DAC					
2,365 % fällig am 25.10.2034	\$	165	171	0,00	4,754 % fällig am 25.02.2036 ^	181	162	0,00	0,580 % fällig am 15.03.2029	€	3.984	4.725	0,09
6,000 % fällig am 25.06.2037	1.339	806	0,02	RESIMAC Bastille Trust				Armada Euro CLO DAC					
FirstMac Mortgage Funding Trust				0,930 % fällig am 05.12.2059	2.113	2.116	0,04	0,720 % fällig am 15.07.2031	12.000	14.203	0,26		
0,881 % fällig am 08.03.2049	319	319	0,01	Resloc UK PLC				Asset-Backed Funding Certificates Trust					
GSR Mortgage Loan Trust				0,241 % fällig am 15.12.2043	£	4.898	6.578	0,12	0,792 % fällig am 25.06.2034	\$	112	110	0,00
2,118 % fällig am 25.06.2034	74	75	0,00	Ripon Mortgages PLC				Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
2,336 % fällig am 25.06.2034	47	47	0,00	0,881 % fällig am 20.08.2056	14.090	19.509	0,36	0,232 % fällig am 25.12.2036	4.396	4.306	0,08		
2,924 % fällig am 25.09.2035	2.550	2.605	0,05	Stratton Mortgage Funding PLC				Assurant CLO Ltd.					
2,927 % fällig am 25.01.2036 ^	1.900	1.944	0,04	0,948 % fällig am 20.07.2060	22.658	31.425	0,58	1,438 % fällig am 20.10.2029	19.200	19.212	0,36		
5,500 % fällig am 25.01.2037 ^	24	35	0,00	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				Atlas Senior Loan Fund Ltd.					
HarborView Mortgage Loan Trust				2,485 % fällig am 25.09.2034	\$	400	409	0,01	1,530 % fällig am 16.01.2030	15.000	15.008	0,28	
0,533 % fällig am 19.05.2035	219	211	0,00	2,543 % fällig am 25.04.2034	2.561	2.729	0,05	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust					
Hawksmoor Mortgages PLC				2,914 % fällig am 25.02.2036	3.840	3.648	0,07	0,692 % fällig am 25.02.2036	2.094	2.090	0,04		
1,099 % fällig am 25.05.2053	£	37.181	51.626	Structured Asset Mortgage Investments Trust				0,737 % fällig am 25.12.2035	2.270	2.265	0,04		
IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust				0,312 % fällig am 25.09.2047	14.749	13.436	0,25	1,067 % fällig am 25.05.2035	385	384	0,01		
1,762 % fällig am 25.01.2032	\$	1	1	0,573 % fällig am 19.04.2035	404	396	0,01	1,092 % fällig am 25.10.2037	188	188	0,00		
IndyMac Mortgage Loan Trust				0,593 % fällig am 19.07.2035	350	340	0,01	1,292 % fällig am 25.01.2045	459	461	0,01		
0,332 % fällig am 25.06.2037	1.419	1.419	0,03	0,652 % fällig am 25.02.2036 ^	856	824	0,02	Blackrock European CLO DAC					
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust				0,673 % fällig am 19.05.2034	285	278	0,01	0,620 % fällig am 15.10.2031	€	13.000	15.350	0,28	
3,358 % fällig am 15.11.2048	18.040	19.013	0,35	0,753 % fällig am 19.09.2032	36	36	0,00	BlueMountain CLO Ltd.					
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust				0,942 % fällig am 25.05.2047	8.944	7.937	0,15	1,120 % fällig am 18.07.2027	\$	1.621	1.622	0,03	
2,994 % fällig am 15.12.2049	12.043	12.755	0,24	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				1,364 % fällig am 22.10.2030	1.078	1.079	0,02		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				7,500 % fällig am 25.10.2036 ^	722	512	0,01	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
1,073 % fällig am 15.06.2032	6.545	6.559	0,12	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				0,650 % fällig am 15.07.2030	€	2.750	3.270	0,06	
2,560 % fällig am 15.06.2035	10.951	10.992	0,20	2,337 % fällig am 25.06.2033	4	4	0,00	Bosphorus CLO DAC					
JP Morgan Mortgage Trust				Thornburg Mortgage Securities Trust				0,820 % fällig am 15.12.2030	300	356	0,01		
2,801 % fällig am 25.07.2035	172	174	0,00	1,494 % fällig am 25.06.2047 ^	2.886	2.472	0,05	CaIm CLO BV					
5,750 % fällig am 25.01.2036 ^	392	268	0,01	2,342 % fällig am 25.09.2037	4.256	4.253	0,08	0,600 % fällig am 30.04.2031	13.000	15.379	0,29		
Landmark Mortgage Securities PLC				Towd Point Mortgage Funding PLC				0,650 % fällig am 20.10.2028	2.207	2.623	0,05		
0,364 % fällig am 17.04.2044	£	9.087	12.103	0,22	0,949 % fällig am 20.07.2045	£	27.434	38.027	0,71	Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC			
Lehman XS Trust				1,111 % fällig am 20.10.2051	18.742	26.029	0,48	0,680 % fällig am 16.09.2025	£	3.622	5.015	0,09	
0,272 % fällig am 25.12.2036	\$	6.237	6.425	Trinity Square PLC				Carrington Mortgage Loan Trust					
0,292 % fällig am 25.03.2047	13.741	13.773	0,26	0,899 % fällig am 15.07.2059	16.500	22.834	0,42	1,082 % fällig am 25.06.2035	\$	1.200	1.197	0,02	
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				Twin Bridges PLC				CBAM CLO Ltd.					
2,607 % fällig am 25.01.2036	19	19	0,00	1,199 % fällig am 12.06.2053	11.518	16.028	0,30	1,420 % fällig am 17.10.2029	9.400	9.407	0,17		

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
CIT Mortgage Loan Trust 1,442 % fällig am 25.10.2037	\$ 5.507	\$ 5.567	0,10	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,192 % fällig am 25.09.2036	\$ 1.041	\$ 495	0,01	6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN 68.300	\$ 19.968	0,37
Citigroup Mortgage Loan Trust 0,412 % fällig am 25.09.2036	5.745	4.875	0,09	0,272 % fällig am 25.05.2037	725	666	0,01	6,950 % fällig am 12.08.2031	3.000	880	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 0,342 % fällig am 25.03.2037	2.430	2.250	0,04	0,322 % fällig am 25.11.2036	1.123	832	0,02	8,200 % fällig am 12.08.2026	12.900	4.187	0,08
0,962 % fällig am 25.07.2035	680	681	0,01	0,392 % fällig am 25.07.2036	8.595	4.430	0,08	Province of Ontario 1,850 % fällig am 01.02.2027	CAD 7.000	5.791	0,11
Commonbond Student Loan Trust 0,942 % fällig am 25.05.2041	958	958	0,02	0,797 % fällig am 25.01.2035	1.476	1.432	0,03	3,150 % fällig am 02.06.2022	14.600	12.100	0,22
Contego CLO BV 0,369 % fällig am 15.11.2026	€ 983	1.165	0,02	0,797 % fällig am 25.07.2035	364	370	0,01	Province of Quebec 3,500 % fällig am 01.12.2022	10.100	8.512	0,16
Cork Street CLO DAC 0,760 % fällig am 27.11.2028	6.506	7.721	0,14	1,067 % fällig am 25.04.2035	1.242	1.266	0,02	Mountain View CLO Ltd. 1,008 % fällig am 13.10.2027	7.668	7.670	0,14
Countrywide Asset-Backed Certificates 0,232 % fällig am 25.06.2047 ^	\$ 2.142	2.041	0,04	New Century Home Equity Loan Trust 0,272 % fällig am 25.05.2036	97	95	0,00	0,812 % fällig am 25.10.2035	7.268	7.218	0,13
0,312 % fällig am 25.09.2037 ^	1.860	1.869	0,03	0,812 % fällig am 25.10.2035	7.268	7.218	0,13	OneMain Direct Auto Receivables Trust 3,430 % fällig am 16.12.2024	3.898	3.915	0,07
0,322 % fällig am 25.07.2037 ^	1.000	863	0,02	0,812 % fällig am 25.10.2035	7.268	7.218	0,13	Park Place Securities, Inc. 0,797 % fällig am 25.09.2035	3.917	3.930	0,07
4,558 % fällig am 25.07.2036	2.452	2.473	0,05	0,812 % fällig am 25.10.2035	7.268	7.218	0,13	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 0,797 % fällig am 25.09.2035	536	541	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. 0,947 % fällig am 25.08.2034	468	467	0,01	0,797 % fällig am 25.09.2035	536	541	0,01	0,812 % fällig am 25.08.2035	2.022	2.030	0,04
0,992 % fällig am 25.10.2034	1.045	1.038	0,02	0,812 % fällig am 25.08.2035	2.022	2.030	0,04	Purple Finance CLO DAC 0,800 % fällig am 25.01.2031	€ 1.150	1.366	0,03
1,892 % fällig am 25.08.2034	3.771	3.789	0,07	0,812 % fällig am 25.08.2035	2.022	2.030	0,04	Renaissance Home Equity Loan Trust 1,292 % fällig am 25.11.2034	\$ 167	161	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 0,402 % fällig am 25.05.2046	2.064	1.930	0,04	0,812 % fällig am 25.08.2035	2.022	2.030	0,04	Residential Asset Securities Corp. Trust 0,767 % fällig am 25.02.2035	115	115	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 0,152 % fällig am 25.11.2036	138	81	0,00	0,772 % fällig am 25.11.2035	2.117	2.114	0,04	0,772 % fällig am 25.11.2035	2.117	2.114	0,04
CVC Cordatus Loan Fund DAC 0,630 % fällig am 15.09.2031	€ 13.000	15.361	0,29	0,772 % fällig am 25.11.2035	2.117	2.114	0,04	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 0,212 % fällig am 25.11.2036	6.359	2.472	0,05
FBR Securitization Trust 0,797 % fällig am 25.11.2035	\$ 5.933	5.840	0,11	0,372 % fällig am 25.05.2036	522	356	0,01	0,372 % fällig am 25.05.2036	522	356	0,01
First Franklin Mortgage Loan Trust 0,202 % fällig am 25.12.2037	6.147	5.949	0,11	1,067 % fällig am 25.03.2035	37	37	0,00	1,067 % fällig am 25.03.2035	37	37	0,00
0,767 % fällig am 25.03.2034	580	574	0,01	SLM Student Loan Trust 0,266 % fällig am 26.01.2026	128	128	0,00	SLM Student Loan Trust 0,266 % fällig am 26.01.2026	128	128	0,00
1,022 % fällig am 25.07.2034	620	623	0,01	0,589 % fällig am 15.12.2027	2.379	2.380	0,04	0,589 % fällig am 15.12.2027	2.379	2.380	0,04
1,367 % fällig am 25.07.2034	1.087	1.091	0,02	Soundview Home Loan Trust 0,412 % fällig am 25.11.2036	1.333	1.331	0,03	0,412 % fällig am 25.11.2036	1.333	1.331	0,03
GE-WMC Mortgage Securities Trust 0,172 % fällig am 25.08.2036	38	22	0,00	0,917 % fällig am 25.05.2035	748	744	0,01	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 0,917 % fällig am 25.05.2035	748	744	0,01
Griffith Park CLO DAC 0,720 % fällig am 21.11.2031	€ 12.000	14.178	0,26	Starwood Commercial Mortgage Trust 1,204 % fällig am 15.07.2038	11.900	11.905	0,22	1,204 % fällig am 15.07.2038	11.900	11.905	0,22
Grosvenor Place CLO BV 0,720 % fällig am 30.10.2029	3.758	4.461	0,08	Structured Asset Investment Loan Trust 0,472 % fällig am 25.03.2036	1.640	1.583	0,03	0,472 % fällig am 25.03.2036	1.640	1.583	0,03
GSAMP Trust 0,232 % fällig am 25.12.2036	\$ 13.810	8.923	0,17	0,857 % fällig am 25.08.2035	839	831	0,02	0,857 % fällig am 25.08.2035	839	831	0,02
0,332 % fällig am 25.01.2037	492	366	0,01	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 0,247 % fällig am 25.09.2036	8.720	6.838	0,13	0,247 % fällig am 25.09.2036	8.720	6.838	0,13
Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029	€ 1.303	1.548	0,03	Tikehau CLO BV 0,600 % fällig am 04.08.2028	€ 288	342	0,01	0,600 % fällig am 04.08.2028	€ 288	342	0,01
Home Equity Asset Trust 0,692 % fällig am 25.07.2036	\$ 7.928	7.531	0,14	Venture CLO Ltd. 1,288 % fällig am 20.01.2029	\$ 19.200	19.215	0,36	1,288 % fällig am 20.01.2029	\$ 19.200	19.215	0,36
1,127 % fällig am 25.08.2035	200	200	0,00	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust 0,452 % fällig am 25.04.2037	5.477	2.793	0,05	0,452 % fällig am 25.04.2037	5.477	2.793	0,05
HSI Asset Securitization Corp. Trust 0,452 % fällig am 25.12.2035	7.563	7.515	0,14	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 1,037 % fällig am 25.03.2035	536	537	0,01	1,037 % fällig am 25.03.2035	536	537	0,01
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,382 % fällig am 25.05.2036	4.000	3.865	0,07	1,092 % fällig am 25.10.2034	1.267	1.258	0,02	1,092 % fällig am 25.10.2034	1.267	1.258	0,02
Jubilee CLO BV 0,610 % fällig am 15.04.2030	€ 20.000	23.712	0,44								
KKR Financial CLO Ltd. 1,460 % fällig am 18.07.2030	\$ 2.200	2.202	0,04								
KVK CLO Ltd. 1,086 % fällig am 14.01.2028	1.808	1.810	0,03	STAATSEMISSIONEN							
LCM LP 1,228 % fällig am 20.10.2027	4.419	4.420	0,08	Action Logement Services 0,500 % fällig am 30.10.2034	€ 7.600	8.919	0,16	0,500 % fällig am 30.10.2034	€ 7.600	8.919	0,16
LoanCore Issuer Ltd. 1,203 % fällig am 15.05.2028	5.123	5.126	0,10	Development Bank of Japan, Inc. 0,010 % fällig am 15.10.2024	6.600	7.902	0,15	0,010 % fällig am 15.10.2024	6.600	7.902	0,15
LP Credit Card ABS Master Trust 1,661 % fällig am 20.08.2024	11.070	11.086	0,21	0,875 % fällig am 10.10.2025	4.300	5.322	0,10	0,875 % fällig am 10.10.2025	4.300	5.322	0,10
Madison Park Euro Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2032	€ 12.300	14.607	0,27	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,125 % fällig am 16.04.2030	\$ 10.000	10.889	0,20	3,125 % fällig am 16.04.2030	\$ 10.000	10.889	0,20
Man GLG Euro CLO 0,900 % fällig am 15.10.2032	3.800	4.510	0,08	Hungary Government International Bond 1,750 % fällig am 05.06.2035	€ 10.000	12.599	0,23	1,750 % fällig am 05.06.2035	€ 10.000	12.599	0,23
Man GLG Euro CLO DAC 0,690 % fällig am 15.12.2031	11.100	13.189	0,24	Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	\$ 18.400	20.999	0,39	3,800 % fällig am 13.05.2060	\$ 18.400	20.999	0,39
Massachusetts Educational Financing Authority 1,126 % fällig am 25.04.2038	\$ 8	8	0,00	Japan Finance Organization for Municipalities 0,010 % fällig am 02.02.2028	€ 9.900	11.748	0,22	0,010 % fällig am 02.02.2028	€ 9.900	11.748	0,22
Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust 1,342 % fällig am 25.10.2037	12.640	12.466	0,23	Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 0,875 % fällig am 21.03.2046	10.000	11.737	0,22	0,875 % fällig am 21.03.2046	10.000	11.737	0,22
				Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 7.000	2.001	0,04	5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 7.000	2.001	0,04
				6,150 % fällig am 12.08.2032	77.900	20.789	0,38	6,150 % fällig am 12.08.2032	77.900	20.789	0,38

AKTIEN

VORZUGSWERTPAPIERE

Firstar Realty LLC 8,875 % fällig am 31.12.2021	4.000	4.140	0,08
--	-------	-------	------

PARI (000S)

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE

KURZFRISTIGE SCHULDITITEL

Pacific Gas and Electric Co. 1,531 % fällig am 15.11.2021	\$ 14.500	14.530	0,27
--	-----------	--------	------

ISRAEL TREASURY BILLS

(0,020) % fällig am

02.02.2022 (b)(c)	ILS 86.100	26.422	0,49
-------------------	------------	--------	------

0,010 % fällig am			
-------------------	--	--	--

02.03.2022 (b)(c)	50.000	15.343	0,28
-------------------	--------	--------	------

0,023 % fällig am			
-------------------	--	--	--

28.02.2022 (b)(c)	21.187	6.500	0,12
-------------------	--------	-------	------

		48.265	0,89
--	--	--------	------

Summe kurzfristige Instrumente		62.795	1,16
--------------------------------	--	--------	------

Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 5.904.364	109,44	
--------------------------------	--------------	--------	--

AKTIEN

INVESTMENTFONDS

ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN

PIMCO Funds: Global Investors Series plc – US Short-Term Fund (e)	9.154.538	93.376	1,73
---	-----------	--------	------

PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	80.856	806	0,02
---	--------	-----	------

		94.182	1,75
--	--	--------	------

BÖRSEGEHANDELTE FONDS

PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	3.260.360	331.084	6,14
---	-----------	---------	------

Summe Investmentfonds	\$ 425.266	7,89	
-----------------------	------------	------	--

Aufstellung der Wertpapieranlagen Total Return Bond Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend¹, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	2.421	\$ (3.205)	(0,06)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	244	(1.036)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2021	705	(198)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	8.658	6.809	0,13
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	166	(810)	(0,02)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2021	557	(962)	(0,02)
				\$ 598	0,01
				\$ 598	0,01

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend¹)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 8.300	\$ 529	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	4.700	90	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	5.500	178	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 14.500	1.902	0,04
Ryder System, Inc.	1,000	20.12.2023	\$ 1.500	46	0,00
				\$ 2.745	0,05

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 9.600	\$ (291)	(0,01)
CDX.HY-36 5-Year Index	(5,000)	20.06.2026	5.400	(44)	0,00
				\$ (335)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
iTraxx Crossover 35 5-Year Index	5,000 %	20.06.2026	€ 51.300	\$ 693	0,02
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	12.500	94	0,00
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	14.000	21	0,00
				\$ 808	0,02

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2051	£ 88.400	\$ (879)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,345	03.01.2022	BRL 24.700	(42)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	2.232.900	(2.309)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,700	03.01.2022	1.028.000	(1.058)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	CAD 15.700	17	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,493	23.06.2031	\$ 10.000	(16)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,800	22.08.2023	134.700	11.469	0,21
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,062	18.09.2026	¥ 3.550.000	(99)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,063	19.09.2026	7.000	0	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,064	19.09.2026	877.000	(26)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,350	17.03.2051	852.000	(130)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,380	18.06.2028	5.170.000	914	0,02
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	2.460.000	(556)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,538	15.03.2051	1.028.000	(71)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,556	15.03.2051	1.205.000	(164)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,557	17.03.2051	137.000	(19)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,570	19.03.2051	821.000	(144)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,572	07.04.2051	364.000	(64)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,705	31.10.2038	1.180.000	(856)	(0,02)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,750	20.03.2038	436.000	(368)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,750	20.12.2038	1.947.000	(1.458)	(0,03)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR		0,785 %	12.11.2038	¥ 600.000	\$ (473)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR		0,800	22.10.2038	400.000	(325)	(0,01)
						\$ 3.343	0,06
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 6.561	0,12

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	13.500	\$ 1.521	\$ 2.812	0,05
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,009	10.03.2022	6.600	522	430	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,009	15.03.2022	15.600	1.648	1.026	0,02
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,009	11.03.2022	6.600	0	431	0,01
							\$ 3.691	\$ 4.699	0,09

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,013 %	11.08.2021	12.000	\$ (46)	\$ (33)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	11.08.2021	12.000	(46)	(31)	0,00
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	40.500	(1.491)	(2.754)	(0,05)
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,008	10.03.2022	17.800	(508)	(450)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,008	15.03.2022	42.100	(1.600)	(1.078)	(0,02)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	11.08.2021	5.000	(51)	(66)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	11.08.2021	5.000	(51)	(21)	0,00
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	0,008	11.03.2022	17.800	0	(452)	(0,01)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,014	15.07.2021	10.000	(23)	(19)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,017	15.07.2021	10.000	(23)	(7)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	19.07.2021	34.000	(145)	(261)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	19.07.2021	34.000	(145)	(4)	0,00
							\$ (4.129)	\$ (5.176)	(0,09)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
FAR	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	11.000	\$ (48)	\$ (10)	0,00
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	14.000	(47)	(24)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	14.000	(48)	(16)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	14.000	(29)	(11)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,141	05.08.2021	3.400	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	5.000	(15)	(12)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,547	07.07.2021	11.000	(43)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,281	07.09.2021	5.100	(25)	(21)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,281	07.09.2021	8.900	(25)	(37)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,297	07.09.2021	5.000	(17)	(21)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,328	07.09.2021	27.000	(87)	(108)	(0,01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,164	07.07.2021	7.000	(27)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,211	07.07.2021	6.200	(24)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,078	05.08.2021	17.000	(74)	(20)	0,00
					\$ (515)	\$ (286)	(0,01)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Total Return Bond Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Russia Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 10.900	\$ 70	\$ 92	\$ 162	0,00
JPM	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(5)	5	0	0,00
					\$ 65	\$ 97	\$ 162	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 8.025	AUD 10.658	\$ 0	\$ (24)	\$ (24)	0,00
	08.2021	AUD 10.658	\$ 8.026	24	0	24	0,00
	08.2021	CZK 2.336	112	4	0	4	0,00
	08.2021	NOK 2.075	247	5	0	5	0,00
	09.2021	\$ 15	PLN 57	0	0	0	0,00
BPS	11.2021	21.298	CLP 15.374.808	0	(267)	(267)	0,00
	07.2021	AUD 42.175	\$ 32.776	1.113	0	1.113	0,02
	07.2021	€ 736.019	900.410	27.564	0	27.564	0,51
	07.2021	£ 1.979	2.750	16	0	16	0,00
	07.2021	\$ 3.219	£ 2.298	0	(44)	(44)	0,00
BRC	08.2021	PEN 2.227	\$ 603	20	0	20	0,00
	08.2021	\$ 12.475	MXN 266.064	833	0	833	0,02
	09.2021	29.409	KRW 32.772.783	0	(413)	(413)	(0,01)
	07.2021	£ 608	\$ 857	17	0	17	0,00
	09.2021	\$ 10	PLN 38	0	0	0	0,00
CBK	07.2021	PEN 22.321	\$ 5.746	0	(88)	(88)	0,00
	07.2021	\$ 27.752	CAD 34.129	0	(190)	(190)	0,00
	08.2021	CAD 34.129	\$ 27.751	190	0	190	0,00
	08.2021	PEN 22.195	6.045	236	0	236	0,00
	09.2021	6.670	1.798	52	0	52	0,00
GLM	12.2021	53.438	14.343	369	0	369	0,01
	02.2022	ILS 107.300	32.756	0	(285)	(285)	(0,01)
	03.2022	49.995	15.260	0	(142)	(142)	0,00
	07.2021	BRL 189.436	37.736	0	(16)	(16)	0,00
	07.2021	£ 198.760	280.992	6.415	0	6.415	0,12
HUS	07.2021	\$ 10	RUB 800	1	0	1	0,00
	08.2021	37.616	BRL 189.436	13	0	13	0,00
	08.2021	11	RUB 800	0	0	0	0,00
	09.2021	HKD 18.256	\$ 2.353	2	0	2	0,00
	09.2021	TWD 4.330	158	2	0	2	0,00
JPM	09.2021	\$ 16	PLN 60	0	0	0	0,00
	09.2021	11	RUB 800	0	0	0	0,00
	07.2021	£ 582	\$ 826	22	0	22	0,00
	07.2021	\$ 5.751	€ 4.745	0	(124)	(124)	0,00
	07.2021	548.248	£ 396.086	0	(1.075)	(1.075)	(0,02)
MYI	08.2021	£ 383.219	\$ 530.447	1.001	0	1.001	0,02
	08.2021	¥ 152.977	1.408	29	0	29	0,00
	09.2021	\$ 18	PLN 69	0	0	0	0,00
	10.2021	PEN 30.660	\$ 8.144	119	0	119	0,00
	07.2021	51.709	13.752	249	0	249	0,00
RYL	07.2021	\$ 2.734	€ 2.256	0	(59)	(59)	0,00
	07.2021	153	ILS 497	0	0	0	0,00
	08.2021	CZK 3.774	\$ 181	6	0	6	0,00
	07.2021	£ 432	613	16	0	16	0,00
	07.2021	SGD 121	90	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	\$ 5.967	AUD 7.889	0	(45)	(45)	0,00
	07.2021	35.482	BRL 189.436	2.271	0	2.271	0,04
	07.2021	3.512	€ 2.947	0	(17)	(17)	0,00
	07.2021	1.208	£ 866	0	(12)	(12)	0,00
	07.2021	50	SGD 67	0	0	0	0,00
SSB	08.2021	AUD 7.889	\$ 5.968	44	0	44	0,00
	07.2021	£ 1.342	1.892	38	0	38	0,00
	07.2021	PEN 11.084	2.946	52	0	52	0,00
	07.2021	\$ 1.237	£ 875	0	(28)	(28)	0,00
	07.2021	15.775	PEN 62.793	623	0	623	0,01
TOR	08.2021	CZK 1.171	\$ 56	2	0	2	0,00
	09.2021	PEN 62.793	15.789	0	(651)	(651)	(0,01)
	12.2021	INR 8.768	117	1	0	1	0,00
	12.2021	SGD 321	242	4	0	4	0,00
	07.2021	\$ 1.095	£ 787	0	(8)	(8)	0,00
TOR	07.2021	CAD 34.129	\$ 28.249	687	0	687	0,01
	07.2021	€ 222.917	272.706	8.349	0	8.349	0,16
	07.2021	\$ 70	HKD 543	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
UAG	07.2021	AUD 14.614	\$ 11.328	\$ 356	\$ 0	\$ 356	0,01
	07.2021	£ 198.760	261.616	7.040	0	7.040	0,13
	07.2021	\$ 29.008	AUD 38.242	0	(298)	(298)	(0,01)
	08.2021	AUD 38.242	\$ 29.012	298	0	298	0,01
				\$ 58.083	\$ (3.786)	\$ 54.297	1,01

ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen fur die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2021	CAD 8	\$ 7	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07.2021	\$ 8.466	CAD 10.228	0	(206)	(206)	(0,01)
CBK	07.2021	CAD 9.918	\$ 8.065	55	0	55	0,00
	08.2021	\$ 8.065	CAD 9.918	0	(55)	(55)	0,00
JPM	07.2021	5.328	6.450	0	(119)	(119)	0,00
MYI	07.2021	CAD 133	\$ 107	0	0	0	0,00
RBC	07.2021	11	9	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	\$ 2.883	CAD 3.486	0	(68)	(68)	0,00
TOR	07.2021	8.361	10.101	0	(204)	(204)	0,00
				\$ 55	\$ (652)	\$ (597)	(0,01)

Zum 30. Juni 2021 standen fur die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2021	CHF 674	\$ 748	\$ 19	\$ 0	\$ 19	0,00
	07.2021	\$ 9.763	CHF 8.758	0	(288)	(288)	(0,01)
BRC	07.2021	62	55	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07.2021	CHF 8.279	\$ 8.993	36	0	36	0,00
	07.2021	\$ 9.795	CHF 8.783	0	(294)	(294)	(0,01)
	08.2021	9.001	8.279	0	(36)	(36)	0,00
GLM	07.2021	CHF 115	\$ 125	1	0	1	0,00
MYI	07.2021	\$ 9.575	CHF 8.627	0	(242)	(242)	0,00
SCX	07.2021	CHF 503	\$ 559	16	0	16	0,00
SSB	07.2021	323	354	4	0	4	0,00
	07.2021	\$ 1	CHF 1	0	0	0	0,00
UAG	07.2021	CHF 15	\$ 16	0	0	0	0,00
				\$ 76	\$ (862)	\$ (786)	(0,02)

Zum 30. Juni 2021 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschuttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	07.2021	€ 5.865	\$ 7.066	\$ 111	\$ 0	\$ 111	0,00
BPS	07.2021	14.930	17.884	179	0	179	0,00
	07.2021	\$ 532.255	€ 435.073	0	(16.301)	(16.301)	(0,30)
BRC	07.2021	€ 322	\$ 392	10	0	10	0,00
GLM	07.2021	1.520	1.843	40	0	40	0,00
HUS	07.2021	7.298	8.771	116	0	116	0,00
	07.2021	\$ 5.625	€ 4.617	0	(149)	(149)	0,00
MYI	07.2021	€ 1.472	\$ 1.752	7	0	7	0,00
SCX	07.2021	2.015	2.451	62	0	62	0,00
	07.2021	\$ 622.925	€ 509.189	0	(19.078)	(19.078)	(0,35)
TOR	07.2021	622.925	509.189	0	(19.078)	(19.078)	(0,35)
UAG	07.2021	€ 6.888	\$ 8.379	210	0	210	0,00
				\$ 735	\$ (54.606)	\$ (53.871)	(1,00)

Zum 30. Juni 2021 standen fur die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BPS	07.2021	£ 44	\$ 62	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2021	\$ 35	£ 25	0	(1)	(1)	0,00
BRC	07.2021	£ 27	\$ 37	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 28	£ 20	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2021	20.502	14.502	0	(468)	(468)	(0,01)
HUS	07.2021	£ 15.441	\$ 21.371	41	0	41	0,00
	07.2021	\$ 107	£ 76	0	(2)	(2)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Total Return Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MYI	08.2021	\$ 21.373	£ 15.441	\$ 0	\$ (40)	\$ (40)	0,00
	07.2021	85	61	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	20.513	14.430	0	(579)	(579)	(0,01)
SSB	07.2021	£ 15.441	\$ 21.338	7	0	7	0,00
	07.2021	\$ 128	£ 91	0	(3)	(3)	0,00
	08.2021	21.340	15.441	0	(7)	(7)	0,00
UAG	07.2021	20.547	14.502	0	(514)	(514)	(0,01)
				\$ 49	\$ (1.615)	\$ (1.566)	(0,03)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional ILS (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 55	ILS 179	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	07.2021	56	183	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2021	0	2	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	ILS 181	\$ 56	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 56	ILS 183	0	0	0	0,00
	08.2021	56	181	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	SGD 20.240	\$ 15.075	\$ 17	\$ 0	\$ 17	0,00
	08.2021	\$ 15.074	SGD 20.240	0	(17)	(17)	0,00
BPS	07.2021	15.394	20.365	0	(244)	(244)	(0,01)
GLM	07.2021	SGD 45	\$ 34	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 58	SGD 78	0	0	0	0,00
	08.2021	SGD 64	\$ 48	0	0	0	0,00
HUS	07.2021	\$ 15.364	SGD 20.327	0	(242)	(242)	0,00
MYI	07.2021	SGD 20.244	\$ 15.061	1	0	1	0,00
	08.2021	\$ 15.059	SGD 20.244	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2021	15.291	20.266	0	(214)	(214)	0,00
SSB	07.2021	SGD 944	\$ 709	7	0	7	0,00
	07.2021	\$ 185	SGD 247	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 25	\$ (720)	\$ (695)	(0,01)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (3.820)	(0,07)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 65.800	\$ (66.443)	(1,23)
4,000 % fällig am 01.08.2051	98.000	(104.446)	(1,94)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (170.889)	(3,17)
Summe Anlagen		\$ 6.162.080	114,22
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (767.111)	(14,22)
Nettovermögen		\$ 5.394.969	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	2,572 %	03.06.2031	26.05.2020	\$ 4.000	\$ 4.116	0,08
General Motors Co.	6,125	03.06.2031	07.05.2020 - 28.05.2020	12.007	14.096	0,26
				\$ 16.007	\$ 18.212	0,34

(h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 166.969 als Sicherheiten verpfändet.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 7.816 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 998 und Barmittel in Höhe von USD 2.498 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 69.685 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 27.452 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert¹

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.904.364	\$ 0	\$ 5.904.364
Investmentfonds	94.182	331.084	0	425.266
Finanzderivate ⁽³⁾	(5.203)	8.542	0	3.339
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(170.889)	0	(170.889)
Summen	\$ 88.979	\$ 6.073.101	\$ 0	\$ 6.162.080

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.894.162	\$ 31.979	\$ 6.926.141
Investmentfonds	294.026	331.536	0	625.562
Pensionsgeschäfte	0	136.163	0	136.163
Finanzderivate ⁽³⁾	1.212	20.637	0	21.849
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(34.311)	0	(34.311)
Summen	\$ 295.238	\$ 7.348.187	\$ 31.979	\$ 7.675.404

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	0,040 %	17.06.2021	19.07.2021	\$ (15.269)	\$ (15.269)	(0,28)
BSN	0,040	10.06.2021	12.07.2021	(41.375)	(41.376)	(0,77)
GRE	0,040	02.06.2021	14.07.2021	(29.773)	(29.774)	(0,55)
	0,050	16.06.2021	28.07.2021	(16.182)	(16.182)	(0,30)
	0,070	21.06.2021	06.07.2021	(14.711)	(14.711)	(0,27)
IND	0,040	10.06.2021	09.07.2021	(39.306)	(39.307)	(0,73)
	0,070	25.06.2021	09.07.2021	(6.435)	(6.435)	(0,12)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (163.054)	(3,02)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	% des Nettovermögens
CSN	0,050 %	30.06.2021	01.07.2021	\$ (7.840)	\$ (7.840)	(0,15)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (7.840)	(0,15)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (480)	\$ 660	\$ 180
BPS	12.575	(11.050)	1.525
BRC	24	0	24
CBK	(153)	(424)	(577)
DUB	0	(160)	(160)
FAR	(10)	20	10
GLM	5.831	(5.140)	691
GST	162	0	162
HUS	(304)	0	(304)
JPM	(12)	(160)	(172)
MYC	(291)	280	(11)
MYI	2.022	(2.770)	(748)
RYL	38	0	38
SAL	(208)	82	(126)
SCX	(19.858)	17.470	(2.388)
SSB	(2)	0	(2)
TOR	(10.246)	8.940	(1.306)
UAG	7.092	(6.390)	702

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	64,59	53,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	42,43	51,34
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,42	2,61
Investmentfonds	7,89	9,74
Pensionsgeschäfte	k. A.	2,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,12	0,12
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,07)	0,20
Leerverkaufte Wertpapiere	(3,17)	(0,53)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(3,02)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,15)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	48,22	44,27
Kommunalanleihen und Wechsel	0,57	0,64
US-Regierungsbehörden	20,60	29,02
US-Schatzobligationen	15,48	13,38
Non-Agency-MBS	11,24	9,89
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,52	6,83
Staatsemissionen	3,57	2,99
Wandelbare Vorzugswertpapiere	k. A.	0,00
Vorzugswertpapiere	0,08	0,07
Kurzfristige Instrumente	1,16	0,72
Investmentfonds	7,89	9,74
Pensionsgeschäfte	k. A.	2,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,05	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,01)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,02	0,05
Zinsswaps	0,06	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,09	0,02
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,09)	(0,02)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	1,01	(0,50)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(1,07)	0,70
Leerverkaufte Wertpapiere	(3,17)	(0,53)
Sonstige Aktiva und Passiva	(14,22)	(19,48)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								ISRAEL TREASURY BILLS			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								U.S. TREASURY BILLS			
BANKEN UND FINANZEN								ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Athene Global Funding 1,424 % fällig am 01.07.2022	\$ 300	\$ 303	0,40	BX Commercial Mortgage Trust 0,851 % fällig am 15.11.2035	88	88	0,12	(0,041) % fällig am 02.03.2022 (a)(b)	ILS 250	\$ 77	0,10
Bank of America Corp. 0,984 % fällig am 05.03.2024	100	101	0,14	Dilosk RMBS DAC 0,197 % fällig am 20.02.2060	€ 396	472	0,62	(0,030) % fällig am 30.11.2021 (a)(b)	80	24	0,03
Brixmor Operating Partnership LP 1,226 % fällig am 01.02.2022	100	100	0,13	Sage AR Funding No. 1 PLC 1,299 % fällig am 17.11.2030	£ 200	276	0,37	(0,028) % fällig am 02.02.2022 (a)(b)	280	86	0,11
Citigroup, Inc. 1,256 % fällig am 17.05.2024	300	305	0,41	Towd Point Mortgage Funding PLC 1,111 % fällig am 20.10.2051	£ 323	449	0,59	(0,020) % fällig am 02.02.2022 (a)(b)	130	40	0,05
Goldman Sachs Group, Inc. 0,441 % fällig am 08.03.2023	1.100	1.101	1,46	Trinity Square PLC 0,899 % fällig am 15.07.2059	200	277	0,37	(0,000) % fällig am 06.04.2022 (a)(b)	70	21	0,03
0,966 % fällig am 31.10.2022	220	221	0,29			1.562	2,07	0,006 % fällig am 08.06.2022 (a)(b)	390	120	0,16
JPMorgan Chase & Co. 1,406 % fällig am 24.10.2023	100	101	0,13					0,010 % fällig am 02.03.2022 (a)(b)	100	31	0,04
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,966 % fällig am 25.07.2022	300	302	0,40					0,011 % fällig am 06.04.2022 (a)(b)	110	34	0,05
Nissan Motor Acceptance Corp. 0,838 % fällig am 13.07.2022	300	301	0,40						100	31	0,04
Standard Chartered PLC 1,260 % fällig am 14.10.2023	200	202	0,27							464	0,61
		3.037	4,03								
INDUSTRIEWERTE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE							
7-Eleven, Inc. 0,612 % fällig am 10.08.2022	200	200	0,27	EFS Volunteer LLC 1,026 % fällig am 25.10.2035	\$ 299	300	0,40	U.S. Treasury Bills 0,005 % fällig am 13.07.2021 (a)(b)	\$ 4.800	4.800	6,36
Boeing Co. 1,167 % fällig am 04.02.2023	600	603	0,80	Euro-Galaxy CLO DAC 0,620 % fällig am 24.04.2034	€ 250	296	0,39	0,015 % fällig am 20.07.2021 (a)(b)	11.400	11.400	15,11
Central Nippon Expressway Co. Ltd. 1,034 % fällig am 14.09.2021	500	501	0,66	Gallatin CLO Ltd. 1,484 % fällig am 15.07.2027	\$ 412	412	0,55	0,020 % fällig am 10.08.2021 (a)(b)	6.100	6.100	8,08
GATX Corp. 0,896 % fällig am 05.11.2021	100	100	0,13	Harvest CLO DAC 0,650 % fällig am 26.06.2030	€ 250	296	0,39	0,031 % fällig am 04.11.2021 (a)(b)	4.500	4.499	5,96
Imperial Brands Finance PLC 3,750 % fällig am 21.07.2022	200	205	0,27	OAK Hill European Credit Partners DAC 0,740 % fällig am 20.10.2031	300	355	0,47	0,038 % fällig am 19.08.2021 (a)(b)(d)	700	700	0,93
		1.609	2,13	SMB Private Education Loan Trust 0,392 % fällig am 15.09.2054	\$ 23	23	0,03	0,051 % fällig am 19.08.2021 (a)(b)(d)	2.000	2.000	2,65
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				STAATSEMISSIONEN							
AT&T, Inc. 1,044 % fällig am 15.02.2023	400	405	0,54	Export-Import Bank of India 1,149 % fällig am 21.08.2022	300	301	0,40	0,056 % fällig am 16.09.2021 (a)(b)	6.000	5.999	7,95
Atmos Energy Corp. 0,565 % fällig am 09.03.2023	300	300	0,40	Israel Government International Bond 0,000 % fällig am 30.11.2021	ILS 940	289	0,38			35.498	47,04
Hydro One, Inc. 0,710 % fällig am 16.01.2023	CAD 300	242	0,32	0,750 % fällig am 31.07.2022	360	111	0,15	Summe kurzfristige Instrumente		48.062	63,69
Pacific Gas & Electric Co. 1,598 % fällig am 16.06.2022	\$ 200	200	0,26	5,500 % fällig am 31.01.2022	240	76	0,10				
		1.147	1,52			777	1,03				
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		5.793	7,68								
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				AKTIEN			
Ginnie Mae 0,910 % fällig am 20.05.2066	1.365	1.389	1,84	Federal Home Loan Bank 0,008 % fällig am 27.08.2021 (a)(b)	\$ 1.500	1.500	1,99	INVESTMENTFONDS			
0,940 % fällig am 20.08.2066	693	707	0,94	0,015 % fällig am 04.08.2021 (a)(b)	10.300	10.300	13,65	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
				Pacific Gas and Electric Co. 1,531 % fällig am 15.11.2021	300	300	0,40	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)	532.564	5.304	7,03
						12.100	16,04	PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c)	20.400	2.072	2,75
								Summe Investmentfonds	\$ 7.376	9,78	

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Canada Bankers' Acceptance September Futures	Long	09.2023	6	\$ (2)	0,00
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09.2023	25	2	0,00
Amsterdam Index July Futures	Long	07.2021	4	0	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2021	43	(6)	(0,01)
BIST 30 Index August Futures	Long	08.2021	133	(8)	(0,01)
CAC 40 Index July Futures	Long	07.2021	7	(7)	(0,01)
DAX Index September Futures	Long	09.2021	1	(4)	(0,01)
E-mini NASDAQ 100 Index September Futures	Long	09.2021	4	36	0,05
E-Mini Russell 2000 Index September Futures	Long	09.2021	3	(2)	0,00
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2021	2	6	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2021	56	(9)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	2	\$ (1)	0,00
FTSE 100 Index September Futures	Long	09.2021	10	(13)	(0,02)
FTSE China A50 Index July Futures	Long	07.2021	70	7	0,01
FTSE Taiwan Index July Futures	Long	07.2021	20	24	0,03
FTSE/JSE Index September Futures	Long	09.2021	12	(14)	(0,02)
FTSE/MIB Index September Futures	Long	09.2021	6	(22)	(0,03)
Hang Seng China Enterprises Index July Futures	Long	07.2021	8	(3)	(0,01)
IBEX 35 Index July Futures	Long	07.2021	6	(31)	(0,04)
MEXBOL Index September Futures	Long	09.2021	20	(9)	(0,01)
MSCI Singapore Index July Futures	Long	07.2021	49	3	0,00
OMX Stockholm 30 Index July Futures	Long	07.2021	51	(6)	(0,01)
S&P CNX Nifty Index July Futures	Long	07.2021	41	(10)	(0,01)
S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures	Long	09.2021	5	6	0,01
SPI 200 Index September Futures	Long	09.2021	19	(18)	(0,02)
Swiss Market September Futures	Long	09.2021	26	20	0,03
Topix Index September Futures	Long	09.2021	7	(11)	(0,01)
Volatility S&P 500 Index July Futures	Short	07.2021	24	22	0,03
VSTOXX Mini July Futures	Short	07.2021	65	2	0,00
WIG20 Index September Futures	Long	09.2021	71	(12)	(0,02)
				\$ (60)	(0,08)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (60)	(0,08)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000 %	20.06.2026	\$ 7.200	\$ 1	0,00
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	5.500	30	0,04
iTraxx Crossover 35 5-Year Index	5,000	20.06.2026	€ 4.700	15	0,02
				\$ 46	0,06

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.12.2030	£ 2.200	\$ 4	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	4,175	16.09.2025	INR 33.800	5	0,01
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	4,313	16.12.2025	200	0	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	4,710	17.03.2026	50.700	8	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,260	15.09.2026	138.300	12	0,02
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,400	17.03.2026	85.500	12	0,02
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,400	16.06.2026	15.300	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,580	02.01.2025	BRL 10.300	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,770	02.01.2025	3.300	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,840	02.01.2025	11.400	(10)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,877	02.01.2025	3.000	(3)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,620	02.01.2025	5.500	5	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,630	02.01.2025	4.900	4	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,840	02.01.2025	16.800	62	0,08
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,010	02.01.2025	7.900	23	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,328	02.01.2025	20.000	28	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,715	02.01.2025	7.800	(7)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,733	02.01.2025	8.200	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,550	02.01.2025	700	(1)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	CAD 5.200	4	0,01
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,268	16.09.2025	CNY 3.000	0	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,295	16.09.2025	17.900	3	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,345	16.09.2025	6.000	1	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,630	16.12.2025	2.400	(1)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,645	16.12.2025	8.600	(2)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,645	16.12.2025	7.400	1	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,663	17.03.2026	4.200	(1)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,700	17.03.2026	7.000	(2)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,718	16.12.2025	2.900	1	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,725	16.09.2025	3.000	1	0,00
Erhalt ⁽³⁾	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	15.09.2026	55.300	(32)	(0,04)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,760	17.03.2026	12.500	3	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,780	16.12.2025	15.900	3	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,790	17.03.2026	2.800	(1)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,800	16.06.2026	55.700	5	0,01
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,823	17.03.2026	4.500	(1)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,828	17.03.2026	4.300	1	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,900 %	17.03.2026		CNY 20.900	\$ (18)	(0,02)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,903	17.03.2026		5.500	1	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,993	17.03.2026		8.300	2	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,034	13.01.2026		COP 2.305.800	(48)	(0,06)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,220	11.12.2025		1.542.400	5	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,295	09.10.2025		1.638.900	(4)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,400	28.08.2025		1.571.400	4	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,850	24.04.2025		2.558.800	(6)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,940	05.03.2026		4.713.300	57	0,08
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,110	23.03.2026		6.908.300	74	0,10
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,240	16.04.2026		4.566.900	38	0,05
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,350	27.03.2025		625.600	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,360	30.03.2025		836.600	1	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,490	30.04.2026		3.271.600	(18)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,660	11.06.2026		3.286.400	16	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,850	08.01.2025		2.507.300	(4)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,880	07.05.2026		3.283.600	(4)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,150	13.03.2025		121.800	0	0,00
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,500	17.03.2026		HKD 26.700	(16)	(0,02)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,508	17.03.2026		4.700	(7)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,550	16.12.2025		4.700	7	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,560	17.03.2026		3.200	(5)	(0,01)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,565	16.12.2025		7.800	(11)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,568	17.03.2026		6.300	10	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,583	16.12.2025		7.900	(11)	(0,02)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,607	17.03.2026		9.400	14	0,02
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,608	17.03.2026		7.900	12	0,02
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,618	16.09.2025		7.800	(10)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,670	17.03.2026		12.600	11	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,680	16.12.2025		3.200	(5)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,698	16.12.2025		3.100	5	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,700	16.09.2025		11.100	15	0,02
Zahlung ⁽³⁾	3-Month HKD-HIBOR	0,750	15.09.2026		78.600	(51)	(0,07)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,790	16.09.2025		4.700	(7)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,867	17.03.2026		31.700	(11)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	3-Month HKD-HIBOR	0,883	15.09.2026		7.800	(1)	0,00
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,000	17.03.2026		11.100	(10)	(0,01)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,000	16.06.2026		43.400	9	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,085	16.09.2025		11.200	17	0,02
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,100	16.06.2026		12.700	(25)	(0,03)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,120	17.06.2025		3.200	5	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,340	18.03.2025		8.000	(11)	(0,02)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,593	18.12.2024		6.600	(9)	(0,01)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,600	17.06.2025		5.900	(10)	(0,01)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,715	18.03.2025		10.800	(17)	(0,02)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,628	25.06.2026		ILS 5.600	4	0,00
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,728	04.06.2026		4.100	4	0,01
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,730	21.05.2026		3.500	(7)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	0,830	16.09.2025		KRW 950.500	(2)	0,00
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,888	16.12.2025		509.100	1	0,00
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,910	16.09.2025		737.100	1	0,00
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,994	16.12.2025		450.000	1	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,000	16.12.2025		907.600	(2)	0,00
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,120	17.03.2026		4.208.600	8	0,01
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,400	17.03.2026		5.001.700	11	0,01
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,500	16.06.2026		3.925.900	7	0,01
Erhalt ⁽³⁾	3-Month KRW-KORIBOR	1,500	15.09.2026		1.601.900	4	0,00
Erhalt ⁽³⁾	3-Month KRW-KORIBOR	1,625	15.09.2026		900.700	2	0,00
Erhalt ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.12.2026		\$ 1.500	0	0,00
Zahlung ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.12.2031		400	1	0,00
Erhalt ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.12.2051		200	(1)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,900	12.11.2025		ZAR 3.400	(8)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	4,938	18.09.2025		7.000	19	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,120	02.09.2025		500	1	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,330	13.05.2025		8.300	(21)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,375	27.05.2025		7.800	(20)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,601	09.06.2026		31.050	(34)	(0,04)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,680	08.06.2026		41.150	(41)	(0,05)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,780	03.03.2026		36.600	6	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,860	23.06.2026		75.600	28	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	17.03.2026		1.200	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,200	22.04.2025		7.800	(19)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,320	23.04.2025		5.600	(14)	(0,02)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,835	28.08.2024		100	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,600	19.06.2024		7.100	18	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	20.03.2024		9.180	(22)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,800	19.12.2023		3.100	(7)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,130	31.07.2025		CLP 332.000	(7)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,190	14.08.2025		6.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,310	23.10.2025		4.700	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,750	12.02.2026		901.600	82	0,11

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		1,915 %	09.03.2025	CLP	325.300	\$ (7)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,280	14.02.2025		317.700	(7)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,290	09.03.2026		1.057.700	62	0,08
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,525	22.03.2026		755.000	19	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		3,170	21.06.2026		791.600	14	0,02
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		0,421	15.05.2025	CZK	900	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		0,590	26.03.2025		10.900	(16)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		0,637	24.07.2025		7.700	(11)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		0,665	22.09.2025		5.100	(8)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		0,690	04.05.2025		4.100	(6)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		0,710	30.03.2025		100	0	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		0,776	20.08.2025		7.900	(11)	(0,02)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		1,100	31.12.2025		57.000	93	0,12
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		1,124	13.03.2025		12.000	(18)	(0,02)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		1,570	09.03.2026		59.800	33	0,04
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR		1,580	19.03.2026		51.600	12	0,02
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR		1,775	04.06.2026		57.900	(23)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,150	17.06.2030	€	1.900	6	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR		1,085	14.08.2025	HUF	186.300	22	0,03
Zahlung	6-Month HUF-BBR		1,115	08.01.2026		1.131.600	(167)	(0,22)
Erhalt	6-Month HUF-BBR		1,220	15.01.2026		559.700	83	0,11
Erhalt	6-Month HUF-BBR		1,230	15.01.2026		872.700	130	0,17
Zahlung	6-Month HUF-BBR		1,920	16.04.2026		426.000	(33)	(0,04)
Erhalt	6-Month HUF-BBR		1,958	19.03.2026		1.746.000	91	0,12
Erhalt	6-Month HUF-BBR		1,980	09.03.2026		646.300	34	0,05
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR		0,000	16.12.2030	¥	520.000	19	0,02
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR		0,000	16.06.2031		1.270.000	2	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,481	11.08.2025	PLN	3.400	(23)	(0,03)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,560	17.04.2025		1.900	(13)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,580	11.01.2026		8.500	(65)	(0,09)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,585	22.09.2025		6.000	(41)	(0,06)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		0,635	08.05.2025		1.100	(8)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		0,730	05.02.2026		6.500	46	0,06
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		0,890	12.02.2026		20.900	107	0,14
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		1,188	19.03.2026		17.800	0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		1,229	09.03.2026		7.000	8	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR		1,465	07.06.2026		800	(1)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		1,636	29.11.2024		700	(4)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR		2,000	19.06.2024		2.400	(18)	(0,02)
Erhalt	6-Month SGD-SOR		0,480	17.03.2026	SGD	400	5	0,01
Zahlung	6-Month SGD-SOR		0,483	17.03.2026		2.300	(37)	(0,05)
Zahlung	6-Month SGD-SOR		0,485	17.03.2026		1.900	(31)	(0,04)
Zahlung	6-Month SGD-SOR		0,498	16.12.2025		1.100	(18)	(0,02)
Zahlung	6-Month SGD-SOR		0,501	16.12.2025		1.630	(26)	(0,04)
Erhalt	6-Month SGD-SOR		0,503	17.03.2026		1.900	31	0,04
Erhalt	6-Month SGD-SOR		0,515	16.12.2025		3.000	48	0,06
Zahlung	6-Month SGD-SOR		0,522	16.09.2025		2.200	(33)	(0,04)
Zahlung	6-Month SGD-SOR		0,525	17.03.2026		800	(13)	(0,02)
Erhalt	6-Month SGD-SOR		0,544	16.09.2025		800	12	0,02
Erhalt	6-Month SGD-SOR		0,547	17.03.2026		800	13	0,02
Erhalt	6-Month SGD-SOR		0,561	16.09.2025		1.700	26	0,03
Erhalt	6-Month SGD-SOR		0,568	17.03.2026		3.000	49	0,06
Zahlung	6-Month SGD-SOR		0,571	16.12.2025		600	(10)	(0,01)
Zahlung	6-Month SGD-SOR		0,575	16.09.2025		600	(9)	(0,01)
Zahlung	6-Month SGD-SOR		0,585	16.09.2025		800	(12)	(0,02)
Zahlung	6-Month SGD-SOR		0,585	17.03.2026		2.400	(39)	(0,05)
Erhalt	6-Month SGD-SOR		0,623	16.09.2025		1.100	17	0,02
Erhalt	6-Month SGD-SOR		0,660	17.06.2025		600	9	0,01
Erhalt	6-Month SGD-SOR		0,791	17.03.2026		5.400	43	0,06
Erhalt	6-Month SGD-SOR		0,850	18.03.2025		800	11	0,01
Erhalt	6-Month SGD-SOR		1,000	17.03.2026		1.700	(1)	0,00
Erhalt	6-Month SGD-SOR		1,110	17.06.2025		700	12	0,02
Erhalt	6-Month SGD-SOR		1,168	17.06.2025		500	8	0,01
Zahlung	6-Month SGD-SOR		1,210	18.03.2025		900	(13)	(0,02)
Erhalt ⁽⁵⁾	6-Month SGD-SOR		1,250	15.09.2026		4.700	1	0,00
Zahlung	6-Month SGD-SOR		1,296	18.03.2025		3.100	(45)	(0,06)
Zahlung	6-Month SGD-SOR		1,423	18.03.2025		900	(13)	(0,02)
Zahlung	6-Month SGD-SOR		1,450	18.12.2024		300	(5)	(0,01)
Zahlung	6-Month SGD-SOR		1,530	17.06.2025		900	(16)	(0,02)
Erhalt	6-Month SGD-SOR		1,546	18.03.2025		2.000	30	0,04
Zahlung	6-Month SGD-SOR		2,240	19.12.2023		2.600	(33)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		4,775	26.06.2025	MXN	4.900	16	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		4,800	05.02.2026		65.500	179	0,24
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,080	09.10.2025		14.500	(53)	(0,07)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,095	30.10.2025		23.500	(85)	(0,11)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,120	06.05.2025		15.800	(53)	(0,07)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		5,443	17.04.2025		5.700	(20)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		5,550	12.03.2026		32.800	68	0,09
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,050	04.06.2026		22.600	(25)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,095	20.03.2026		51.800	53	0,07
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,210	28.03.2025		4.300	(15)	(0,02)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,230 %	07.04.2025	MXN 16.700	\$ (60)	(0,08)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,255	21.05.2026	23.500	16	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,460	18.06.2026	34.000	9	0,01
						\$ 395	0,52
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 441	0,58

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

ZINSSWAPS										
Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR		0,230 %	02.12.2025	ILS 2.100	\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		0,250	20.08.2025	2.100	3	2	5	0,01
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR		0,265	29.05.2025	3.700	0	(8)	(8)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR		0,270	04.11.2025	2.900	0	(7)	(7)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR		0,305	15.05.2025	2.900	0	(4)	(4)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR		0,330	14.02.2025	2.900	0	(1)	(1)	0,00
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR		0,335	29.11.2024	2.200	0	0	0	0,00
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR		0,361	03.02.2026	2.800	0	(6)	(6)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR		0,403	31.01.2025	2.900	0	2	2	0,00
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		0,405	30.10.2024	1.500	0	(2)	(2)	0,00
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		0,666	06.04.2026	6.400	0	(10)	(10)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		0,684	10.03.2026	7.800	0	(20)	(20)	(0,03)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		0,712	19.03.2026	19.700	0	(58)	(58)	(0,08)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR		1,345	23.11.2023	5.900	0	62	62	0,08
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR		1,288	18.12.2024	KRW 707.600	0	5	5	0,01
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR		1,315	18.03.2025	3.367.800	0	(25)	(25)	(0,03)
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR		1,372	18.03.2025	706.600	0	4	4	0,01
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR		1,425	28.01.2025	2.375.600	0	6	6	0,01
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR		1,755	07.02.2024	2.627.800	23	1	24	0,03
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR		1,965	20.03.2024	974.800	(12)	(1)	(13)	(0,02)
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR		2,100	19.09.2023	2.442.500	11	26	37	0,05
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR		2,153	17.03.2026	2.700	0	(13)	(13)	(0,02)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR		2,367	17.03.2026	5.700	0	13	13	0,02
Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR		2,700	16.06.2026	7.800	10	(2)	8	0,01	
BPS	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,500	17.06.2025	CNY 2.900	0	(4)	(4)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		0,200	06.03.2025	2.900	0	6	6	0,01
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR		0,285	19.05.2025	1.500	0	(3)	(3)	0,00
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR		0,375	13.03.2025	1.500	0	0	0	0,00
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		0,410	18.10.2024	2.200	0	(3)	(3)	0,00
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		0,710	25.03.2025	3.300	0	(13)	(13)	(0,02)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		1,480	30.11.2023	6.000	0	(70)	(70)	(0,09)
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR		1,213	18.12.2024	KRW 1.947.200	0	18	18	0,02
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR		1,330	18.03.2025	708.700	0	(5)	(5)	(0,01)
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR		1,965	20.03.2024	1.592.000	(14)	(7)	(21)	(0,03)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR		2,646	17.03.2026	8.800	0	(6)	(6)	(0,01)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX		1,111	17.03.2026	THB 24.900	0	(8)	(8)	(0,01)
	CBK	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		0,257	11.12.2025	ILS 1.300	0	4	4
Zahlung		3-Month ILS-TELBOR		0,293	18.05.2025	3.000	0	(5)	(5)	(0,01)
Zahlung		3-Month ILS-TELBOR		0,406	01.11.2024	1.500	0	2	2	0,00
Erhalt		3-Month ILS-TELBOR		0,413	08.11.2024	2.200	0	(3)	(3)	0,00
Zahlung		3-Month ILS-TELBOR		0,573	20.04.2026	4.800	0	1	1	0,00
Zahlung		3-Month ILS-TELBOR		1,202	19.09.2023	10.400	0	98	98	0,13
Erhalt		3-Month ILS-TELBOR		1,373	07.09.2023	11.032	0	(122)	(122)	(0,16)
Zahlung		3-Month KRW-KORIBOR		0,805	16.09.2025	KRW 725.900	0	(21)	(21)	(0,03)
Zahlung		3-Month KRW-KORIBOR		1,328	18.03.2025	696.700	0	(5)	(5)	(0,01)
Zahlung		3-Month MYR-KLIBOR		1,987	16.12.2025	1.800	0	(11)	(11)	(0,01)
Erhalt		3-Month MYR-KLIBOR		2,271	17.09.2025	2.700	0	7	7	0,01
Zahlung		6-Month THB-THBFX		0,970	18.03.2025	THB 33.800	0	8	8	0,01
Erhalt		6-Month THB-THBFX		1,190	16.06.2026	56.600	0	(19)	(19)	(0,03)
CKL	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		1,060	15.02.2024	ILS 3.100	9	(32)	(23)	(0,03)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR		0,220	23.10.2025	2.900	0	(9)	(9)	(0,01)
GLM	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		0,233	02.12.2025	2.400	0	8	8	0,01
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		0,250	20.08.2025	2.200	0	5	5	0,01
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR		0,320	15.01.2026	1.900	0	5	5	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettöver- mögens	
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,370 %	28.08.2025	ILS	1.400	\$ 0	\$ 1	0,00	
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,393	02.01.2025		2.800	0	(2)	0,00	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,586	23.04.2026		10.400	0	6	0,01	
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,635	27.03.2025		4.200	0	(13)	(0,02)	
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,650	26.03.2025		3.300	0	(11)	(0,01)	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,967	19.06.2024		3.000	0	18	0,02	
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,026	19.02.2024		2.300	0	(17)	(0,02)	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,098	17.09.2025	MYR	1.800	0	(8)	(0,01)	
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	2,840	16.06.2026		3.500	(5)	(4)	(0,01)	
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,837	17.03.2026	THB	18.300	0	2	0,00	
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,130	16.06.2026		28.400	6	1	0,01	
HUS	Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,195	18.03.2025	INR	82.600	0	8	0,01	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,350	18.09.2024	ILS	1.400	0	1	0,00	
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,390	05.02.2026		10.500	0	17	0,02	
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,035	25.03.2024		3.900	1	(29)	(0,04)	
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,245	18.12.2024	KRW	474.900	0	4	0,01	
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,773	20.03.2024		2.300.100	0	(19)	(0,03)	
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,965	20.03.2024		1.147.000	(9)	(6)	(0,02)	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,100	19.09.2023		3.582.600	0	54	0,07	
JPM	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,525	20.03.2025	CNY	4.400	0	(4)	(0,01)	
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,638	18.03.2025		23.900	0	(9)	(0,01)	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,030	19.06.2024	ILS	2.900	0	19	0,03	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,280	11.01.2024		17.620	0	170	0,23	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,119	18.03.2025	KRW	1.454.600	0	(20)	(0,03)	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,200	20.03.2025		1.207.600	0	(14)	(0,02)	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,240	18.03.2025		477.300	0	(5)	(0,01)	
MYC	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,266	16.11.2025	ILS	1.400	0	4	0,01	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	1,975	16.12.2025	MYR	1.800	0	(11)	(0,01)	
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,755	16.12.2025	THB	12.600	0	(3)	0,00	
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,130	16.06.2026		75.500	23	(4)	0,02	
SCX	Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,200	03.04.2025	CNY	3.000	0	9	0,01	
	Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,430	06.03.2025		5.900	0	9	0,01	
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,965	27.03.2025	KRW	1.283.700	0	25	0,03	
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,990	06.03.2025		710.900	0	13	0,02	
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,075	03.04.2025		499.000	0	8	0,01	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,160	11.10.2024		832.400	0	(8)	(0,01)	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,755	07.02.2024		1.943.000	11	7	0,02	
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	2,033	16.12.2025	MYR	3.500	0	19	0,03	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,212	17.03.2026		2.600	0	(10)	(0,01)	
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	2,363	17.03.2026		3.000	0	7	0,01	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,915	18.03.2025		4.400	0	17	0,02	
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,800	17.03.2026	THB	11.000	0	(2)	0,00	
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,843	17.06.2025		13.000	0	0	0,00	
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,018	17.06.2025		19.600	0	(4)	(0,01)	
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,069	17.03.2026		30.700	0	(8)	(0,01)	
							\$ 57	\$ (19)	\$ 38	0,05

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettöver- mögens	
GST	Zahlung	BOVESPA Index	11	0,000 %	BRL	1.443	18.08.2021	\$ 0	\$ (8)	(0,01)	
	Zahlung	KOSPI 200 Index	750.000	0,000	KRW	325.171	09.09.2021	0	4	0,01	
MEI	Zahlung	BOVESPA Index	42	0,000	BRL	5.524	18.08.2021	0	(36)	(0,05)	
	Zahlung	KOSPI 200 Index	2.000.000	0,000	KRW	865.983	09.09.2021	0	10	0,01	
	Zahlung	RTS Index	9	0,000	\$	1.476	16.09.2021	0	(25)	(0,03)	
								\$ 0	\$ (55)	\$ (55)	(0,07)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettöver- mögens	
BOA	07.2021	BRL	1.923	\$ 0	\$ (21)	\$ (21)	(0,03)	
	09.2021	\$	8	AUD	11	0	0,00	
	09.2021		3	CHF	3	0	0,00	
	09.2021		793	CNH	5.091	0	(8)	(0,01)
	09.2021		9	€	7	0	0	0,00
	09.2021		636	IDR	9.165.097	0	(11)	(0,01)
	09.2021		1.408	INR	104.082	0	(18)	(0,02)
	09.2021		700	PEN	2.625	0	(13)	(0,02)
	09.2021		405	PHP	19.528	0	(7)	(0,01)
	09.2021		401	PLN	1.521	0	(1)	0,00
BPS	07.2021	BRL	4.418	\$ 900	19	0	19	0,03
	07.2021	CAD	302	\$ 251	7	0	7	0,01
	07.2021	\$	6	MXN	125	0	0	0,00
	08.2021		897	BRL	4.418	0	(19)	(0,03)
	09.2021	CAD	5.900	\$ 4.809	44	0	44	0,06

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens		
	09.2021	CHF	7.750	\$	8.472	\$	75	0,10	
	09.2021	£	2.438		3.413		46	0,06	
	09.2021	HUF	292.934		1.000		11	0,01	
	09.2021	IDR	2.889.940		201		3	0,00	
	09.2021	NZD	1.400		989		11	0,01	
	09.2021	SEK	135		16		0	0,00	
	09.2021	SGD	1.216		919		14	0,02	
	09.2021	\$	200	BRL	1.078		13	0,02	
	09.2021		839	CHF	750		0	(26)	(0,04)
	09.2021		1.416	£	1.000		0	(35)	(0,05)
	09.2021		797	IDR	11.555.408		0	(8)	(0,01)
	09.2021		500	THB	15.602		0	(13)	(0,02)
	10.2021	MXN	308	\$	15		0	0	0,00
BRC	07.2021	\$	19	MXN	373		0	0	0,00
	08.2021		53		1.095		2	0	0,00
	09.2021	PLN	14	\$	4		0	0	0,00
	09.2021	THB	100.303		3.215		87	0	0,11
	09.2021	\$	767	€	628		0	(21)	(0,03)
	09.2021		4.085	£	2.884		0	(101)	(0,13)
	09.2021		902	ILS	2.924		0	(4)	(0,01)
CBK	07.2021	BRL	8.020	\$	1.522		0	(76)	(0,10)
	07.2021	PEN	2.798		755		24	0	0,03
	07.2021	\$	43	MXN	860		0	0	0,00
	07.2021		36	PEN	144		1	0	0,00
	08.2021	PEN	1.302	\$	353		13	(1)	0,02
	09.2021	CLP	705.632		959		0	(9)	(0,01)
	09.2021	KRW	131.305		118		1	0	0,00
	09.2021	TWD	312		11		0	0	0,00
	09.2021	\$	400	COP	1.463.200		0	(9)	(0,01)
	09.2021		36	HUF	10.660		0	0	0,00
	09.2021		700	IDR	10.185.000		0	(5)	(0,01)
	09.2021		603	KRW	669.726		0	(10)	(0,01)
	09.2021		1.185	THB	37.045		0	(29)	(0,04)
	09.2021		740	ZAR	10.109		0	(38)	(0,05)
	10.2021	PEN	1.465	\$	401		17	0	0,02
	11.2021	ILS	1.150		351		0	(3)	0,00
	11.2021	\$	995	MXN	20.217		2	0	0,00
	01.2022	ILS	74	\$	23		0	0	0,00
	02.2022		130		40		0	0	0,00
	03.2022		430		130		0	(2)	0,00
	04.2022		490		150		0	(1)	0,00
	06.2022		100		31		0	0	0,00
	08.2022		365		110		0	(2)	0,00
DUB	11.2021	\$	445	CLP	318.316		0	(9)	(0,01)
GLM	07.2021	BRL	295	\$	60		1	0	0,00
	07.2021		£746		1.055		24	0	0,03
	07.2021	\$	3.438	BRL	17.472		45	0	0,06
	07.2021		20	MXN	390		0	0	0,00
	08.2021		60	BRL	295		0	(1)	0,00
	08.2021		625	COP	2.325.103		5	(8)	0,00
	09.2021	CLP	1.280.393	\$	1.741		0	(15)	(0,02)
	09.2021	HUF	563.462		1.963		62	0	0,08
	09.2021	MXN	38.839		1.900		0	(36)	(0,05)
	09.2021	PHP	29.370		600		2	0	0,00
	09.2021	PLN	11		3		0	0	0,00
	09.2021	RON	10.452		2.555		43	0	0,06
	09.2021	SGD	3.534		2.636		7	0	0,01
	09.2021	THB	15.251		489		13	0	0,02
	09.2021	TWD	1.228		45		1	0	0,00
	09.2021	\$	27	AUD	35		0	(1)	0,00
	09.2021		2.000	BRL	10.075		6	(13)	(0,01)
	09.2021		5	CZK	100		0	0	0,00
	09.2021		2.671	HUF	762.440		0	(99)	(0,13)
	09.2021		13	ILS	42		0	0	0,00
	09.2021		752	MYR	3.131		1	(1)	0,00
	09.2021		42	PLN	161		0	0	0,00
	09.2021		791	RON	3.268		0	(6)	(0,01)
	09.2021		6	SEK	50		0	0	0,00
	09.2021		531	SGD	703		0	(8)	(0,01)
	09.2021		641	ZAR	8.792		0	(30)	(0,04)
	11.2021	PEN	654	\$	175		3	0	0,00
	03.2022	ILS	80		24		0	0	0,00
HUS	07.2021	\$	1.033	£	746		0	(2)	0,00
	07.2021		20	MXN	418		1	0	0,00
	08.2021	£	746	\$	1.033		2	0	0,00
	09.2021	CNH	9.831		1.520		8	(3)	0,01
	09.2021	¥	166.400		1.522		22	0	0,03
	09.2021	RON	4.874		1.178		7	0	0,01
	09.2021	THB	60.655		1.900		8	0	0,01
	09.2021	TRY	76		9		0	0	0,00
	09.2021	\$	4	CAD	5		0	0	0,00
	09.2021		807	CNH	5.188		0	(7)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2021	\$ 4	CZK 84	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	09.2021	66	HUF 19.609	0	0	0	0,00
	09.2021	1.206	ILS 3.925	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	16	¥ 1.800	0	0	0	0,00
	09.2021	146	MXN 3.060	7	0	7	0,01
	09.2021	218	NOK 1.800	0	(8)	(8)	(0,01)
	09.2021	129	PLN 491	0	0	0	0,00
	09.2021	770	RUB 57.178	6	0	6	0,01
	09.2021	4	SGD 6	0	0	0	0,00
	09.2021	667	THB 20.780	0	(19)	(19)	(0,03)
	09.2021	13	ZAR 186	0	0	0	0,00
	01.2022	ILS 169	\$ 52	0	0	0	0,00
IND	09.2021	\$ 516	CLP 372.516	0	(5)	(5)	(0,01)
	09.2021	31	CZK 659	0	0	0	0,00
	09.2021	9	PLN 35	0	0	0	0,00
JPM	07.2021	BRL 295	\$ 60	1	0	1	0,00
	08.2021	COP 5.224.366	1.430	34	0	34	0,04
	08.2021	\$ 60	BRL 295	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	COP 4.915.950	\$ 1.300	0	(12)	(12)	(0,02)
	09.2021	€ 2.250	2.696	24	0	24	0,03
	09.2021	HKD 1.324	171	0	0	0	0,00
	09.2021	¥ 537.500	4.899	53	0	53	0,07
	09.2021	KRW 566.960	500	0	(2)	(2)	0,00
	09.2021	NOK 12.000	1.411	16	0	16	0,02
	09.2021	SEK 18.000	2.127	21	0	21	0,03
	09.2021	SGD 529	400	6	0	6	0,01
	09.2021	TRY 80	9	0	0	0	0,00
	09.2021	\$ 6	AUD 8	0	0	0	0,00
	09.2021	1.200	COP 4.316.400	0	(48)	(48)	(0,06)
	09.2021	280	CZK 5.833	0	(9)	(9)	(0,01)
	09.2021	961	INR 70.743	0	(17)	(17)	(0,02)
	09.2021	410	KRW 455.292	0	(7)	(7)	(0,01)
	09.2021	1.081	NZD 1.499	0	(34)	(34)	(0,05)
	09.2021	1.813	RON 7.345	0	(48)	(48)	(0,06)
	09.2021	900	RUB 66.000	0	(4)	(4)	(0,01)
	09.2021	ZAR 9.687	\$ 677	4	0	4	0,00
	10.2021	\$ 28	MXN 592	1	0	1	0,00
	11.2021	ILS 70	\$ 22	0	0	0	0,00
MYI	11.2021	\$ 41	CLP 29.427	0	0	0	0,00
	07.2021	BRL 821	\$ 153	0	(10)	(10)	(0,01)
	07.2021	€ 78	93	1	0	1	0,00
	09.2021	ILS 1.997	612	0	(2)	(2)	0,00
	09.2021	NZD 1.400	999	21	0	21	0,03
	09.2021	PEN 3.573	900	0	(36)	(36)	(0,05)
	09.2021	PLN 2.643	716	21	0	21	0,03
	09.2021	\$ 339	AUD 438	0	(11)	(11)	(0,01)
	09.2021	6.249	CAD 7.551	0	(152)	(152)	(0,20)
	09.2021	3.603	CHF 3.211	0	(124)	(124)	(0,16)
	09.2021	1.047	CLP 754.217	0	(13)	(13)	(0,02)
	09.2021	19	CZK 405	0	0	0	0,00
	09.2021	52	€ 43	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	6	£ 4	0	0	0	0,00
	09.2021	448	HUF 128.507	0	(15)	(15)	(0,02)
	09.2021	17	ILS 54	0	0	0	0,00
	09.2021	6	¥ 700	0	0	0	0,00
	09.2021	678	PHP 32.486	0	(16)	(16)	(0,02)
	09.2021	408	PLN 1.492	0	(16)	(16)	(0,02)
	09.2021	200	RUB 14.828	1	0	1	0,00
	09.2021	1.760	SEK 14.505	0	(64)	(64)	(0,08)
	09.2021	633	THB 19.724	0	(18)	(18)	(0,02)
	09.2021	6	ZAR 88	0	0	0	0,00
	01.2022	ILS 11	\$ 3	0	0	0	0,00
RBC	09.2021	AUD 800	619	18	0	18	0,02
	09.2021	HKD 914	118	0	0	0	0,00
	09.2021	\$ 58	AUD 75	0	(2)	(2)	0,00
	09.2021	20	CHF 18	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	181	€ 150	0	(2)	(2)	0,00
	09.2021	400	INR 29.806	0	(2)	(2)	0,00
RYL	09.2021	56	CHF 51	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	454	€ 375	0	(9)	(9)	(0,01)
	09.2021	75	KZT 32.525	1	0	1	0,00
	09.2021	23	SEK 195	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	€ 1.899	\$ 2.323	72	0	72	0,09
	07.2021	MXN 1.751	88	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 36	PEN 144	1	0	1	0,00
	09.2021	AUD 800	\$ 608	7	0	7	0,01
	09.2021	INR 82.863	1.121	14	0	14	0,02
	09.2021	PEN 144	36	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	\$ 461	AUD 594	0	(15)	(15)	(0,02)
	09.2021	56	CZK 1.170	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	1.213	NOK 10.000	0	(51)	(51)	(0,07)
	09.2021	864	NZD 1.200	0	(26)	(26)	(0,03)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2021	\$ 5	SEK 40	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	09.2021	ZAR 7.652	\$ 549	17	0	17	0,02
SOG	09.2021	\$ 4	AUD 5	0	0	0	0,00
	09.2021	495	CAD 600	0	(11)	(11)	(0,01)
	09.2021	474	CHF 426	0	(12)	(12)	(0,02)
	09.2021	3	¥ 300	0	0	0	0,00
	09.2021	6	SEK 55	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	BRL 1.701	\$ 325	1	(15)	(14)	(0,02)
	08.2021	\$ 59	BRL 295	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	¥ 62.500	\$ 570	7	0	7	0,01
	09.2021	\$ 36	HUF 10.687	0	0	0	0,00
	09.2021	5	¥ 500	0	0	0	0,00
	09.2021	200	MXN 4.026	1	0	1	0,00
	09.2021	480	SEK 4.000	0	(12)	(12)	(0,02)
	09.2021	10	SGD 13	0	0	0	0,00
TOR	09.2021	ZAR 2.769	\$ 200	8	0	8	0,01
	09.2021	MXN 3.968	200	2	0	2	0,00
	09.2021	\$ 300	MXN 6.019	0	0	0	0,00
	09.2021	2.007	SGD 2.657	0	(31)	(31)	(0,04)
UAG	07.2021	57	MXN 1.160	1	0	1	0,00
	09.2021	22	CAD 27	0	0	0	0,00
	09.2021	47	CZK 999	0	0	0	0,00
	09.2021	95	€ 79	0	(2)	(2)	0,00
	09.2021	12	¥ 1.300	0	0	0	0,00
	09.2021	28	ZAR 394	0	0	0	0,00
				\$ 1.018	\$ (1.618)	\$ (600)	(0,80)

ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 107	€ 88	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
BPS	07.2021	€ 128	\$ 153	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 5.087	€ 4.159	0	(154)	(154)	(0,20)
HUS	07.2021	€ 218	\$ 260	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 162	€ 136	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07.2021	93	78	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	5.869	4.797	0	(180)	(180)	(0,24)
TOR	07.2021	5.869	4.797	0	(180)	(180)	(0,24)
UAG	07.2021	37	30	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 3	\$ (520)	\$ (517)	(0,68)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (1.134)	(1,50)
Summe Anlagen						\$ 68.446	90,71
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 7.007	9,29
Nettovermögen						\$ 75.453	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Nullkuponwertpapier.
- (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (c) Mit dem Fonds verbunden.
- (d) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 20 und Barmittel in Höhe von USD 620 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 5.487 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert¹

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 61.823	\$ 0	\$ 61.823
Investmentfonds	5.304	2.072	0	7.376
Finanzderivate ⁽³⁾	(62)	(691)	0	(753)
Summen	\$ 5.242	\$ 63.204	\$ 0	\$ 68.446

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 26.952	\$ 0	\$ 26.952
Investmentfonds	1.803	2.074	0	3.877
Pensionsgeschäfte	0	13.645	0	13.645
Finanzderivate ⁽³⁾	93	2.826	0	2.919
Summen	\$ 1.896	\$ 45.497	\$ 0	\$ 47.393

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (90)	\$ 20	\$ (70)
BPS	(120)	300	180
BRC	(37)	0	(37)
CBK	(193)	0	(193)
CKL	(23)	0	(23)
DUB	(9)	(10)	(19)
GLM	(22)	0	(22)
GST	(4)	0	(4)
HUS	43	(260)	(217)
IND	(5)	0	(5)
JPM	115	(40)	75
MEI	(51)	0	(51)
MYC	9	0	9
MYI	(434)	320	(114)
RBC	11	0	11
RYL	(9)	0	(9)
SCX	(70)	0	(70)
SOG	(23)	0	(23)
SSB	(11)	0	(11)
TOR	(209)	0	(209)
UAG	(2)	0	(2)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	19,19	5,74
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	61,98	51,33
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,76	k. A.
Investmentfonds	9,78	8,21
Pensionsgeschäfte	k. A.	28,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,08)	0,20
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,58	1,40
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,50)	4,58

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	7,68	12,79
US-Regierungsbehörden	3,77	6,57
Non-Agency-MBS	2,07	0,83
Forderungsbesicherte Wertpapiere	3,69	3,85
Staatsemissionen	1,03	0,64
Kurzfristige Instrumente	63,69	32,39
Investmentfonds	9,78	8,21
Pensionsgeschäfte	k. A.	28,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,08)	0,20
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,06	k. A.
Zinsswaps	0,52	1,40
Freiverkehrsfinanzderivate		
Zinsswaps	0,05	0,68
Total Return Swaps auf Indizes	(0,07)	0,12
Devisenterminkontrakte	(0,80)	3,04
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,68)	0,74
Sonstige Aktiva und Passiva	9,29	(0,36)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen UK Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Japan Finance Organization for Municipalities 0,950 % fällig am 12.02.2027	€ 800	€ 691	0,12	CTP NV 1,250 % fällig am 21.06.2029	€ 700	€ 595	0,10	6,000 % fällig am 15.01.2026 (d)(f)	€ 1.000	€ 983	0,17
Summe Japan		2.192	0,37	Digital Intrepid Holding BV 0,625 % fällig am 15.07.2031	€ 2.200	€ 1.828	0,31	Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028	100	85	0,02
JERSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				E.ON International Finance BV				Banco Santander S.A.			
AA Bond Co. Ltd. 2,750 % fällig am 31.07.2043	€ 900	€ 915	0,16	4,750 % fällig am 31.01.2034	€ 2.000	€ 2.562	0,44	0,625 % fällig am 24.06.2029	300	257	0,04
2,875 % fällig am 31.07.2043	897	901	0,15	5,875 % fällig am 30.10.2037	1.100	1.622	0,28	1,500 % fällig am 14.04.2026	€ 2.400	2.412	0,41
4,875 % fällig am 31.07.2043	5.130	5.467	0,93	6,125 % fällig am 06.07.2039	700	1.081	0,18	4,375 % fällig am 14.01.2026 (d)(f)	€ 800	711	0,12
5,500 % fällig am 31.07.2050	431	477	0,08	6,250 % fällig am 03.06.2030	250	339	0,06	6,750 % fällig am 25.04.2022 (d)(f)	200	179	0,03
Gatwick Funding Ltd. 2,500 % fällig am 15.04.2032	600	603	0,10	6,375 % fällig am 07.06.2032	1.268	1.800	0,31	CaixaBank S.A. 1,500 % fällig am 03.12.2026	€ 1.600	€ 1.603	0,27
Heathrow Funding Ltd. 2,750 % fällig am 13.10.2031	600	626	0,11	Enel Finance International NV 0,000 % fällig am 17.06.2027 (b)	€ 1.000	€ 849	0,14	5,875 % fällig am 09.10.2027 (d)(f)	€ 400	394	0,07
2,750 % fällig am 09.08.2051	1.400	1.397	0,24	2,650 % fällig am 10.09.2024	\$ 2.800	2.132	0,36	NorteGas Energia Distribucion S.A. 0,905 % fällig am 22.01.2031	700	594	0,10
4,625 % fällig am 31.10.2046	2.100	2.766	0,47	3,625 % fällig am 25.05.2027	1.250	995	0,17	Summe Spanien		10.334	1,76
5,875 % fällig am 13.05.2043	400	585	0,10	4,625 % fällig am 14.09.2025	700	575	0,10	SUPRANATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
6,450 % fällig am 10.12.2031	500	688	0,12	5,750 % fällig am 14.09.2040	€ 2.000	3.029	0,52	Europäische Investitionsbank 0,750 % fällig am 15.11.2024	€ 2.300	2.328	0,40
6,750 % fällig am 03.12.2028	400	506	0,09	IMCD NV 2,500 % fällig am 26.03.2025	€ 500	450	0,08	3,750 % fällig am 07.12.2027	1.750	2.085	0,36
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig am 05.11.2031 (d)	1.400	1.980	0,34	ING Groep NV 1,125 % fällig am 07.12.2028	€ 1.500	1.471	0,25	4,500 % fällig am 07.06.2029	1.300	1.662	0,28
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025	€ 300	278	0,05	JAB Holdings BV 2,250 % fällig am 19.12.2039	€ 800	723	0,12	5,625 % fällig am 07.06.2032	1.400	2.060	0,35
3,950 % fällig am 30.06.2022	€ 1.051	1.075	0,18	JDE Peet's NV 0,500 % fällig am 16.01.2029	800	682	0,12	6,000 % fällig am 07.12.2028	1.100	1.513	0,26
Summe Jersey, Kanalinseln		18.264	3,12	Koninklijke KPN NV 5,750 % fällig am 17.09.2029	€ 100	125	0,02	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.10.2030 (b)	€ 2.000	1.722	0,29
LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				NN Group NV 4,500 % fällig am 15.01.2026 (d)	€ 400	393	0,07	0,000 % fällig am 04.07.2035 (b)	1.100	903	0,15
Acef Holding S.C.A. 0,750 % fällig am 14.06.2028	€ 600	514	0,09	4,625 % fällig am 13.01.2048	600	615	0,10	Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 0,100 % fällig am 17.09.2035	3.100	2.578	0,44
Aroundtown S.A. 3,000 % fällig am 16.10.2029	€ 2.000	2.137	0,36	Sagax Euro Mtn NL BV 0,750 % fällig am 26.01.2028	600	511	0,09	0,200 % fällig am 21.01.2061	1.700	1.226	0,21
3,250 % fällig am 18.07.2027	2.000	2.179	0,37	Shell International Finance BV 1,000 % fällig am 10.12.2030	€ 600	570	0,10	5,750 % fällig am 07.06.2032	€ 700	1.036	0,18
3,625 % fällig am 10.04.2031	1.250	1.391	0,24	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 1.100	1.053	0,18	International Finance Corp. 0,750 % fällig am 22.07.2027	2.000	2.006	0,34
5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 200	173	0,03	4,441 % fällig am 24.04.2023	\$ 1.400	1.070	0,18	Summe supranational		19.119	3,26
Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 500	426	0,07	Volkswagen Financial Services NV 0,875 % fällig am 20.02.2025	€ 1.300	1.298	0,22	SCHWEDEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
1,500 % fällig am 16.09.2027	900	811	0,14	1,125 % fällig am 18.09.2023	2.900	2.925	0,50	EQT AB 0,875 % fällig am 14.05.2031	€ 700	597	0,10
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 2,000 % fällig am 17.10.2027	€ 1.200	1.228	0,21	Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	€ 600	520	0,09	SCHWEIZ UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	€ 500	419	0,07	Summe Niederlande		37.874	6,46	Credit Suisse AG 1,125 % fällig am 15.12.2025	€ 2.300	2.294	0,39
1,625 % fällig am 23.04.2027	700	619	0,10	STAATSEMISSIONEN				6,500 % fällig am 08.08.2023 (f)	\$ 1.100	881	0,15
2,750 % fällig am 12.05.2026	1.000	936	0,16	Niederlandse Waterschapsbank NV 5,375 % fällig am 07.06.2032	€ 1.000	1.438	0,25	Credit Suisse Group AG 2,125 % fällig am 12.09.2025	€ 1.200	1.233	0,21
2,750 % fällig am 22.01.2028	€ 800	820	0,14	Summe Niederlande		39.312	6,71	2,250 % fällig am 09.06.2028	2.200	2.260	0,39
Logicor Financing SARL 1,625 % fällig am 15.07.2027	€ 1.100	996	0,17	NORWEGEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,750 % fällig am 08.08.2025	350	370	0,06
2,750 % fällig am 15.01.2030	€ 1.000	1.052	0,18	Aker BP ASA 3,750 % fällig am 15.01.2030	\$ 1.600	1.251	0,21	3,091 % fällig am 14.05.2032	\$ 500	373	0,06
Prologis International Funding S.A. 0,750 % fällig am 23.03.2033	€ 325	274	0,05	Summe Norwegen				3,750 % fällig am 26.03.2025	650	511	0,09
Summe Luxemburg		13.975	2,38	SINGAPUR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,194 % fällig am 01.04.2031	900	733	0,13
MAURITIUS UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				SingTel Group Treasury Pte. Ltd. 3,875 % fällig am 28.08.2028	1.100	900	0,15	6,250 % fällig am 18.12.2024 (d)(f)	800	636	0,11
Greenko Dutch BV 3,850 % fällig am 29.03.2026	\$ 500	371	0,06	Temasek Financial Ltd. 5,125 % fällig am 26.07.2040	€ 970	1.523	0,26	7,125 % fällig am 29.07.2022 (d)(f)	400	302	0,05
Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025	800	597	0,10	Summe Singapur		2.423	0,41	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (f)	2.100	1.679	0,29
5,950 % fällig am 29.07.2026	1.100	859	0,15	SLOWENIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,625 % fällig am 17.08.2022 (f)	250	195	0,03
Summe Mauritius		1.827	0,31	Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 900	755	0,13	UBS Group AG 3,126 % fällig am 13.08.2030	1.600	1.243	0,21
NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Slowenien				4,375 % fällig am 10.02.2031 (d)(f)	500	370	0,06
ABN AMRO Bank NV 4,375 % fällig am 22.09.2025 (d)(f)	€ 2.500	2.326	0,40	SUDKOREA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,125 % fällig am 29.07.2026 (d)(f)	600	474	0,08
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	700	603	0,10	SK Hynix, Inc. 2,375 % fällig am 19.01.2031	\$ 500	353	0,06	5,750 % fällig am 19.02.2022 (d)(f)	€ 200	177	0,03
Cooperative Rabobank UA 1,250 % fällig am 14.01.2025	€ 300	303	0,05	Summe Südkorea				Summe Schweiz		13.731	2,34
3,100 % fällig am 29.06.2028 (d)(f)	€ 400	348	0,06	SPANIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				GROSSBRITANNIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
4,375 % fällig am 29.06.2027 (d)(f)	3.000	2.860	0,49	Abertis Infraestructuras S.A. 3,375 % fällig am 27.11.2026	€ 2.700	2.930	0,50	3i Group PLC 3,750 % fällig am 05.06.2040	€ 1.650	1.883	0,32
4,625 % fällig am 23.05.2029	€ 500	596	0,10	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (d)(f)	€ 200	186	0,03	ABP Finance PLC 6,250 % fällig am 14.12.2026	100	123	0,02
5,250 % fällig am 14.09.2027	850	1.025	0,17	Summe Spanien				Anglian Water Services Financing PLC 2,750 % fällig am 26.10.2029	900	995	0,17

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	%DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	%DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	%DES NETTO- VER- MÖGENS
Argiva Financing PLC 5,340 % fällig am 30.12.2037	£ 800	£ 997	0,17	Hammerson PLC 6,000 % fällig am 23.02.2026	£ 300	£ 348	0,06	Northern Gas Networks Finance PLC 5,625 % fällig am 23.03.2040	£ 50	£ 75	0,01
Assura Financing PLC 1,625 % fällig am 30.06.2033 3,000 % fällig am 19.07.2028	1.000 800	993 888	0,17 0,15	HSBC Holdings PLC 1,750 % fällig am 24.07.2027 2,625 % fällig am 16.08.2028 3,000 % fällig am 22.07.2028	1.400 2.000 2.650	1.417 2.127 2.860	0,24 0,36 0,49	Northern Powergrid Yorkshire PLC 4,375 % fällig am 05.07.2032 5,125 % fällig am 04.05.2035	300 200	376 273	0,06 0,05
Aviva PLC 4,000 % fällig am 03.06.2055 5,125 % fällig am 04.06.2050 6,875 % fällig am 20.05.2058	800 200 900	894 239 1.427	0,15 0,04 0,24	3,000 % fällig am 29.05.2030 4,000 % fällig am 09.03.2026 (d)(f) 4,600 % fällig am 17.12.2030 (d)(f) 4,950 % fällig am 31.03.2030	\$ 200 500 1.000	148 376 874	0,03 0,06 0,15	Notting Hill Genesis 2,875 % fällig am 31.01.2029 3,250 % fällig am 12.10.2048	900 1.000	982 1.208	0,17 0,21
Babcock International Group PLC 1,375 % fällig am 13.09.2027 1,875 % fällig am 05.10.2026	€ 200 £ 1.800	175 1.802	0,03 0,31	5,875 % fällig am 28.09.2026 (d)(f) 6,000 % fällig am 22.05.2027 (d)(f) 6,000 % fällig am 29.03.2040	£ 900 £ 600 £ 978	1.011 483 1.412	0,17 0,08 0,24	Pacific Quay Finance PLC 5,565 % fällig am 25.07.2034	167	209	0,04
Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022 (f)	\$ 720	569	0,10	Informa PLC 2,125 % fällig am 06.10.2025 3,125 % fällig am 05.07.2026	€ 800 £ 1.645	732 1.755	0,12 0,30	Peabody Capital No. 2 PLC 3,250 % fällig am 14.09.2048	900	1.095	0,19
Barclays PLC 1,700 % fällig am 03.11.2026 3,125 % fällig am 17.01.2024 3,250 % fällig am 12.02.2027 3,250 % fällig am 17.01.2033 3,650 % fällig am 16.03.2028 4,337 % fällig am 10.01.2028 4,972 % fällig am 16.05.2029 6,375 % fällig am 15.12.2025 (d)(f) 7,125 % fällig am 15.06.2025 (d)(f) 7,250 % fällig am 15.03.2023 (d)(f) 7,750 % fällig am 15.09.2023 (d)(f) 7,875 % fällig am 15.03.2022 (d)(f) 7,875 % fällig am 15.09.2022 (d)(f)	£ 800 300 950 800 \$ 400 300 400 £ 200 200 200 \$ 1.000 600 £ 900	813 317 1.035 891 314 243 339 224 229 216 797 454 967	0,14 0,05 0,18 0,15 0,05 0,04 0,06 0,04 0,04 0,04 0,14 0,08 0,16	InterContinental Hotels Group PLC 2,125 % fällig am 24.08.2026 3,750 % fällig am 14.08.2025	1.800 500	1.835 544	0,31 0,09	Pearson Funding PLC 3,750 % fällig am 04.06.2030	800	894	0,15
Blend Funding PLC 3,459 % fällig am 21.09.2049	800	998	0,17	John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034 6,125 % fällig am 21.01.2025	494 650	519 736	0,09 0,13	Places for People Homes Ltd. 3,625 % fällig am 22.11.2028 5,090 % fällig am 31.07.2043 5,875 % fällig am 23.05.2031	1.800 400 900	2.066 451 1.229	0,35 0,08 0,21
BPHA Finance PLC 4,816 % fällig am 11.04.2044	300	441	0,08	Juturna European Loan Conduit PLC 5,064 % fällig am 10.08.2033	231	285	0,05	Places For People Treasury PLC 2,875 % fällig am 17.08.2026	650	707	0,12
British Land Co. PLC 2,375 % fällig am 14.09.2029	2.500	2.561	0,44	Land Securities Capital Markets PLC 1,974 % fällig am 08.02.2026 2,399 % fällig am 08.02.2031	1.300 1.251	1.334 1.326	0,23 0,23	Prudential PLC 6,125 % fällig am 19.12.2031	580	802	0,14
British Telecommunications PLC 3,125 % fällig am 21.11.2031	800	865	0,15	LCR Finance PLC 4,500 % fällig am 07.12.2038	1.400	2.090	0,36	Quadgas Finance PLC 3,375 % fällig am 17.09.2029	800	862	0,15
Bunzl Finance PLC 1,500 % fällig am 30.10.2030	1.000	979	0,17	Legal & General Group PLC 4,500 % fällig am 01.11.2050 5,375 % fällig am 27.10.2045 5,500 % fällig am 27.06.2064 5,625 % fällig am 24.03.2031 (d)(f)	800 1.600 750 700	922 1.846 955 786	0,16 0,31 0,16 0,13	RHP Finance PLC 3,250 % fällig am 05.02.2048	350	421	0,07
Burberry Group PLC 1,125 % fällig am 21.09.2025	800	799	0,14	Lloyds Banking Group PLC 3,574 % fällig am 07.11.2028	\$ 3.200	2.535	0,43	Riverside Finance PLC 3,875 % fällig am 05.12.2044	300	402	0,07
Cadent Finance PLC 2,625 % fällig am 22.09.2038 2,750 % fällig am 22.09.2046	2.200 700	2.289 734	0,39 0,12	London & Quadrant Housing Trust 2,000 % fällig am 20.10.2038	£ 2.700	2.696	0,46	RL Finance Bonds No. 4 PLC 4,875 % fällig am 07.10.2049	800	916	0,16
Centrica PLC 4,250 % fällig am 12.09.2044	200	259	0,04	London Power Networks PLC 5,125 % fällig am 31.03.2023 6,125 % fällig am 07.06.2027	150 300	162 383	0,03 0,07	Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 600	563	0,10
Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 1.400	1.213	0,21	M&G PLC 6,250 % fällig am 20.10.2068	1.850	2.452	0,42	Sage Group PLC 1,625 % fällig am 25.02.2031	£ 800	784	0,13
Clarion Funding PLC 2,625 % fällig am 18.01.2029 3,125 % fällig am 19.04.2048	£ 1.400 300	1.527 363	0,26 0,06	Manchester Airport Group Funding PLC 2,875 % fällig am 31.03.2039 2,875 % fällig am 30.09.2044 4,750 % fällig am 31.03.2034	235 900 400	241 908 499	0,04 0,15 0,08	Santander UK Group Holdings PLC 3,625 % fällig am 14.01.2026 4,750 % fällig am 15.09.2025 7,375 % fällig am 24.06.2022 (d)(f)	600 \$ 1.600 £ 1.200	660 1.302 1.269	0,11 0,22 0,22
Compass Group PLC 2,000 % fällig am 03.07.2029	700	739	0,13	Mitchells & Butlers Finance PLC 0,569 % fällig am 15.12.2030 5,965 % fällig am 15.12.2025 6,013 % fällig am 15.12.2030 6,469 % fällig am 15.09.2032	\$ 1.527 £ 190 468 200	1.051 199 517 229	0,18 0,03 0,09 0,04	Santander UK PLC 5,750 % fällig am 02.03.2026	200	247	0,04
Direct Line Insurance Group PLC 4,000 % fällig am 05.06.2032 9,250 % fällig am 27.04.2042	800 198	902 212	0,15 0,04	Morhomes PLC 3,400 % fällig am 19.02.2040	2.000	2.259	0,39	Scotland Gas Networks PLC 4,875 % fällig am 21.12.2034	300	396	0,07
Eastern Power Networks PLC 1,875 % fällig am 01.06.2035	900	894	0,15	Motability Operations Group PLC 5,625 % fällig am 29.11.2030	100	137	0,02	Scottish Hydro Electric Transmission PLC 2,250 % fällig am 19.09.2035	3.500	3.588	0,61
EMH Treasury PLC 4,500 % fällig am 29.01.2044	300	424	0,07	National Grid Electricity Transmission PLC 1,125 % fällig am 07.07.2028	1.400	1.369	0,23	Scottish Widows Ltd. 7,000 % fällig am 16.06.2043	900	1.365	0,23
Ferguson Finance PLC 3,250 % fällig am 02.06.2030	\$ 400	313	0,05	National Grid Gas PLC 1,375 % fällig am 07.02.2031	800	764	0,13	Severn Trent Utilities Finance PLC 2,000 % fällig am 02.06.2040	600	594	0,10
Friends Life Holdings PLC 8,250 % fällig am 21.04.2022	£ 250	266	0,05	Nationwide Building Society 3,250 % fällig am 20.01.2028	450	511	0,09	Society of Lloyd's 4,750 % fällig am 30.10.2024 4,875 % fällig am 07.02.2047	1.000 800	1.109 924	0,19 0,16
Frontier Finance PLC 8,000 % fällig am 23.03.2022	413	422	0,07	Natwest Group PLC 2,359 % fällig am 22.05.2024 2,875 % fällig am 19.09.2026 3,125 % fällig am 28.03.2027 4,269 % fällig am 22.03.2025 4,445 % fällig am 08.05.2030 4,800 % fällig am 05.04.2026 5,076 % fällig am 27.01.2030 5,125 % fällig am 12.05.2027 (d)(f) 8,625 % fällig am 15.08.2021 (d)(f)	\$ 1.600 £ 500 900 \$ 1.600 200 600 900 £ 2.600 £ 2.900	1.194 532 969 1.257 166 498 773 2.806 2.119	0,20 0,09 0,17 0,21 0,03 0,08 0,13 0,48 0,36	SP Manweb PLC 4,875 % fällig am 20.09.2027	250	304	0,05
GlaxoSmithKline Capital PLC 1,625 % fällig am 12.05.2035 4,250 % fällig am 18.12.2045 5,250 % fällig am 19.12.2033	1.000 500 300	972 714 422	0,17 0,12 0,07	Network Rail Infrastructure Finance PLC 4,750 % fällig am 29.11.2035	£ 2.800	4.076	0,70	Standard Chartered PLC 1,214 % fällig am 23.03.2025 (g) 1,456 % fällig am 14.01.2027	\$ 300 700	218 503	0,04 0,09
Grainger PLC 3,000 % fällig am 03.07.2030 3,375 % fällig am 24.04.2028	1.085 1.950	1.148 2.113	0,20 0,36					Student Finance PLC 2,666 % fällig am 30.09.2029	£ 500	507	0,09
Greene King Finance PLC 3,593 % fällig am 15.03.2035 4,064 % fällig am 15.03.2035 5,106 % fällig am 15.03.2034 5,318 % fällig am 15.09.2031	390 232 600 1.793	413 254 695 2.076	0,07 0,04 0,12 0,35					Telereal Secured Finance PLC 4,010 % fällig am 10.12.2033	1.127	1.260	0,21
								Telereal Securitisation PLC 4,974 % fällig am 10.12.2033	364	413	0,07
								Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,375 % fällig am 27.07.2029	€ 900	755	0,13
								Tesco Property Finance PLC 5,411 % fällig am 13.07.2044 5,661 % fällig am 13.10.2041 5,744 % fällig am 13.04.2040 5,801 % fällig am 13.10.2040	£ 3.367 880 854 1.164	4.418 1.181 1.147 1.565	0,75 0,20 0,20 0,27

Aufstellung der Wertpapieranlagen UK Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	
6,052 % fällig am 13.10.2039	£	2.285	0,52	Precise Mortgage Funding PLC	£	93	0,02	Digital Stout Holding LLC	£	816	0,15	
Thames Water Utilities Finance PLC				0,734 % fällig am 12.12.2054				3,300 % fällig am 19.07.2029				
2,625 % fällig am 24.01.2032	900	957	0,16	Residential Mortgage Securities PLC				Entergy Corp.				
3,500 % fällig am 25.02.2028	1.000	1.118	0,19	1,031 % fällig am 20.12.2046	136	136	0,02	2,800 % fällig am 15.06.2030	\$	400	0,05	
5,500 % fällig am 11.02.2041	100	149	0,03	1,281 % fällig am 20.09.2065	138	139	0,02	Fidelity National Information Services, Inc.				
TP ICAP Ltd.				1,299 % fällig am 20.06.2070	1.587	1.603	0,27	3,360 % fällig am 21.05.2031	£	400	0,08	
5,250 % fällig am 26.01.2024	1.000	1.099	0,19	Ripon Mortgages PLC				Fiserv, Inc.				
5,250 % fällig am 29.05.2026	950	1.087	0,19	0,881 % fällig am 20.08.2056	122	122	0,02	3,000 % fällig am 01.07.2031		791	0,15	
Travis Perkins PLC				RMAC PLC				Ford Motor Credit Co. LLC				
4,500 % fällig am 07.09.2023	1.600	1.711	0,29	0,784 % fällig am 12.06.2046	1.904	1.906	0,32	2,748 % fällig am 14.06.2024	1.200	1.219	0,21	
Unique Pub Finance Co. PLC				1,054 % fällig am 12.06.2046	913	918	0,16	4,535 % fällig am 06.03.2025	1.550	1.664	0,28	
5,659 % fällig am 30.06.2027	1.717	1.936	0,33	Silverstone Master Issuer PLC				Gap, Inc.				
7,395 % fällig am 28.03.2024	500	535	0,09	0,799 % fällig am 21.01.2070	264	267	0,05	8,875 % fällig am 15.05.2027	\$	1.050	0,15	
UNITE Group PLC				Stratton Mortgage Funding PLC				General Electric Co.				
3,500 % fällig am 15.10.2028	969	1.079	0,18	0,948 % fällig am 20.07.2060	1.848	1.855	0,32	5,250 % fällig am 07.12.2028	£	1.189	0,25	
Virgin Media Secured Finance PLC				Towd Point Mortgage Funding PLC				5,375 % fällig am 18.12.2040	100	141	0,02	
4,250 % fällig am 15.01.2030	1.500	1.499	0,26	1,111 % fällig am 20.10.2051	2.391	2.404	0,41	GlaxoSmithKline Capital, Inc.				
Virgin Money UK PLC				Twin Bridges PLC				4,200 % fällig am 18.03.2043	\$	1.900	0,29	
3,125 % fällig am 22.06.2025	200	210	0,04	0,899 % fällig am 12.03.2055	1.700	1.712	0,29	Goldman Sachs Group, Inc.				
3,375 % fällig am 24.04.2026	500	532	0,09			27.904	4,76	1,500 % fällig am 07.12.2027	£	1.800	0,31	
4,000 % fällig am 25.09.2026	1.300	1.424	0,24					1,875 % fällig am 16.12.2030	2.700	2.708	0,46	
4,000 % fällig am 03.09.2027	865	960	0,16					3,125 % fällig am 25.07.2029	800	890	0,15	
5,125 % fällig am 11.12.2030	300	335	0,06					4,250 % fällig am 29.01.2026	1.000	1.136	0,19	
7,875 % fällig am 14.12.2028	500	573	0,10					7,250 % fällig am 10.04.2028	800	1.093	0,19	
Vodafone Group PLC								Jersey Central Power & Light Co.				
3,000 % fällig am 12.08.2056	100	108	0,02					2,750 % fällig am 01.03.2032	\$	100	0,01	
3,375 % fällig am 08.08.2049	1.300	1.505	0,26					JPMorgan Chase & Co.				
Western Power Distribution East Midlands PLC								1,895 % fällig am 28.04.2033	£	1.100	1,109	0,19
6,250 % fällig am 10.12.2040	300	489	0,08					3,882 % fällig am 24.07.2038	\$	200	0,03	
Western Power Distribution South Wales PLC								4,203 % fällig am 23.07.2029	700	583	0,10	
5,750 % fällig am 23.03.2040	850	1.304	0,22					Kellogg Co.				
Western Power Distribution West Midlands PLC								0,500 % fällig am 20.05.2029	€	300	258	0,04
5,750 % fällig am 16.04.2032	900	1.242	0,21					Kraft Heinz Foods Co.				
Workspace Group PLC								4,125 % fällig am 01.07.2027	£	500	561	0,10
2,250 % fällig am 11.03.2028	1.000	996	0,17					Liberty Utilities Finance GP				
		178.857	30,51					2,050 % fällig am 15.09.2030	\$	900	629	0,11
								MassMutual Global Funding				
								1,375 % fällig am 15.12.2026	£	1.000	1.023	0,17
								Metropolitan Life Global Funding				
								1,625 % fällig am 24.03.2026	600	613	0,10	
								3,500 % fällig am 30.09.2026	940	1.059	0,18	
								MPT Operating Partnership LP				
								2,500 % fällig am 21.09.2029	4.300	4.387	0,75	
								2,550 % fällig am 05.12.2023	3.000	3.084	0,53	
								3,692 % fällig am 05.06.2028	1.500	1.601	0,27	
								Netflix, Inc.				
								3,625 % fällig am 15.06.2030	€	900	920	0,16
								3,875 % fällig am 15.11.2029	800	828	0,14	
								4,875 % fällig am 15.06.2030	\$	100	86	0,02
								New York Life Global Funding				
								1,250 % fällig am 17.12.2026	£	500	507	0,09
								NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
								1,900 % fällig am 15.06.2028	\$	200	147	0,03
								Oracle Corp.				
								4,500 % fällig am 08.07.2044	900	764	0,13	
								Pfizer, Inc.				
								2,735 % fällig am 15.06.2043	£	1.000	1.140	0,19
								Physicians Realty LP				
								4,300 % fällig am 15.03.2027	\$	100	82	0,01
								Prologis LP				
								2,250 % fällig am 30.06.2029	£	500	534	0,09
								Realty Income Corp.				
								1,625 % fällig am 15.12.2030	800	793	0,14	
								Skyworks Solutions, Inc.				
								3,000 % fällig am 01.06.2031	\$	100	74	0,01
								Southern California Edison Co.				
								6,650 % fällig am 01.04.2029	300	271	0,05	
								T-Mobile USA, Inc.				
								3,875 % fällig am 15.04.2030	600	487	0,08	
								Time Warner Cable LLC				
								5,250 % fällig am 15.07.2042	£	2.000	2.678	0,46
								Union Electric Co.				
								2,625 % fällig am 15.03.2051	\$	1.300	903	0,15
								VEREIT Operating Partnership LP				
								2,850 % fällig am 15.12.2032	400	303	0,05	

Aufstellung der Wertpapieranlagen UK Corporate Bond Fund (Forts.)

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	15.09.2026	£ 66.200	£ (41)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	12.700	76	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	\$ 6.000	252	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	21.06.2022	29.000	(1.119)	(0,19)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	9.200	214	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050	1.100	164	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	9.300	(206)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	17.06.2050	900	152	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.02.2045	2.100	77	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	12.03.2050	600	(48)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 3.200	7	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	100	0	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2023	18.700	8	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	7.600	49	0,01
					£ (453)	(0,08)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					£ (553)	(0,09)

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSoPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850 %	20.10.2021	2.700	£ (2)	£ (1)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
JPM	Hochtief AG	5,000 %	20.12.2025	€ 1.100	£ 186	£ (13)	£ 173	0,03

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettver- mögens
BOA	08.2021	\$ 575	£ 407	£ 0	£ (9)	£ (9)	0,00
BPS	08.2021	€ 1.258	1.081	0	0	0	0,00
GLM	08.2021	AUD 7.649	4.156	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	€ 74.551	64.057	6	0	6	0,00
	08.2021	£ 569	€ 659	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	1.796	NOK 21.135	0	(18)	(18)	0,00
HUS	08.2021	€ 1.116	£ 955	0	(4)	(4)	0,00
	08.2021	£ 1.791	\$ 2.530	40	0	40	0,01
	08.2021	\$ 96.054	£ 67.947	0	(1.577)	(1.577)	(0,27)
JPM	08.2021	3.001	2.159	0	(12)	(12)	0,00
MYI	08.2021	€ 2.963	2.546	1	0	1	0,00
	08.2021	£ 4.200	AUD 7.634	0	(51)	(51)	(0,01)
RBC	08.2021	745	€ 865	0	(2)	(2)	0,00
SCX	08.2021	1.066	1.236	0	(4)	(4)	0,00
	08.2021	6.049	\$ 8.388	23	0	23	0,00
	09.2021	\$ 23	CNH 150	0	0	0	0,00
SSB	08.2021	£ 1.837	NZD 3.598	0	(18)	(18)	0,00
	08.2021	NZD 3.601	£ 1.812	0	(9)	(9)	0,00
	08.2021	\$ 1.447	1.020	0	(27)	(27)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
UAG	08.2021	€ 1.869	£ 1.617	£ 11	£ 0	£ 11	0,00
				£ 81	£ (1.735)	£ (1.654)	(0,28)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						£ (1.482)	(0,25)
Summe Anlagen						£ 595.332	101,57
Sonstige Aktiva und Passiva						£ (9.181)	(1,57)
Nettovermogen						£ 586.151	100,00

ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.
 (b) Nullkuponwertpapier.
 (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
 (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.
 (e) Mit dem Fonds verbunden.
 (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (g) Eingeschrankte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Falligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Standard Chartered PLC	1,214 %	23.03.2025	16.03.2021	£ 216	£ 218	0,04

(h) Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 33.863 als Sicherheiten verpfandet.

(i) Gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 1.276 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 541 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Hohe von GBP 9.155 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Bewertung zum Marktwert¹

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 546.953	£ 0	£ 546.953
Investmentfonds	213	38.305	0	38.518
Pensionsgeschafte	0	11.700	0	11.700
Finanzderivate ⁽³⁾	259	(2.098)	0	(1.839)
Summen	£ 472	£ 594.860	£ 0	£ 595.332

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 710.572	£ 1.883	£ 712.455
Investmentfonds	223	37.965	0	38.188
Pensionsgeschafte	0	46.150	0	46.150
Finanzderivate ⁽³⁾	131	1.459	0	1.590
Summen	£ 354	£ 796.146	£ 1.883	£ 798.383

⁽¹⁾ Zwecks zusatzlicher Informationen siehe Erlauterung 3 in den Erlauterungen zum Abschluss.

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschafte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Falligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschaften	% des Nettovermogens
MEI	0,090 %	13.05.2021	12.08.2021	£ (33.643)	£ (33.647)	(5,74)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschafte					£ (33.647)	(5,74)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	£ (9)	£ 0	£ (9)
BRC	(1)	0	(1)
GLM	(16)	0	(16)
HUS	(1.541)	1.276	(265)
JPM	161	0	161
MYI	(50)	0	(50)
RBC	(2)	0	(2)
SCX	19	0	19
SSB	(54)	0	(54)
UAG	11	0	11

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	88,07	90,14
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	5,24	2,82
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,25
Investmentfonds	6,57	4,99
Pensionsgeschäfte	2,00	6,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,03	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,09)	(0,26)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,25)	0,45
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(5,74)	(6,60)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Australien	0,33	0,11
Osterreich	0,20	0,22
Belgien	0,40	0,79
Brasilien	0,29	0,17
Kanada	0,30	0,38
Cayman Inseln	0,40	0,30
Chile	k. A.	0,17
Dänemark	0,36	0,46
Finnland	0,31	0,18
Frankreich	4,70	5,08
Deutschland	1,94	2,35
Guernsey, Kanalinseln	0,29	0,07
Indien	0,04	0,03
Irland	1,26	1,08
Insel Man	0,13	0,10
Italien	3,01	2,05
Japan	0,37	0,38
Jersey, Kanalinseln	3,12	3,05
Luxemburg	2,38	2,67
Mauritius	0,31	0,11
Niederlande	6,71	8,20
Norwegen	0,21	0,31
Singapur	0,41	0,39
Slowenien	0,13	0,10
Südkorea	0,06	k. A.
Spanien	1,76	2,54
Supranational	3,26	2,60
Schweden	0,10	0,07
Schweiz	2,34	2,02
Großbritannien	41,17	42,82
USA	13,95	14,41
Kurzfristige Instrumente	3,07	k. A.
Investmentfonds	6,57	4,99
Pensionsgeschäfte	2,00	6,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,03	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	(0,08)	(0,20)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,28)	0,46
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,57)	(4,45)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
AUSTRALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
APT Pipelines Ltd. 2,500 % fällig am 15.03.2036	£ 1.100	£ 1.113	0,27
3,500 % fällig am 22.03.2030	100	112	0,03
Summe Australien		1.225	0,30
ÖSTERREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
CA Immobilien Anlagen AG 1,000 % fällig am 27.10.2025	€ 200	175	0,04
Erste Group Bank AG 8,875 % fällig am 15.10.2021 (c)(e)	200	176	0,05
IMMOFINANZ AG 2,500 % fällig am 15.10.2027	100	89	0,02
Summe Österreich		440	0,11
BELGIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Anheuser-Busch InBev S.A. 2,850 % fällig am 25.05.2037	£ 1.100	1.208	0,29
BERMUDAS			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Hiscox Ltd. 6,125 % fällig am 24.11.2045	800	928	0,22
BRASILIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Klabi Austria GmbH 3,200 % fällig am 12.01.2031	\$ 500	356	0,08
Petrobras Global Finance BV 5,375 % fällig am 01.10.2029	£ 100	110	0,03
Summe Brasilien		466	0,11
CAYMAN INSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Trafford Centre Finance Ltd. 0,811 % fällig am 28.07.2038	1.350	1.171	0,29
7,030 % fällig am 28.01.2029	1.097	1.208	0,29
Summe Cayman Inseln		2.379	0,58
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Nykredit Realkredit A/S 0,375 % fällig am 17.01.2028	€ 100	85	0,02
Orsted A/S 2,500 % fällig am 16.05.2033	£ 200	218	0,05
4,875 % fällig am 12.01.2032	100	131	0,03
Summe Dänemark		434	0,10
FINNLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Kemira Oyj 1,000 % fällig am 30.03.2028	€ 700	601	0,15
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AXA S.A. 1,375 % fällig am 07.10.2041	100	86	0,02
5,453 % fällig am 04.03.2026 (c)	£ 600	695	0,17
5,625 % fällig am 16.01.2054	100	128	0,03
BNP Paribas S.A. 1,250 % fällig am 13.07.2031	100	94	0,02
4,625 % fällig am 25.02.2031 (c)(e)	\$ 1.000	755	0,18
BPCE S.A. 5,250 % fällig am 16.04.2029	£ 100	124	0,03
Electricite de France S.A. 2,625 % fällig am 01.12.2027 (c)	€ 3.000	2.593	0,63
5,125 % fällig am 22.09.2050	£ 3.550	5.525	1,34
5,500 % fällig am 27.03.2037	3.000	4.289	1,04
5,500 % fällig am 17.10.2041	1.000	1.496	0,36

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
6,000 % fällig am 22.01.2114	\$ 1.700	£ 1.749	0,43
6,000 % fällig am 23.01.2114	£ 400	716	0,17
6,125 % fällig am 02.06.2034	100	146	0,04
La Mondiale SAM 2,125 % fällig am 23.06.2031	€ 200	181	0,04
Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal 2,125 % fällig am 21.06.2052	600	520	0,13
Orange S.A. 5,500 % fällig am 06.02.2044	\$ 1.300	1.309	0,32
5,625 % fällig am 23.01.2034	£ 100	142	0,04
Peugeot Invest 1,875 % fällig am 30.10.2026	€ 500	452	0,11
Societe Generale S.A. 7,375 % fällig am 13.09.2021 (c)(e)	\$ 300	220	0,05
Summe Frankreich		21.220	5,15
STAATSEMISSIONEN			
SNCF Réseau 5,000 % fällig am 11.03.2052	£ 500	865	0,21
5,250 % fällig am 31.01.2035	100	146	0,04
		1.011	0,25
Summe Frankreich		22.231	5,40
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	€ 400	349	0,09
1,875 % fällig am 22.12.2028	£ 1.200	1.199	0,29
3,547 % fällig am 18.09.2031	\$ 2.000	1.543	0,38
5,625 % fällig am 19.05.2031	€ 500	509	0,12
Deutsche Telekom AG 3,125 % fällig am 06.02.2034	£ 100	113	0,03
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % Bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (a)	€ 200	175	0,04
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % fällig am 15.09.2026	£ 4.000	4.062	0,99
5,750 % fällig am 07.06.2032	400	594	0,14
Schaeffler AG 2,750 % fällig am 12.10.2025	€ 300	275	0,07
Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	100	89	0,02
Summe Deutschland		8.908	2,17
STAATSEMISSIONEN			
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2030 (b)	100	89	0,02
Summe Deutschland		8.997	2,19
GUERNSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	200	186	0,04
HONGKONG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 1,697 % fällig am 25.05.2023	\$ 200	145	0,04
INDIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	200	155	0,04
IRLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
CCEP Finance Ireland DAC 1,500 % fällig am 06.05.2041	€ 1.100	953	0,23
ESB Finance DAC 1,875 % fällig am 21.07.2035	£ 300	303	0,07
GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 18.01.2033	2.950	4.051	0,99
Permanent TSB Group Holdings PLC 2,125 % fällig am 26.09.2024	€ 1.000	876	0,21

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. 3,000 % fällig am 19.04.2051	\$ 200	£ 144	0,04
Summe Irland		6.327	1,54
ITALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aeroporti di Roma SpA 1,750 % fällig am 30.07.2031	€ 100	90	0,02
5,441 % fällig am 20.02.2023	£ 300	321	0,08
AMCO - Asset Management Co. SpA 0,750 % fällig am 20.04.2028	€ 300	257	0,06
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	1.700	1.504	0,37
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % fällig am 28.04.2025	1.200	1.048	0,25
Enel SpA 5,750 % fällig am 22.06.2037	£ 900	1.309	0,32
Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % fällig am 16.03.2028	€ 500	432	0,11
Nexi SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026	400	342	0,08
2,125 % fällig am 30.04.2029	400	340	0,08
Telecom Italia SpA 5,875 % fällig am 19.05.2023	£ 100	108	0,03
UniCredit SpA 6,750 % fällig am 10.09.2021 (c)(e)	€ 700	608	0,15
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 900	755	0,18
Summe Italien		7.114	1,73
STAATSEMISSIONEN			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,500 % fällig am 30.04.2045	€ 900	751	0,18
Italy Government International Bond 6,000 % fällig am 04.08.2028	£ 100	129	0,03
		880	0,21
Summe Italien		7.994	1,94
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
East Japan Railway Co. 4,500 % fällig am 25.01.2036	100	135	0,03
JERSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AA Bond Co. Ltd. 2,750 % fällig am 31.07.2043	1.100	1.118	0,27
4,875 % fällig am 31.07.2043	1.900	2.025	0,49
5,500 % fällig am 31.07.2050	380	421	0,10
Gatwick Funding Ltd. 3,125 % fällig am 28.09.2041	1.200	1.239	0,30
Heathrow Funding Ltd. 2,750 % fällig am 13.10.2031	400	417	0,10
4,625 % fällig am 31.10.2046	3.527	4.646	1,13
5,875 % fällig am 13.05.2043	750	1.097	0,27
6,450 % fällig am 10.12.2031	200	275	0,07
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig am 05.11.2031 (c)	2.121	3.000	0,73
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,950 % fällig am 30.06.2022	119	122	0,03
Summe Jersey, Kanalinseln		14.360	3,49
LUXEMBURG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Acef Holding S.C.A. 0,750 % fällig am 14.06.2028	€ 400	343	0,08
Aroundtown S.A. 3,000 % fällig am 16.10.2029	£ 300	321	0,08
3,625 % fällig am 10.04.2031	1.550	1.724	0,42
Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 1.200	1.022	0,25
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 2,625 % fällig am 17.10.2034	£ 1.350	1.401	0,34

Aufstellung der Wertpapieranlagen UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 22.01.2028	£ 1.500	£ 1.537	0,37	SPANIEN				BG Energy Capital PLC 5,000 % fällig am 04.11.2036	£ 100	140	0,03
Summe Luxemburg		6.348	1,54	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Blend Funding PLC 3,459 % fällig am 21.09.2049	100	125	0,03
MAURITIUS				Abertis Infraestructuras S.A. 3,375 % fällig am 27.11.2026	£ 2.200	£ 2.387	0,58	BPHA Finance PLC 4,816 % fällig am 11.04.2044	495	728	0,18
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (c)(e)	€ 200	186	0,05	British Land Co. PLC 2,375 % fällig am 14.09.2029	£ 600	£ 615	0,15
Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026	\$ 700	547	0,13	6,000 % fällig am 15.01.2026 (c)(e)	600	590	0,14	5,264 % fällig am 24.09.2035	300	394	0,10
MEXIKO				Banco Santander S.A. 6,750 % fällig am 25.04.2022 (c)(e)	200	179	0,05	British Telecommunications PLC 3,125 % fällig am 21.11.2031	100	108	0,03
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				CaixaBank S.A. 6,000 % fällig am 18.07.2022 (c)(e)	200	179	0,04	3,625 % fällig am 22.11.2047	300	344	0,08
America Movil S.A.B. de C.V. 4,375 % fällig am 07.08.2041	£ 488	635	0,16	Summe Spanien		3.521	0,86	6,375 % fällig am 23.06.2037	250	372	0,09
4,948 % fällig am 22.07.2033	100	131	0,03	SUPRANATIONAL				Broadgate Financing PLC 4,999 % fällig am 05.10.2033	600	692	0,17
Summe Mexiko		766	0,19	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,098 % fällig am 05.04.2035	91	106	0,03
NIEDERLANDE				Europäische Investitionsbank				Bunzl Finance PLC 1,500 % fällig am 30.10.2030	100	98	0,02
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,875 % fällig am 08.06.2037	£ 300	414	0,10	Cadent Finance PLC 2,625 % fällig am 22.09.2038	3.100	3.225	0,78
ABN AMRO Bank NV 4,375 % fällig am 22.09.2025 (c)(e)	€ 500	465	0,11	5,625 % fällig am 07.06.2032	200	295	0,07	2,750 % fällig am 22.09.2046	1.300	1.363	0,33
Coöperatieve Rabobank UA 3,100 % fällig am 29.06.2028 (c)(e)	200	174	0,04	6,000 % fällig am 07.12.2028	2.100	2.888	0,70	Catalyst Housing Ltd. 3,125 % fällig am 31.10.2047	1.100	1.312	0,32
4,625 % fällig am 23.05.2029	£ 200	239	0,06	Europäische Union				Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge 2,350 % fällig am 27.06.2078	200	275	0,07
5,250 % fällig am 14.09.2027	850	1.025	0,25	0,000 % fällig am 04.10.2030 (b)	€ 200	172	0,04	Chanel Ceres PLC 1,000 % fällig am 31.07.2031	€ 900	777	0,19
CTP NV 1,250 % fällig am 21.06.2029	€ 500	425	0,10	Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 0,100 % fällig am 17.09.2035	1.200	998	0,25	Citizen Treasury PLC 3,250 % fällig am 20.10.2048	£ 800	991	0,24
E.ON International Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034	£ 4.300	5.508	1,34	Summe supranational		4.767	1,16	Clarion Funding PLC 1,250 % fällig am 13.11.2032	100	96	0,02
5,875 % fällig am 30.10.2037	300	442	0,11	SCHWEDEN				1,875 % fällig am 22.01.2035	1.400	1.409	0,34
6,125 % fällig am 06.07.2039	1.050	1.621	0,39	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,125 % fällig am 19.04.2048	2.350	2.845	0,69
6,375 % fällig am 07.06.2032	615	873	0,21	Investor AB 5,500 % fällig am 05.05.2037	£ 400	588	0,14	Direct Line Insurance Group PLC 4,000 % fällig am 05.06.2032	300	338	0,08
6,650 % fällig am 30.04.2038	\$ 700	739	0,18	SCHWEIZ				Drax Finco PLC 6,625 % fällig am 01.11.2025	\$ 200	150	0,04
Enel Finance International NV 0,875 % fällig am 17.06.2036	€ 1.500	1.280	0,31	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Eastern Power Networks PLC 1,875 % fällig am 01.06.2035	£ 100	99	0,02
5,750 % fällig am 14.09.2040	£ 3.763	5.700	1,39	Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (e)	\$ 200	160	0,04	EMH Treasury PLC 4,500 % fällig am 29.01.2044	800	1.131	0,27
Global Switch Finance BV 1,375 % fällig am 07.10.2030	€ 100	88	0,02	Credit Suisse Group AG 3,091 % fällig am 14.05.2032	500	373	0,09	Eversholt Funding PLC 3,529 % fällig am 07.08.2042	1.000	1.123	0,27
JAB Holdings BV 2,250 % fällig am 19.12.2039	800	723	0,18	4,194 % fällig am 01.04.2031	250	203	0,05	Frontier Finance PLC 8,000 % fällig am 23.03.2022	525	537	0,13
JDE Peet's NV 1,125 % fällig am 16.06.2033	400	344	0,08	6,250 % fällig am 18.12.2024 (c)(e)	400	318	0,08	Futures Treasury PLC 3,375 % fällig am 08.02.2044	800	995	0,24
LafargeHolcim Sterling Finance Netherlands BV 3,000 % fällig am 12.05.2032	£ 300	327	0,08	7,125 % fällig am 29.07.2022 (c)(e)	200	151	0,04	GlaxoSmithKline Capital PLC 5,250 % fällig am 19.12.2033	200	282	0,07
Stichting AK Rabobank Certificaten 2,188 % (c)	€ 2.381	2.756	0,67	7,500 % fällig am 17.07.2023 (c)(e)	600	474	0,11	5,250 % fällig am 10.04.2042	100	155	0,04
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	600	574	0,14	7,500 % fällig am 11.12.2023 (c)(e)	2.000	1.609	0,39	6,375 % fällig am 09.03.2039	600	996	0,24
Volkswagen Financial Services NV 0,875 % fällig am 20.02.2025	£ 800	799	0,19	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (e)	300	240	0,06	Grainger PLC 3,000 % fällig am 03.07.2030	2.600	2.751	0,67
1,125 % fällig am 18.09.2023	100	101	0,03	UBS Group AG 3,126 % fällig am 13.08.2030	200	155	0,04	3,375 % fällig am 24.04.2028	200	217	0,05
Volkswagen International Finance NV 3,875 % fällig am 17.06.2029 (c)	€ 600	573	0,14	4,375 % fällig am 10.02.2031 (c)(e)	1.200	890	0,21	Great Places Housing Group Ltd. 4,750 % fällig am 22.10.2042	1.600	2.306	0,56
Summe Niederlande		24.776	6,02	5,125 % fällig am 29.07.2026 (c)(e)	300	237	0,06	Greene King Finance PLC 3,593 % fällig am 15.03.2035	779	826	0,20
STAATSEMISSIONEN				Summe Schweiz		4.810	1,17	4,064 % fällig am 15.03.2035	310	340	0,08
Niederlandse Waterschapsbank NV 5,375 % fällig am 07.06.2032	£ 500	719	0,17	GROSSBRITANNIEN				5,106 % fällig am 15.03.2034	2.424	2.808	0,68
Summe Niederlande		25.495	6,19	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,318 % fällig am 15.09.2031	2.401	2.780	0,68
NORWEGEN				3i Group PLC 3,750 % fällig am 05.06.2040	£ 1.400	1.598	0,39	Guinness Partnership Ltd. 2,000 % fällig am 22.04.2055	1.000	1.010	0,25
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Annington Funding PLC 3,685 % fällig am 12.07.2034	2.200	2.553	0,62	High Speed Rail Finance PLC 4,375 % fällig am 01.11.2038	900	1.138	0,28
Aker BP ASA 3,750 % fällig am 15.01.2030	\$ 350	274	0,07	3,935 % fällig am 12.07.2047	1.200	1.507	0,37	Home Group Ltd. 3,125 % fällig am 27.03.2043	1.500	1.735	0,42
Equinor ASA 6,875 % fällig am 11.03.2031	£ 100	148	0,03	Arqiva Financing PLC 4,882 % fällig am 31.12.2032	612	715	0,17	HSBC Bank PLC 4,750 % fällig am 24.03.2046	3.400	4.745	1,15
Summe Norwegen		422	0,10	5,340 % fällig am 30.12.2037	100	125	0,03	5,375 % fällig am 22.08.2033	600	808	0,20
SINGAPUR				Aviva PLC 4,000 % fällig am 03.06.2055	1.000	1.117	0,27	HSBC Holdings PLC 1,750 % fällig am 24.07.2027	1.200	1.214	0,30
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Babcock International Group PLC 1,875 % fällig am 05.10.2026	200	200	0,05	3,000 % fällig am 29.05.2030	300	324	0,08
Temasek Financial Ltd. 5,125 % fällig am 26.07.2040	1.250	1.962	0,48	Barclays PLC 7,125 % fällig am 15.06.2025 (c)(e)	400	458	0,11	4,600 % fällig am 17.12.2030 (c)(e)	\$ 200	151	0,04
				7,250 % fällig am 15.03.2023 (c)(e)	400	432	0,11	4,950 % fällig am 31.03.2030	200	175	0,04
				7,875 % fällig am 15.09.2022 (c)(e)	525	564	0,14	5,875 % fällig am 28.09.2026 (c)(e)	£ 200	225	0,05
				8,000 % fällig am 15.06.2024 (c)(e)	\$ 800	659	0,16	6,000 % fällig am 29.03.2040	600	866	0,21
								Informa PLC 2,125 % fällig am 06.10.2025	€ 100	91	0,02
								3,125 % fällig am 05.07.2026	£ 400	427	0,10
								InterContinental Hotels Group PLC 2,125 % fällig am 24.08.2026	800	815	0,20

Aufstellung der Wertpapieranlagen UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL														
Alexandria Real Estate Equities, Inc. 2,000 % fällig am 18.05.2032	\$	800	£ 565	0,14	Ford Motor Credit Co. LLC 2,748 % fällig am 14.06.2024	£	800	£ 812	0,20	Pfizer, Inc. 2,735 % fällig am 15.06.2043	£	1.700	£ 1.9	0,47
American Tower Corp. 1,250 % fällig am 21.05.2033	€	1.700	1.483	0,36	4,535 % fällig am 06.03.2025	800	859	0,21	Time Warner Cable LLC 4,500 % fällig am 15.09.2042	\$	600	484	0,12	
Amgen, Inc. 4,563 % fällig am 15.06.2048	\$	700	638	0,15	Gap, Inc. 8,875 % fällig am 15.05.2027	\$	625	525	0,13	5,250 % fällig am 15.07.2042	£	2.636	3.530	0,86
Anheuser-Busch Cos. LLC 4,900 % fällig am 01.02.2046	700	642	0,16	General Electric Co. 5,375 % fällig am 18.12.2040	£	2.350	3.323	0,81	Union Electric Co. 2,625 % fällig am 15.03.2051	\$	700	486	0,12	
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,950 % fällig am 15.01.2042	1.500	1.378	0,33	GlaxoSmithKline Capital, Inc. 4,200 % fällig am 18.03.2043	\$	2.500	2.258	0,55	United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.04.2029	1.332	1.072	0,26		
Apple, Inc. 3,600 % fällig am 31.07.2042	£	100	135	0,03	6,375 % fällig am 15.05.2038	1.100	1.195	0,29	VEREIT Operating Partnership LP 2,850 % fällig am 15.12.2032	300	227	0,05		
AT&T, Inc. 3,550 % fällig am 15.09.2055	\$	300	218	0,05	Goldman Sachs Group, Inc. 4,411 % fällig am 23.04.2039	£	1.100	971	0,24	Verizon Communications, Inc. 1,875 % fällig am 03.11.2038	£	1.800	1.720	0,42
3,650 % fällig am 15.09.2059	165	121	0,03	7,250 % fällig am 10.04.2028	£	100	137	0,03	3,375 % fällig am 27.10.2036	1.500	1.744	0,42		
3,800 % fällig am 01.12.2057	1.204	910	0,22	Home Depot, Inc. 3,500 % fällig am 15.09.2056	\$	100	81	0,02	Walmart, Inc. 2,950 % fällig am 24.09.2049	\$	700	538	0,13	
4,250 % fällig am 01.06.2043	£	3.763	4.777	1,16	IPALCO Enterprises, Inc. 4,250 % fällig am 01.05.2030	100	82	0,02	3,950 % fällig am 28.06.2038	1.500	1.310	0,32		
4,375 % fällig am 14.09.2029	100	120	0,03	Jersey Central Power & Light Co. 2,750 % fällig am 01.03.2032	100	74	0,02	4,875 % fällig am 19.01.2039	£	100	150	0,04		
4,875 % fällig am 01.06.2044	2.038	2.823	0,69	JPMorgan Chase & Co. 1,895 % fällig am 28.04.2033	£	1.100	1.109	0,27	Wells Fargo & Co. 2,125 % fällig am 24.09.2031	100	102	0,02		
5,200 % fällig am 18.11.2033	1.050	1.391	0,34	3,882 % fällig am 24.07.2038	\$	200	167	0,04	4,625 % fällig am 02.11.2035	1.729	2.267	0,55		
7,000 % fällig am 30.04.2040	400	663	0,16	5,600 % fällig am 15.07.2041	300	305	0,07	4,875 % fällig am 29.11.2035	1.000	1.306	0,32			
Bank of America Corp. 2,676 % fällig am 19.06.2041	\$	900	633	0,15	Kinder Morgan, Inc. 5,050 % fällig am 15.02.2046	100	88	0,02	Welltower, Inc. 4,500 % fällig am 01.12.2034	400	491	0,12		
Berkshire Hathaway Finance Corp. 2,625 % fällig am 19.06.2059	£	100	116	0,03	McDonald's Corp. 5,875 % fällig am 23.04.2032	£	100	141	0,03			63.921	15,53	
Bristol-Myers Squibb Co. 4,125 % fällig am 15.06.2039	\$	100	88	0,02	Merck & Co., Inc. 3,700 % fällig am 10.02.2045	\$	300	251	0,06	NON-AGENCY-MBS				
Charter Communications Operating LLC 5,125 % fällig am 01.07.2049	700	605	0,15	Microsoft Corp. 2,525 % fällig am 01.06.2050	100	71	0,02	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 0,592 % fällig am 25.04.2035	\$	210	139	0,04		
Citigroup, Inc. 3,878 % fällig am 24.01.2039	1.900	1.589	0,39	2,675 % fällig am 01.06.2060	800	575	0,14	GSR Mortgage Loan Trust 2,793 % fällig am 25.09.2035	1	1	0,00			
4,412 % fällig am 31.03.2031	700	592	0,14	MidAmerican Energy Co. 4,250 % fällig am 15.07.2049	100	91	0,02	HomeBanc Mortgage Trust 1,097 % fällig am 25.07.2035	2.557	1.847	0,45			
4,500 % fällig am 03.03.2031	£	100	121	0,03	Mondelez International, Inc. 3,875 % fällig am 06.03.2045	£	100	120	0,03	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 0,513 % fällig am 15.12.2030	6	4	0,00	
4,650 % fällig am 30.07.2045	\$	300	280	0,07	MPT Operating Partnership LP 3,375 % fällig am 24.04.2030	3.400	3.521	0,85	Sequoia Mortgage Trust 2,731 % fällig am 20.07.2037 ^	12	8	0,00		
7,375 % fällig am 01.09.2039	£	100	181	0,04	3,692 % fällig am 05.06.2028	1.950	2.082	0,51			1.999	0,49		
Comcast Corp. 1,875 % fällig am 20.02.2036	500	496	0,12	National Fuel Gas Co. 2,950 % fällig am 01.03.2031	\$	200	146	0,03	Summe USA		65.979	16,03		
Community Preservation Corp. 2,867 % fällig am 01.02.2030	\$	1.300	984	0,24	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2030	€	600	613	0,15	Summe Übertragbare Wertpapiere	£	403.2	97,96	
CyrusOne LP 1,450 % fällig am 22.01.2027	€	100	88	0,02	3,875 % fällig am 15.11.2029	200	207	0,05						
Digital Stout Holding LLC 3,750 % fällig am 17.10.2030	£	200	229	0,06	4,875 % fällig am 15.06.2030	\$	600	518	0,13	AKTIEN				
Entergy Corp. 3,750 % fällig am 15.06.2050	\$	100	80	0,02	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	200	147	0,04	INVESTMENTFONDS					
Enterprise Products Operating LLC 4,800 % fällig am 01.02.2049	200	179	0,04	Northern States Power Co. 2,900 % fällig am 01.03.2050	400	297	0,07	BORSENGEHANDELTE FONDS						
Equinix, Inc. 1,000 % fällig am 15.03.2033	€	100	85	0,02	Oracle Corp. 4,500 % fällig am 08.07.2044	700	594	0,14	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)	13.500	1.153	0,28		
Fidelity National Information Services, Inc. 3,360 % fällig am 21.05.2031	£	800	902	0,22					Summe Investmentfonds	£	1.1	0,28		
Fiserv, Inc. 3,000 % fällig am 01.07.2031	1.900	2.084	0,51											

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2021	35	£ 2	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	81	(81)	(0,02)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2021	8	(24)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	78	(34)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2021	6	(5)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2021	700	640	0,16
				£ 498	0,12
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				£ 498	0,12

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Auchan Holding S.A.	1,000 %	20.12.2027	€ 100	£ 4	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	\$ 2.400	12	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	€ 200	(4)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	2.600	169	0,04
Stellantis NV	5,000	20.06.2026	500	1	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	1.200	3	0,00
				£ 185	0,05

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 35 5-Year Index	5,000 %	20.06.2026	€ 5.000	£ 10	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	1.600	3	0,00
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	26.800	6	0,00
				£ 19	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,250 %	15.09.2023	£ 12.700	£ 16	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	20.300	0	0,00
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2031	14.300	38	0,01
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	33.500	388	0,09
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	\$ 7.900	315	0,08
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	21.06.2022	19.600	99	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	2.900	123	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050	3.300	307	0,08
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	800	(50)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	6.400	276	0,07
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	16.01.2050	100	10	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.06.2047	1.300	134	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	18.12.2049	400	44	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	22.01.2050	100	11	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.02.2045	6.600	644	0,16
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.01.2050	100	11	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	12.03.2050	2.100	254	0,06
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2026	€ 2.700	(4)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2023	3.600	1	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	15.09.2051	5.700	21	0,01
					£ 2.638	0,64
					£ 2.842	0,69

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850 %	20.10.2021	4.800	£ (4)	£ (2)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

Aufstellung der Wertpapieranlagen UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Hochtief AG	5,000 %	20.12.2025	€ 500	£ 84	£ (6)	£ 78	0,02

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	08.2021	€ 1.286	£ 1.105	£ 0	£ 0	£ 0	0,00
	08.2021	\$ 1.175	844	0	(6)	(6)	0,00
BRC	08.2021	911	646	0	(14)	(14)	0,00
GLM	08.2021	AUD 4.621	2.511	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	€ 29.583	25.426	10	0	10	0,00
	08.2021	£ 428	€ 496	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	1.050	NOK 12.350	0	(11)	(11)	0,00
HUS	08.2021	€ 2.537	£ 2.185	5	0	5	0,00
	08.2021	£ 1.095	\$ 1.539	19	0	19	0,00
	08.2021	\$ 68.999	£ 48.809	0	(1.133)	(1.133)	(0,27)
JPM	08.2021	2.390	1.720	0	(10)	(10)	0,00
MYI	08.2021	€ 1.924	1.653	0	0	0	0,00
	08.2021	£ 2.537	AUD 4.612	0	(31)	(31)	(0,01)
RBC	08.2021	€ 3.034	£ 2.613	6	0	6	0,00
SCX	08.2021	£ 3.646	\$ 5.056	14	0	14	0,00
	09.2021	\$ 10	CNH 67	0	0	0	0,00
SSB	08.2021	£ 1.055	NZD 2.065	0	(10)	(10)	0,00
	08.2021	NZD 2.068	£ 1.041	0	(5)	(5)	0,00
				£ 54	£ (1.223)	£ (1.169)	(0,28)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						£ (1.093)	(0,26)
Summe Anlagen						£ 406.666	98,79
Sonstige Aktiva und Passiva						£ 4.993	1,21
Nettovermögen						£ 411.659	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^A Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 10.766 als Sicherheiten verpfändet.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 1.002 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von GBP 10.545 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert¹

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 403.266	£ 0	£ 403.266
Investmentfonds	1.153	0	0	1.153
Finanzderivate ⁽³⁾	537	1.710	0	2.247
Summen	£ 1.690	£ 404.976	£ 0	£ 406.666

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 408.579	£ 892	£ 409.471
Investmentfonds	1.205	5.603	0	6.808
Pensionsgeschäfte	0	5.260	0	5.260
Finanzderivate ⁽³⁾	362	2.676	0	3.038
Summen	£ 1.567	£ 422.118	£ 892	£ 424.577

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Netto- vermögens
BPS	0,100 %	16.06.2021	12.08.2021	£ (8.287)	£ (8.288)	(2,01)
MEI	0,020	16.06.2021	12.08.2021	(2.511)	(2.511)	(0,61)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					£ (10.799)	(2,62)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate £ (6)	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet £ 0	Netto- Engagement ⁽¹⁾ £ (6)
BPS	(16)	0	(16)
BRC	(4)	0	(4)
GLM	(1.109)	1.002	(107)
HUS	68	0	68
JPM	(31)	0	(31)
MYI	6	0	6
RBC	14	0	14
SCX	(15)	0	(15)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	95,52	108,26
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	2,44	3,79
Investmentfonds	0,28	1,87
Pensionsgeschäfte	k. A.	1,44
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,12	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,69	0,25
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,26)	0,49
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(2,62)	(19,32)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Australien	0,30	k. A.
Osterreich	0,11	0,23
Belgien	0,29	0,32
Bermudas	0,22	0,22
Brasilien	0,11	k. A.
Kanada	k. A.	0,07
Cayman Inseln	0,58	0,67
Dänemark	0,10	0,26
Finnland	0,15	0,15
Frankreich	5,40	5,64
Deutschland	2,19	4,69
Guernsey, Kanalinseln	0,04	0,43
Hongkong	0,04	0,04
Indien	0,04	0,04
Irland	1,54	1,54
Italien	1,94	1,82
Japan	0,03	k. A.
Jersey, Kanalinseln	3,49	3,17

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Luxemburg	1,54	1,29
Mauritius	0,13	0,15
Mexiko	0,19	0,19
Niederlande	6,19	6,53
Norwegen	0,10	0,08
Singapur	0,48	0,45
Spanien	0,86	2,80
Supranational	1,16	3,65
Schweden	0,14	0,17
Schweiz	1,17	0,37
Großbritannien	53,40	59,55
Vereinigte Staaten	16,03	17,77
Investmentfonds	0,28	1,87
Pensionsgeschäfte	k. A.	1,44
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,12	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,05	0,02
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,01
Zinsswaps	0,64	0,22
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,28)	0,50
Sonstige Aktiva und Passiva	1,21	(16,44)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG											
Brand Energy & Infrastructure Services, Inc. 5,250 % fällig am 21.06.2024	\$ 2.977	\$	0,07	4,250 % fällig am 20.09.2022	\$ 4.000	\$ 4.141	0,10	4,125 % fällig am 15.08.2030	\$ 2.500	\$ 2.574	0,06
Caesars Resort Collection LLC 2,854 % fällig am 23.12.2024	1.985	1.970	0,05	4,542 % fällig am 01.08.2026	2.000	2.181	0,05	4,250 % fällig am 01.12.2026	3.250	3.385	0,08
Dealer Tire LLC 4,354 % fällig am 12.12.2025	2.345	2.352	0,05	5,113 % fällig am 03.05.2029	3.000	3.363	0,08	4,625 % fällig am 01.12.2029	3.250	3.460	0,08
Diamond (BC) BV 3,147 % - 3,186 % fällig am 06.09.2024	8.873	8.836	0,21	5,125 % fällig am 16.06.2025	4.000	4.410	0,10	Voyager Aviation Holdings LLC 8,500 % fällig am 09.05.2026	1.805	1.654	0,04
Foundation Building Materials Holding Co. LLC 3,750 % fällig am 03.02.2028	4.800	4.773	0,11	5,584 % fällig am 18.03.2024	6.000	6.579	0,15				
Heartland Dental LLC 3,604 % fällig am 30.04.2025	6.450	6.386	0,15	5,596 % fällig am 07.01.2022	4.000	4.087	0,10				
iHeartCommunications, Inc. 3,104 % fällig am 01.05.2026	1.535	1.524	0,04	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			0,06	INDUSTRIEWERTE			
Intelsat Jackson Holdings S.A. 3,600 % - 6,500 % fällig am 13.07.2022	547	554	0,01	5,500 % fällig am 01.05.2028	2.500	2.606	0,06	24 Hour Fitness Worldwide, Inc. 8,000 % fällig am 01.06.2022 ^	9.500	25	0,00
IRB Holding Corp. 4,250 % fällig am 15.12.2027	1.995	1.996	0,05	6,500 % fällig am 01.10.2025	7.000	7.280	0,17	Academy Ltd. 6,000 % fällig am 15.11.2027	4.000	4.289	0,10
Serta Simmons Bedding LLC 4,500 % fällig am 08.11.2023	2.673	1.858	0,04	Getty Images, Inc. 9,750 % fällig am 01.03.2027	8.250	8.880	0,21	Acadia Healthcare Co., Inc. 5,500 % fällig am 01.07.2028	7.500	8.022	0,19
Starfruit Finco BV 2,843 % - 5,000 % fällig am 01.10.2025	2.891	2.873	0,07	Greystar Real Estate Partners LLC 5,750 % fällig am 01.12.2025	2.750	2.836	0,07	AdaptHealth LLC 4,625 % fällig am 01.08.2029	750	761	0,02
Surgery Center Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 31.08.2026	8.435	8.482	0,20	HAT Holdings LLC 3,750 % fällig am 15.09.2030	3.750	3.674	0,09	6,125 % fällig am 01.08.2028	3.000	3.199	0,08
Team Health Holdings, Inc. 3,750 % fällig am 06.02.2024	8.943	8.705	0,20	Howard Hughes Corp. 4,125 % fällig am 01.02.2029	4.500	4.514	0,11	Adient Global Holdings Ltd. 4,875 % fällig am 15.08.2026	7.750	7.986	0,19
Triton Water Holdings, Inc. 4,000 % fällig am 31.03.2028	2.500	2.501	0,06	4,375 % fällig am 01.02.2031	2.750	2.746	0,06	ADT Security Corp. 4,125 % fällig am 15.06.2023	3.750	3.952	0,09
Truck Hero, Inc. 4,500 % - 4,750 % fällig am 31.01.2028	1.895	1.898	0,04	5,375 % fällig am 01.08.2028	3.000	3.191	0,08	4,875 % fällig am 15.07.2032	5.000	5.287	0,12
Welbilt, Inc. 2,604 % fällig am 23.10.2025	2.510	2.494	0,06	HUB International Ltd. 7,000 % fällig am 01.05.2026	10.000	10.396	0,24	Advantage Sales & Marketing, Inc. 6,500 % fällig am 15.11.2028	5.000	5.280	0,12
		60.134	1,41	Intesa Sanpaolo SpA 5,017 % fällig am 26.06.2024	1.000	1.089	0,03	Ahead DB Holdings LLC 6,625 % fällig am 01.05.2028	10.000	10.377	0,24
				5,710 % fällig am 15.01.2026	3.000	3.396	0,08	Albertsons Cos., Inc. 3,250 % fällig am 15.03.2026	1.250	1.271	0,03
				7,700 % fällig am 17.09.2025 (f)(h)	4.000	4.592	0,11	3,500 % fällig am 15.03.2029	5.000	4.950	0,12
				iStar, Inc. 4,250 % fällig am 01.08.2025	2.000	2.063	0,05	4,625 % fällig am 15.01.2027	5.000	5.236	0,12
				Lloyds Banking Group PLC 7,500 % fällig am 27.06.2024 (f)(h)	5.000	5.701	0,13	4,875 % fällig am 15.02.2030	2.000	2.136	0,05
				7,625 % fällig am 27.06.2023 (f)(h)	£ 3.000	4.546	0,11	5,875 % fällig am 15.02.2028	3.750	4.045	0,10
				MGM Growth Properties Operating Partnership LP 3,875 % fällig am 15.02.2029	\$ 3.000	3.055	0,07	Allison Transmission, Inc. 3,750 % fällig am 30.01.2031	5.000	4.921	0,12
				4,500 % fällig am 01.09.2026	2.000	2.139	0,05	Altice Financing S.A. 5,000 % fällig am 15.01.2028	4.000	3.932	0,09
				4,625 % fällig am 15.06.2025	2.000	2.141	0,05	7,500 % fällig am 15.05.2026	5.000	5.213	0,12
				5,625 % fällig am 01.05.2024	2.000	2.168	0,05	Altice France Holding S.A. 4,000 % fällig am 15.02.2028	€ 3.000	3.427	0,08
				5,750 % fällig am 01.02.2027	1.000	1.114	0,03	6,000 % fällig am 15.02.2028	\$ 12.500	12.465	0,29
				Midcap Financial Issuer Trust 5,625 % fällig am 15.01.2030	2.500	2.513	0,06	8,000 % fällig am 15.05.2027	€ 4.000	5.127	0,12
				6,500 % fällig am 01.05.2028	4.000	4.191	0,10	10,500 % fällig am 15.05.2027	\$ 6.500	7.231	0,17
				MPT Operating Partnership LP 3,500 % fällig am 15.03.2031	6.000	6.067	0,14	Altice France S.A. 5,125 % fällig am 15.07.2029	5.000	5.031	0,12
				Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,125 % fällig am 15.12.2030	7.000	6.979	0,16	5,500 % fällig am 15.01.2028	4.000	4.156	0,10
				Navient Corp. 7,250 % fällig am 25.01.2022	2.000	2.077	0,05	7,375 % fällig am 01.05.2026	4.397	4.578	0,11
				NCL Finance Ltd. 6,125 % fällig am 15.03.2028	3.000	3.153	0,07	8,125 % fällig am 01.02.2027	2.000	2.182	0,05
				NFP Corp. 6,875 % fällig am 15.08.2028	5.000	5.279	0,12	Ambience Merger Sub, Inc. 4,875 % fällig am 15.07.2028 (a)	1.125	1.131	0,03
				OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027	4.000	4.035	0,09	7,125 % fällig am 15.07.2029 (a)	5.000	5.062	0,12
				4,000 % fällig am 15.09.2030	3.000	2.977	0,07	AMC Networks, Inc. 4,250 % fällig am 15.02.2029	5.125	5.176	0,12
				5,375 % fällig am 15.11.2029	3.000	3.269	0,08	4,750 % fällig am 01.08.2025	2.000	2.059	0,05
				6,125 % fällig am 15.05.2022	1.000	1.042	0,02	5,000 % fällig am 01.04.2024	1.600	1.625	0,04
				6,125 % fällig am 15.03.2024	3.000	3.232	0,08	American Airlines Pass-Through Trust 3,150 % fällig am 15.08.2033	1.887	1.951	0,05
				6,625 % fällig am 15.01.2028	2.250	2.587	0,06	3,375 % fällig am 01.11.2028	2.456	2.445	0,06
				6,875 % fällig am 15.03.2025	4.000	4.519	0,11	3,650 % fällig am 15.02.2029	805	832	0,02
				7,125 % fällig am 15.03.2026	4.000	4.664	0,11	American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	5.000	5.300	0,12
				8,875 % fällig am 01.06.2025	2.000	2.223	0,05	5,750 % fällig am 20.04.2029	5.000	5.412	0,13
				Park Intermediate Holdings LLC 4,875 % fällig am 15.05.2029	4.000	4.143	0,10	ANGI Group LLC 3,875 % fällig am 15.08.2028	2.875	2.861	0,07
				5,875 % fällig am 01.10.2028	4.000	4.272	0,10	Antero Resources Corp. 5,375 % fällig am 01.03.2030	3.000	3.066	0,07
				PennyMac Financial Services, Inc. 5,375 % fällig am 15.10.2025	4.000	4.222	0,10	Apache Corp. 4,375 % fällig am 15.10.2028	2.000	2.132	0,05
				Quicken Loans LLC 3,625 % fällig am 01.03.2029	1.000	990	0,02	4,625 % fällig am 15.11.2025	2.000	2.166	0,05
				3,875 % fällig am 01.03.2031	2.000	2.017	0,05	4,875 % fällig am 15.11.2027	5.000	5.422	0,13
				5,250 % fällig am 15.01.2028	2.000	2.102	0,05	Aramark Services, Inc. 5,000 % fällig am 01.02.2028	2.250	2.359	0,06
				SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	10.000	9.665	0,23	6,375 % fällig am 01.05.2025	1.750	1.862	0,04
				SLM Corp. 5,125 % fällig am 05.04.2022	2.000	2.044	0,05	Arches Buyer, Inc. 4,250 % fällig am 01.06.2028	1.750	1.733	0,04
				United Wholesale Mortgage LLC 5,500 % fällig am 15.11.2025	3.500	3.635	0,09	6,125 % fällig am 01.12.2028	12.500	12.900	0,30
				USI, Inc. 6,875 % fällig am 01.05.2025	13.250	13.456	0,32	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3,250 % fällig am 01.09.2028	3.000	3.002	0,07
				VICI Properties LP 3,500 % fällig am 15.02.2025	750	767	0,02	4,000 % fällig am 01.09.2029	4.000	3.975	0,09

Aufstellung der Wertpapieranlagen US High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Ardagh Packaging Finance PLC				BY Crown Parent LLC				Clarios Global LP			
4,125 % fällig am 15.08.2026	\$ 2.000	\$ 2.068	0,05	4,250 % fällig am 31.01.2026	\$ 3.750	\$ 3.936	0,09	4,375 % fällig am 15.05.2026	€ 5.000	\$ 6.150	0,14
5,250 % fällig am 15.08.2027	5.000	5.107	0,12	7,375 % fällig am 15.10.2024	3.500	3.570	0,08	6,250 % fällig am 15.05.2026	\$ 2.700	2.880	0,07
6,000 % fällig am 15.02.2025	1.308	1.353	0,03	CAB SELAS				6,750 % fällig am 15.05.2025	1.575	1.681	0,04
Ascend Learning LLC				3,375 % fällig am 01.02.2028	€ 5.000	5.914	0,14	8,500 % fällig am 15.05.2027	5.000	5.457	0,13
6,875 % fällig am 01.08.2025	18.000	18.364	0,43	Cable One, Inc.				Clarivate Science Holdings Corp.			
Ascent Resources Utica Holdings LLC				4,000 % fällig am 15.11.2030	\$ 2.500	2.512	0,06	4,875 % fällig am 30.06.2029	7.375	7.578	0,18
5,875 % fällig am 30.06.2029	3.000	3.004	0,07	Cablevision Lightpath LLC				Clear Channel International BV			
7,000 % fällig am 01.11.2026	5.000	5.248	0,12	5,625 % fällig am 15.09.2028	5.000	5.102	0,12	6,625 % fällig am 01.08.2025	2.000	2.109	0,05
8,250 % fällig am 31.12.2028	2.750	3.030	0,07	Caesars Entertainment, Inc.				Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.			
Ashland LLC				6,250 % fällig am 01.07.2025	2.000	2.123	0,05	7,750 % fällig am 15.04.2028	5.000	5.244	0,12
4,750 % fällig am 15.08.2022	225	233	0,01	8,125 % fällig am 01.07.2027	8.500	9.464	0,22	Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.			
Associated Materials LLC				Caesars Resort Collection LLC				5,125 % fällig am 15.08.2027	3.000	3.083	0,07
9,000 % fällig am 01.09.2025	5.401	5.739	0,14	5,250 % fällig am 15.10.2025	10.000	10.137	0,24	Clearwater Paper Corp.			
Atlanta SpA				5,750 % fällig am 01.07.2025	2.000	2.110	0,05	4,750 % fällig am 15.08.2028	2.750	2.743	0,06
1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 8.750	10.693	0,25	Callon Petroleum Co.				5,375 % fällig am 01.02.2025	2.250	2.405	0,06
Avantor Funding, Inc.				6,125 % fällig am 01.10.2024	5.000	4.947	0,12	CNX Midstream Partners LP			
4,625 % fällig am 15.07.2028	\$ 7.500	7.928	0,19	Camelot Finance S.A.				6,500 % fällig am 15.03.2026	2.250	2.363	0,06
Avient Corp.				4,500 % fällig am 01.11.2026	4.000	4.198	0,10	CNX Resources Corp.			
5,750 % fällig am 15.05.2025	3.000	3.175	0,07	Cargo Aircraft Management, Inc.				6,000 % fällig am 15.01.2029	8.500	9.202	0,22
Axalta Coating Systems LLC				4,750 % fällig am 01.02.2028	4.000	4.092	0,10	Colfax Corp.			
3,375 % fällig am 15.02.2029	5.000	4.901	0,12	Carlson Travel, Inc. (9,500% Bar und 2,000 % PIK)				6,375 % fällig am 15.02.2026	1.688	1.786	0,04
B.C. Unlimited Liability Co.				11,500 % fällig am				Colgate Energy Partners LLC			
3,500 % fällig am 15.02.2029	2.250	2.225	0,05	15.12.2026 (b)	2.650	1.331	0,03	5,875 % fällig am 01.07.2029	4.000	4.155	0,10
3,875 % fällig am 15.01.2028	2.000	2.028	0,05	Carnival Corp.				CommScope Technologies LLC			
4,000 % fällig am 15.10.2030	8.250	7.992	0,19	5,750 % fällig am 01.03.2027	7.625	7.997	0,19	5,000 % fällig am 15.03.2027	5.250	5.381	0,13
4,250 % fällig am 15.05.2024	516	522	0,01	7,625 % fällig am 01.03.2026	6.000	6.525	0,15	6,000 % fällig am 15.06.2025	4.515	4.617	0,11
4,375 % fällig am 15.01.2028	2.000	2.030	0,05	11,500 % fällig am 01.04.2023	5.000	5.633	0,13	CommScope, Inc.			
Ball Corp.				Carnival PLC				5,500 % fällig am 01.03.2024	1.250	1.290	0,03
2,875 % fällig am 15.08.2030	5.000	4.914	0,12	1,000 % fällig am 28.10.2029	€ 7.500	7.326	0,17	6,000 % fällig am 01.03.2026	3.250	3.435	0,08
Bausch Health Americas, Inc.				Catalent Pharma Solutions, Inc.				7,125 % fällig am 01.07.2028	10.000	10.851	0,26
8,500 % fällig am 31.01.2027	2.000	2.179	0,05	2,375 % fällig am 01.03.2028	2.000	2.383	0,06	8,250 % fällig am 01.03.2027	4.075	4.360	0,10
Bausch Health Cos., Inc.				3,125 % fällig am 15.02.2029	\$ 5.000	4.849	0,11	Community Health Systems, Inc.			
4,875 % fällig am 01.06.2028	2.000	2.050	0,05	CCO Holdings LLC				4,750 % fällig am 15.02.2031	5.000	5.025	0,12
5,000 % fällig am 30.01.2028	6.000	5.701	0,13	4,250 % fällig am 01.02.2031	10.000	10.200	0,24	5,625 % fällig am 15.03.2027	6.125	6.546	0,15
5,250 % fällig am 30.01.2030	7.000	6.519	0,15	4,500 % fällig am 15.08.2030	10.000	10.425	0,25	6,000 % fällig am 15.01.2029	1.250	1.339	0,03
5,250 % fällig am 15.02.2031	4.000	3.745	0,09	4,500 % fällig am 01.05.2032	10.000	10.397	0,24	6,125 % fällig am 01.04.2030	7.000	7.114	0,17
5,500 % fällig am 01.11.2025	10.000	10.272	0,24	4,500 % fällig am 01.06.2033	11.750	12.038	0,28	6,625 % fällig am 15.02.2025	7.750	8.205	0,19
5,750 % fällig am 15.08.2027	1.000	1.064	0,03	4,750 % fällig am 01.03.2030	2.000	2.118	0,05	6,875 % fällig am 01.04.2028	8.500	8.420	0,20
6,125 % fällig am 15.04.2025	4.846	4.973	0,12	5,000 % fällig am 01.02.2028	5.000	5.250	0,12	6,875 % fällig am 15.04.2029	12.000	12.593	0,30
6,250 % fällig am 15.02.2029	5.000	4.951	0,12	5,125 % fällig am 01.05.2027	5.750	6.038	0,14	8,000 % fällig am 15.03.2026	2.000	2.158	0,05
7,000 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.165	0,12	5,375 % fällig am 01.06.2029	4.000	4.377	0,10	Comstock Resources, Inc.			
7,250 % fällig am 30.05.2029	3.000	3.074	0,07	5,750 % fällig am 15.02.2026	4.981	5.160	0,12	5,875 % fällig am 15.01.2030	3.000	3.064	0,07
9,000 % fällig am 15.12.2025	7.000	7.515	0,18	CD&R Smokey Buyer, Inc.				6,750 % fällig am 01.03.2029	5.000	5.332	0,13
BCPE Empire Holdings, Inc.				6,750 % fällig am 15.07.2025	2.500	2.683	0,06	7,500 % fällig am 15.05.2025	1.370	1.425	0,03
7,625 % fällig am 01.05.2027	11.500	11.792	0,28	Centene Corp.				Connect Finco SARL			
BCPE Ulysses Intermediate, Inc. (7,750 % Bar oder 8,500 % PIK)				2,500 % fällig am 01.03.2031	4.000	3.950	0,09	6,750 % fällig am 01.10.2026	4.000	4.235	0,10
7,750 % fällig am 01.04.2027 (b)	6.200	6.363	0,15	3,375 % fällig am 15.02.2030	4.000	4.187	0,10	Consolidated Communications, Inc.			
Bellis Acquisition Co. PLC				4,250 % fällig am 15.12.2027	2.125	2.242	0,05	5,000 % fällig am 01.10.2028	2.000	2.032	0,05
3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 5.000	6.929	0,16	4,625 % fällig am 15.12.2029	4.000	4.404	0,10	Continental Resources, Inc.			
Bellis Finco PLC				5,375 % fällig am 01.06.2026	1.750	1.831	0,04	4,375 % fällig am 15.01.2028	6.000	6.655	0,16
4,000 % fällig am 16.02.2027	1.400	1.939	0,05	Centennial Resource Production LLC				4,500 % fällig am 15.04.2023	201	210	0,00
Berry Global, Inc.				5,375 % fällig am 15.01.2026	7.000	6.880	0,16	4,900 % fällig am 01.06.2044	4.000	4.535	0,11
5,125 % fällig am 15.07.2023	\$ 571	572	0,01	Central Garden & Pet Co.				Core & Main Holdings LP (8,625% Bar oder 9,375 % PIK)			
Black Knight InfoServ LLC				4,125 % fällig am 15.10.2030	5.000	5.124	0,12	8,625 % fällig am 15.09.2024 (b)	4.500	4.607	0,11
3,625 % fällig am 01.09.2028	3.000	2.989	0,07	4,125 % fällig am 30.04.2031	5.000	5.070	0,12	Core & Main LP			
Boise Cascade Co.				CF Industries, Inc.				6,125 % fällig am 15.08.2025	28.000	28.659	0,68
4,875 % fällig am 01.07.2030	3.000	3.194	0,08	5,150 % fällig am 15.03.2034	6.000	7.283	0,17	Cornerstone Building Brands, Inc.			
Bombardier, Inc.				Charles River Laboratories International, Inc.				6,125 % fällig am 15.01.2029	7.500	8.059	0,19
6,000 % fällig am 15.10.2022	4.000	4.013	0,09	3,750 % fällig am 15.03.2029	5.000	5.076	0,12	Coty, Inc.			
7,125 % fällig am 15.06.2026	9.500	9.958	0,23	4,000 % fällig am 15.03.2031	6.250	6.510	0,15	3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 4.100	4.891	0,12
7,500 % fällig am 01.12.2024	6.000	6.278	0,15	Cheniere Energy Partners LP				4,000 % fällig am 15.04.2023	5.000	5.896	0,14
7,500 % fällig am 15.03.2025	5.000	5.153	0,12	4,000 % fällig am 01.03.2031	7.000	7.324	0,17	4,750 % fällig am 15.04.2026	2.000	2.320	0,05
7,875 % fällig am 15.04.2027	6.000	6.233	0,15	4,500 % fällig am 01.10.2029	3.000	3.229	0,08	5,000 % fällig am 15.04.2026	\$ 4.250	4.321	0,10
Boxer Parent Co., Inc.				5,625 % fällig am 01.10.2026	2.000	2.080	0,05	6,500 % fällig am 15.04.2026	5.000	5.075	0,12
6,500 % fällig am 02.10.2025	€ 4.000	5.040	0,12	Cheniere Energy, Inc.				Crocs, Inc.			
9,125 % fällig am 01.03.2026	\$ 2.625	2.780	0,07	4,625 % fällig am 15.10.2028	5.750	6.073	0,14	4,250 % fällig am 15.03.2029	3.625	3.707	0,09
Boyd Gaming Corp.				Chesapeake Energy Corp.				Crown Americas LLC			
4,750 % fällig am 01.12.2027	1.000	1.036	0,02	5,500 % fällig am 01.02.2026	1.500	1.587	0,04	4,250 % fällig am 30.09.2026	4.000	4.301	0,10
4,750 % fällig am 15.06.2031	2.000	2.078	0,05	5,875 % fällig am 01.02.2029	950	1.030	0,02	CSC Holdings LLC			
Boyne USA, Inc.				Chobani LLC				3,375 % fällig am 15.02.2031	4.000	3.785	0,09
4,750 % fällig am 15.05.2029	3.000	3.104	0,07	4,625 % fällig am 15.11.2028	2.500	2.596	0,06	4,125 % fällig am 01.12.2030	3.500	3.489	0,08
Buckeye Partners LP				7,500 % fällig am 15.04.2025	10.000	10.424	0,25	4,625 % fällig am 01.12.2030	4.000	3.929	0,09
4,125 % fällig am 01.03.2025	2.750	2.859	0,07	Churchill Downs, Inc.				5,250 % fällig am 01.06.2024	7.500	8.137	0,19
4,500 % fällig am 01.03.2028	3.000	3.082	0,07	4,750 % fällig am 15.01.2028	5.750	5.958	0,14	5,500 % fällig am 15.04.2027	2.000	2.105	0,05
Builders FirstSource, Inc.				Cirsa Finance International SARL				5,750 % fällig am 15.01.2030	7.000	7.280	0,17
5,000 % fällig am 01.03.2030	7.000	7.370	0,17	7,875 % fällig am 20.12.2023	2.251	2.300	0,05	5,875 % fällig am 15.09.2022	5.000	5.263	0,12
								6,500 % fällig am 01.02.2029	2.500	2.772	0,07

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
DaVita, Inc.				8,500 % fällig am 01.02.2030	\$ 2.000	\$ 2.608	0,06	4,875 % fällig am 15.01.2030	\$ 2.500	\$ 2.674	0,06
3,750 % fällig am 15.02.2031	\$ 10.000	\$ 9.612	0,23	Fairstone Financial, Inc.				5,375 % fällig am 01.05.2025	1.500	1.583	0,04
4,625 % fällig am 01.06.2030	10.000	10.295	0,24	7,875 % fällig am 15.07.2024	4.000	4.184	0,10	5,750 % fällig am 01.05.2028	1.500	1.627	0,04
DCP Midstream Operating LP				Flex Acquisition Co., Inc.				Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC			
5,375 % fällig am 15.07.2025	5.000	5.575	0,13	6,875 % fällig am 15.01.2025	8.000	8.150	0,19	4,875 % fällig am 01.07.2031	5.875	5.867	0,14
5,625 % fällig am 15.07.2027	2.500	2.851	0,07	7,875 % fällig am 15.07.2026	10.000	10.435	0,25	5,000 % fällig am 01.06.2029	4.375	4.479	0,11
Dealer Tire LLC				Forterra Finance LLC				Howmet Aerospace, Inc.			
8,000 % fällig am 01.02.2028	5.000	5.407	0,13	6,500 % fällig am 15.07.2025	5.000	5.404	0,13	5,125 % fällig am 01.10.2024	5.000	5.531	0,13
Dell International LLC				Foundation Building Materials, Inc.				5,900 % fällig am 01.02.2027	750	878	0,02
7,125 % fällig am 15.06.2024	1.750	1.799	0,04	6,000 % fällig am 01.03.2029	11.450	11.351	0,27	5,950 % fällig am 01.02.2037	3.000	3.634	0,09
Dell, Inc.				Freeport-McMoRan, Inc.				iHeartCommunications, Inc.			
6,500 % fällig am 15.04.2038	1.500	1.920	0,05	4,125 % fällig am 01.03.2028	3.500	3.657	0,09	4,750 % fällig am 15.01.2028	7.500	7.742	0,18
7,100 % fällig am 15.04.2028	1.000	1.290	0,03	4,375 % fällig am 01.08.2028	2.500	2.644	0,06	6,375 % fällig am 01.05.2026	500	533	0,01
Deluxe Corp.				4,625 % fällig am 01.08.2030	2.500	2.741	0,06	8,375 % fällig am 01.05.2027	8.750	9.384	0,22
8,000 % fällig am 01.06.2029	9.350	10.170	0,24	5,000 % fällig am 01.09.2027	2.500	2.648	0,06	IHO Verwaltungen GmbH (4,750 % Bar oder 5,500 % PIK)			
Diamond Assets LLC				5,250 % fällig am 01.09.2029	3.000	3.322	0,08	4,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	4.000	4.099	0,10
13,000 % fällig am 22.04.2027 (i)	115	116	0,00	5,400 % fällig am 14.11.2034	10.000	12.092	0,28	IHO Verwaltungen GmbH (6,000 % Bar oder 6,750 % PIK)			
13,000 % fällig am 22.04.2027	31	31	0,00	5,450 % fällig am 15.03.2043	2.125	2.600	0,06	6,000 % fällig am 15.05.2027 (b)	2.000	2.102	0,05
Diamond BC BV				Frontier Communications Holdings LLC				IHO Verwaltungen GmbH (6,375 % Bar oder 7,125 % PIK)			
5,625 % fällig am 15.08.2025	€ 4.000	4.835	0,11	5,000 % fällig am 01.05.2028	2.250	2.329	0,05	6,375 % fällig am 15.05.2029 (b)	1.750	1.915	0,05
Diamond Offshore Drilling, Inc.				5,875 % fällig am 15.10.2027	3.000	3.217	0,08	Imola Merger Corp.			
13,000 % fällig am 21.12.2026	\$ 77	77	0,00	6,750 % fällig am 01.05.2029	3.500	3.728	0,09	4,750 % fällig am 15.05.2029	6.000	6.180	0,15
Diamond Resorts International, Inc.				Full House Resorts, Inc.				Indigo Natural Resources LLC			
7,750 % fällig am 01.09.2023	3.500	3.611	0,08	8,250 % fällig am 15.02.2028	7.250	7.929	0,19	5,375 % fällig am 01.02.2029	5.000	5.231	0,12
Diamond Sports Group LLC				Gap, Inc.				INEOS Group Holdings S.A.			
5,375 % fällig am 15.08.2026	12.875	8.353	0,20	8,375 % fällig am 15.05.2023	750	846	0,02	5,625 % fällig am 01.08.2024	2.000	2.012	0,05
6,625 % fällig am 15.08.2027	5.000	2.462	0,06	8,625 % fällig am 15.05.2025	4.000	4.393	0,10	INEOS Quattro Finance PLC			
DISH DBS Corp.				8,875 % fällig am 15.05.2027	4.300	4.987	0,12	2,500 % fällig am 15.01.2026	€ 3.500	4.197	0,10
5,000 % fällig am 15.03.2023	5.000	5.245	0,12	Garda World Security Corp.				Ingevity Corp.			
5,875 % fällig am 15.07.2022	6.750	7.050	0,17	4,625 % fällig am 15.02.2027	3.000	3.021	0,07	3,875 % fällig am 01.11.2028	\$ 5.000	4.969	0,12
5,875 % fällig am 15.11.2024	5.000	5.375	0,13	6,000 % fällig am 01.06.2029	7.000	6.957	0,16	Innophos Holdings, Inc.			
7,750 % fällig am 01.07.2026	3.000	3.401	0,08	GCP Applied Technologies, Inc.				9,375 % fällig am 15.02.2028	9.750	10.569	0,25
DKT Finance ApS				5,500 % fällig am 15.04.2026	5.000	5.149	0,12	Intelligent Packaging Holdco Issuer LP (9,000 % Bar oder 9,750 % PIK)			
9,375 % fällig am 17.06.2023	2.250	2.303	0,05	GFL Environmental, Inc.				9,000 % fällig am 15.01.2026 (b)	3.000	3.089	0,07
DT Midstream, Inc.				3,500 % fällig am 01.09.2028	5.000	4.995	0,12	Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.			
4,125 % fällig am 15.06.2029	4.000	4.066	0,10	4,000 % fällig am 01.08.2028	5.000	4.947	0,12	6,000 % fällig am 15.09.2028	4.000	4.171	0,10
4,375 % fällig am 15.06.2031	4.125	4.220	0,10	5,125 % fällig am 15.12.2026	2.625	2.785	0,07	Intelsat Jackson Holdings S.A.			
Dun & Bradstreet Corp.				Global Marine, Inc.				5,500 % fällig am 01.08.2023 ^	5.000	2.869	0,07
6,875 % fällig am 15.08.2026	2.398	2.550	0,06	7,000 % fällig am 01.06.2028	6.000	4.350	0,10	8,500 % fällig am 15.10.2024 ^	5.000	2.968	0,07
10,250 % fällig am 15.02.2027	5.100	5.650	0,13	Global Medical Response, Inc.				9,750 % fällig am 15.07.2025 ^	6.000	3.505	0,08
Edgewell Personal Care Co.				6,500 % fällig am 01.10.2025	12.500	12.884	0,30	International Game Technology PLC			
5,500 % fällig am 01.06.2028	3.000	3.186	0,07	Go Daddy Operating Co. LLC				4,125 % fällig am 15.04.2026	2.000	2.085	0,05
Element Solutions, Inc.				3,500 % fällig am 01.03.2029	10.000	9.955	0,23	5,250 % fällig am 15.01.2029	2.000	2.148	0,05
3,875 % fällig am 01.09.2028	4.000	4.087	0,10	Golden Entertainment, Inc.				6,250 % fällig am 15.01.2027	2.500	2.858	0,07
EMC Corp.				7,625 % fällig am 15.04.2026	4.250	4.532	0,11	6,500 % fällig am 15.02.2025	4.500	5.051	0,12
3,375 % fällig am 01.06.2023	2.000	2.082	0,05	Golden Nugget, Inc.				IQVIA, Inc.			
Endo DAC				6,750 % fällig am 15.10.2024	5.000	5.057	0,12	2,875 % fällig am 15.06.2028	€ 3.000	3.673	0,09
6,000 % fällig am 30.06.2028	12.000	8.108	0,19	Graham Packaging Co., Inc.				5,000 % fällig am 15.10.2026	\$ 7.000	7.264	0,17
9,500 % fällig am 31.07.2027	6.203	6.335	0,15	7,125 % fällig am 15.08.2028	10.000	10.803	0,25	IRB Holding Corp.			
Endo Luxembourg Finance Co. SARL				Graphic Packaging International LLC				6,750 % fällig am 15.02.2026	10.000	10.370	0,24
6,125 % fällig am 01.04.2029	4.500	4.416	0,10	3,500 % fällig am 01.03.2029	7.000	6.944	0,16	7,000 % fällig am 15.06.2025	3.000	3.246	0,08
Endure Digital, Inc.				Griffon Corp.				Iris Holdings, Inc. (8,750 % Bar oder 9,500 % PIK)			
6,000 % fällig am 15.02.2029	12.750	12.640	0,30	5,750 % fällig am 01.03.2028	4.000	4.263	0,10	8,750 % fällig am 15.02.2026 (b)	3.750	3.832	0,09
Energizer Holdings, Inc.				H-Food Holdings LLC				J2 Global, Inc.			
4,375 % fällig am 31.03.2029	4.000	4.010	0,09	8,500 % fällig am 01.06.2026	20.000	20.914	0,49	4,625 % fällig am 15.10.2030	4.000	4.146	0,10
4,750 % fällig am 15.06.2028	2.500	2.567	0,06	Hadrian Merger Sub, Inc.				Jaguar Holding Co.			
EnLink Midstream LLC				8,500 % fällig am 01.05.2026	10.000	10.457	0,25	4,625 % fällig am 15.06.2025	3.000	3.156	0,07
5,625 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.297	0,12	Hanesbrands, Inc.				5,000 % fällig am 15.06.2028	4.000	4.344	0,10
EnLink Midstream Partners LP				4,625 % fällig am 15.05.2024	3.000	3.184	0,07	Jeld-Wen, Inc.			
4,150 % fällig am 01.06.2025	5.000	5.243	0,12	4,875 % fällig am 15.05.2026	2.000	2.163	0,05	4,625 % fällig am 15.12.2025	5.000	5.106	0,12
Entercom Media Corp.				5,375 % fällig am 15.05.2025	2.000	2.123	0,05	4,875 % fällig am 15.12.2027	6.000	6.247	0,15
6,750 % fällig am 31.03.2029	5.000	5.200	0,12	Harsco Corp.				Kraft Heinz Foods Co.			
Envision Healthcare Corp.				5,750 % fällig am 31.07.2027	2.000	2.101	0,05	4,250 % fällig am 01.03.2031	3.500	3.980	0,09
8,750 % fällig am 15.10.2026	3.125	2.196	0,05	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd.				4,375 % fällig am 01.06.2046	5.000	5.675	0,13
EQM Midstream Partners LP				5,750 % fällig am 20.01.2026	4.500	4.837	0,11	4,875 % fällig am 01.10.2049	1.500	1.825	0,04
4,000 % fällig am 01.08.2024	3.000	3.086	0,07	HCA, Inc.				5,200 % fällig am 15.07.2045	15.000	18.656	0,44
4,500 % fällig am 15.01.2029	4.000	4.075	0,10	3,500 % fällig am 01.09.2030	7.500	7.995	0,19	5,500 % fällig am 01.06.2050	3.000	3.902	0,09
4,750 % fällig am 15.07.2023	674	704	0,02	5,375 % fällig am 01.02.2025	3.000	3.388	0,08	6,875 % fällig am 26.01.2039	1.000	1.440	0,03
4,750 % fällig am 15.01.2031	3.000	3.095	0,07	5,875 % fällig am 01.05.2023	7.000	7.616	0,18	Kronos Acquisition Holdings, Inc.			
6,000 % fällig am 01.07.2025	2.500	2.725	0,06	Heres Holdco SARL				7,000 % fällig am 31.12.2027	12.500	12.545	0,30
6,500 % fällig am 01.07.2027	2.000	2.236	0,05	4,750 % fällig am 15.05.2028	4.000	3.985	0,09	L Brands, Inc.			
6,500 % fällig am 15.07.2048	3.500	3.752	0,09	Heres Midco SARL				6,625 % fällig am 01.10.2030	4.000	4.635	0,11
EQT Corp.				5,250 % fällig am 15.05.2029	€ 6.000	6.977	0,16	6,875 % fällig am 01.11.2035	8.000	10.140	0,24
3,000 % fällig am 01.10.2022	810	828	0,02	Hilton Domestic Operating Co., Inc.				6,950 % fällig am 01.03.2033	6.750	8.210	0,19
3,125 % fällig am 15.05.2026	2.000	2.052	0,05	3,625 % fällig am 15.02.2032	\$ 5.000	4.944	0,12	9,375 % fällig am 01.07.2025	2.500	3.238	0,08
3,625 % fällig am 15.05.2031	1.500	1.568	0,04	3,750 % fällig am 01.05.2029	3.000	3.034	0,07	LABL Escrow Issuer LLC			
7,625 % fällig am 01.02.2025	3.400	3.970	0,09	4,000 % fällig am 01.05.2031	3.000	3.031	0,07	6,750 % fällig am 15.07.2026	3.750	4.008	0,09

Aufstellung der Wertpapieranlagen US High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS		
10,500 % fällig am 15.07.2027	\$ 3.500	\$ 3.866	0,09	Netflix, Inc.				PDC Energy, Inc.					
Laboratoire Eimer Selas	€ 500	606	0,01	4,375 % fällig am 15.11.2026	\$ 4.500	\$ 5.123	0,12	5,750 % fällig am 15.05.2026	\$ 5.250	\$ 5.491	0,13		
5,000 % fällig am 01.02.2029				4,875 % fällig am 15.04.2028	7.000	8.146	0,19	6,125 % fällig am 15.09.2024	2.000	2.052	0,05		
Lamb Weston Holdings, Inc.				4,875 % fällig am 15.06.2030	2.750	3.278	0,08	Performance Food Group, Inc.					
4,625 % fällig am 01.11.2024	\$ 2.000	2.075	0,05	5,375 % fällig am 15.11.2029	1.500	1.824	0,04	5,500 % fällig am 15.10.2027	2.125	2.236	0,05		
4,875 % fällig am 01.11.2026	3.250	3.364	0,08	Nexstar Broadcasting, Inc.				6,875 % fällig am 01.05.2025	1.000	1.069	0,03		
4,875 % fällig am 15.05.2028	4.000	4.430	0,10	4,750 % fällig am 01.11.2028	2.500	2.572	0,06	PetSmart, Inc.					
LBM Acquisition LLC				5,625 % fällig am 15.07.2027	4.000	4.245	0,10	4,750 % fällig am 15.02.2028	10.000	10.400	0,24		
6,250 % fällig am 15.01.2029	10.750	10.846	0,26	Nidda BondCo GmbH				7,750 % fällig am 15.02.2029	10.000	11.037	0,26		
Legacy LifePoint Health LLC				5,000 % fällig am 30.09.2025	€ 10.000	11.935	0,28	PGT Innovations, Inc.					
4,375 % fällig am 15.02.2027	4.000	4.054	0,10	Nielsen Co. Luxembourg SARL				6,750 % fällig am 01.08.2026	3.000	3.175	0,07		
Level 3 Financing, Inc.				5,000 % fällig am 01.02.2025	\$ 4.000	4.127	0,10	Picasso Finance Sub, Inc.					
3,625 % fällig am 15.01.2029	3.000	2.899	0,07	(j)				6,125 % fällig am 15.06.2025	1.377	1.459	0,03		
3,750 % fällig am 15.07.2029	5.000	4.869	0,11	Nielsen Finance LLC				Pike Corp.					
4,250 % fällig am 01.07.2028	2.000	2.032	0,05	4,500 % fällig am 15.07.2029	2.000	2.008	0,05	5,500 % fällig am 01.09.2028	6.000	6.257	0,15		
5,250 % fällig am 15.03.2026	3.500	3.617	0,09	4,750 % fällig am 15.07.2031	4.000	4.015	0,09	Post Holdings, Inc.					
5,375 % fällig am 01.05.2025	3.000	3.067	0,07	5,625 % fällig am 01.10.2028	2.375	2.511	0,06	4,500 % fällig am 15.09.2031	10.000	9.996	0,24		
LifePoint Health, Inc.				5,875 % fällig am 01.10.2030	2.750	3.000	0,07	4,625 % fällig am 15.04.2030	6.000	6.108	0,14		
5,375 % fällig am 15.01.2029	10.000	9.764	0,23	Noble Finance Co. (11,000 % Bar oder 15,000 % PIK)				5,625 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.315	0,13		
Live Nation Entertainment, Inc.				11,000 % fällig am 15.02.2028	(b)	1.171	1.296	0,03	5,750 % fällig am 01.03.2027	5.875	6.154	0,14	
6,500 % fällig am 15.05.2027	3.750	4.173	0,10	Nokia Oyj				Precision Drilling Corp.					
LogMeIn, Inc.				6,625 % fällig am 15.05.2039	3.000	3.892	0,09	6,875 % fällig am 15.01.2029	1.500	1.547	0,04		
5,500 % fällig am 01.09.2027	3.250	3.370	0,08	Nouryon Holding BV				Presidio Holdings, Inc.					
Madison IAQ LLC				6,500 % fällig am 01.10.2026	€ 5.000	6.215	0,15	4,875 % fällig am 01.02.2027	2.500	2.577	0,06		
5,875 % fällig am 30.06.2029	12.500	12.734	0,30	8,000 % fällig am 01.10.2026	\$ 10.000	10.612	0,25	8,250 % fällig am 01.02.2028	3.750	4.092	0,10		
MajorDrive Holdings LLC				Novelis Corp.				Prime Healthcare Services, Inc.					
6,375 % fällig am 01.06.2029	6.375	6.367	0,15	4,750 % fällig am 30.01.2030	6.000	6.307	0,15	7,250 % fällig am 01.11.2025	10.000	10.839	0,26		
Manitowoc Co., Inc.				5,875 % fällig am 30.09.2026	10.000	10.415	0,25	Prime Security Services Borrower LLC					
9,000 % fällig am 01.04.2026	4.000	4.355	0,10	NuStar Logistics LP				3,375 % fällig am 31.08.2027	2.000	1.943	0,05		
Marriott Ownership Resorts, Inc.				5,750 % fällig am 01.10.2025	2.750	2.999	0,07	5,250 % fällig am 15.04.2024	3.000	3.218	0,08		
4,500 % fällig am 15.06.2029	2.750	2.791	0,07	6,375 % fällig am 01.10.2030	2.375	2.631	0,06	5,750 % fällig am 15.04.2026	1.500	1.661	0,04		
6,125 % fällig am 15.09.2025	750	800	0,02	Occidental Petroleum Corp.				6,250 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.325	0,13		
6,500 % fällig am 15.09.2026	1.250	1.300	0,03	1,606 % fällig am 15.08.2022	18.000	17.916	0,42	QualityTech LP					
Mattel, Inc.				2,900 % fällig am 15.08.2024	5.000	5.119	0,12	3,875 % fällig am 01.10.2028	2.625	2.810	0,07		
3,375 % fällig am 01.04.2026	3.000	3.116	0,07	3,400 % fällig am 15.04.2026	1.500	1.538	0,04	Rackspace Technology Global, Inc.					
3,750 % fällig am 01.04.2029	5.000	5.207	0,12	3,500 % fällig am 15.06.2025	3.000	3.071	0,07	5,375 % fällig am 01.12.2028	(j)	9.000	9.236	0,22	
5,875 % fällig am 15.12.2027	4.000	4.365	0,10	3,500 % fällig am 15.08.2029	500	502	0,01	Radiate Holdco LLC					
6,750 % fällig am 31.12.2025	1.154	1.213	0,03	4,300 % fällig am 15.08.2039	2.300	2.201	0,05	4,500 % fällig am 15.09.2026	2.000	2.075	0,05		
Mausser Packaging Solutions Holding Co.				4,400 % fällig am 15.04.2046	2.375	2.284	0,05	6,500 % fällig am 15.09.2028	10.000	10.520	0,25		
5,500 % fällig am 15.04.2024	5.000	5.056	0,12	4,400 % fällig am 15.08.2049	2.500	2.403	0,06	Radiology Partners, Inc.					
7,250 % fällig am 15.04.2025	7.500	7.365	0,17	4,500 % fällig am 15.07.2044	3.875	3.744	0,09	9,250 % fällig am 01.02.2028	5.000	5.544	0,13		
MDC Holdings, Inc.				4,625 % fällig am 15.06.2045	3.000	2.936	0,07	Rakuten Group, Inc.					
6,000 % fällig am 15.01.2043	2.750	3.547	0,08	5,500 % fällig am 01.12.2025	(i)	4.000	4.433	0,10	5,125 % fällig am 22.04.2026	(f)	2.000	2.081	0,05
MEG Energy Corp.				5,550 % fällig am 15.03.2026	4.000	4.431	0,10	6,250 % fällig am 22.04.2031	(f)	3.500	3.790	0,09	
5,875 % fällig am 01.02.2029	3.500	3.654	0,09	5,875 % fällig am 01.09.2025	2.375	2.645	0,06	Range Resources Corp.					
7,125 % fällig am 01.02.2027	5.000	5.340	0,13	6,125 % fällig am 01.01.2031	1.250	1.472	0,03	4,875 % fällig am 15.05.2025	3.000	3.109	0,07		
Merlin Entertainments Ltd.				6,200 % fällig am 15.03.2040	3.000	3.399	0,08	5,000 % fällig am 15.03.2023	1.122	1.164	0,03		
5,750 % fällig am 15.06.2026	2.000	2.099	0,05	6,375 % fällig am 01.09.2028	2.000	2.338	0,05	8,250 % fällig am 15.01.2029	2.000	2.258	0,05		
MGM Resorts International				6,450 % fällig am 15.09.2036	5.100	6.104	0,14	Rattler Midstream LP					
4,625 % fällig am 01.09.2026	3.500	3.702	0,09	6,600 % fällig am 15.03.2046	5.000	5.954	0,14	5,625 % fällig am 15.07.2025	1.500	1.579	0,04		
6,000 % fällig am 15.03.2023	5.000	5.358	0,13	6,625 % fällig am 01.09.2030	4.125	4.955	0,12	RBS Global, Inc.					
7,750 % fällig am 15.03.2022	2.000	2.093	0,05	7,500 % fällig am 01.05.2031	1.000	1.261	0,03	4,875 % fällig am 15.12.2025	7.000	7.163	0,17		
Midwest Gaming Borrower LLC				8,000 % fällig am 15.07.2025	2.000	2.398	0,06	Real Hero Merger Sub, Inc.					
4,875 % fällig am 01.05.2029	5.000	5.012	0,12	8,875 % fällig am 15.07.2030	3.625	4.853	0,11	6,250 % fällig am 01.02.2029	5.000	5.193	0,12		
Moog, Inc.				ON Semiconductor Corp.				RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.					
4,250 % fällig am 15.12.2027	2.000	2.073	0,05	3,875 % fällig am 01.09.2028	3.750	3.868	0,09	9,750 % fällig am 01.12.2026	6.500	7.015	0,17		
Motion Bondco DAC				Open Text Corp.				Revlon Consumer Products Corp.					
6,625 % fällig am 15.11.2027	1.000	1.016	0,02	5,875 % fällig am 01.06.2026	2.500	2.593	0,06	6,250 % fällig am 01.08.2024	2.000	886	0,02		
MPH Acquisition Holdings LLC				Organon Finance LLC				Reynolds Group Issuer, Inc.					
5,750 % fällig am 01.11.2028	12.000	12.075	0,28	4,125 % fällig am 30.04.2028	8.250	8.424	0,20	4,000 % fällig am 15.10.2027	8.250	8.203	0,19		
MSCI, Inc.				5,125 % fällig am 30.04.2031	10.000	10.314	0,24	Rite Aid Corp.					
3,625 % fällig am 01.09.2030	4.000	4.100	0,10	Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.				7,500 % fällig am 01.07.2025	2.000	2.028	0,05		
3,875 % fällig am 15.02.2031	2.000	2.078	0,05	7,250 % fällig am 01.02.2028	21.600	23.636	0,56	8,000 % fällig am 15.11.2026	5.000	5.081	0,12		
4,000 % fällig am 15.11.2029	3.000	3.174	0,07	7,375 % fällig am 01.06.2025	3.000	3.233	0,08	Rockies Express Pipeline LLC					
Nabors Industries, Inc.				Outfront Media Capital LLC				4,800 % fällig am 15.05.2030	2.000	2.004	0,05		
9,000 % fällig am 01.02.2025	2.156	2.272	0,05	4,250 % fällig am 15.01.2029	2.000	2.017	0,05	4,950 % fällig am 15.07.2029	2.000	2.065	0,05		
NCL Corp. Ltd.				5,000 % fällig am 15.08.2027	2.125	2.203	0,05	Rolls-Royce PLC					
3,625 % fällig am 15.12.2024	7.250	7.011	0,16	6,250 % fällig am 15.06.2025	4.000	4.242	0,10	4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 1.500	1.945	0,05		
5,875 % fällig am 15.03.2026	3.875	4.068	0,10	Ovintiv Exploration, Inc.				5,750 % fällig am 15.10.2027	£ 1.750	2.653	0,06		
10,250 % fällig am 01.02.2026	2.000	2.330	0,05	5,375 % fällig am 01.01.2026	2.500	2.820	0,07	Royal Caribbean Cruises Ltd.					
NCR Corp.				Ovintiv, Inc.				5,500 % fällig am 01.04.2028	\$ 4.000	4.194	0,10		
5,000 % fällig am 01.10.2028	2.250	2.330	0,05	6,500 % fällig am 15.08.2034	3.000	3.967	0,09	9,125 % fällig am 15.06.2023	2.500	2.747	0,06		
5,125 % fällig am 15.04.2029	3.000	3.097	0,07	Pactiv LLC				RP Escrow Issuer LLC					
5,250 % fällig am 01.10.2030	1.625	1.688	0,04	8,375 % fällig am 15.04.2027	500	570	0,01	5,250 % fällig am 15.12.2025	2.250	2.356	0,06		
8,125 % fällig am 15.04.2025	1.500	1.643	0,04	Par Pharmaceutical, Inc.				Sabre GBLB, Inc.					
NESCO Holdings, Inc.				7,500 % fällig am 01.04.2027	9.785	10.017	0,24	7,375 % fällig am 01.09.2025	2.500	2.722	0,06		
5,500 % fällig am 15.04.2029	2.250	2.351	0,06	Park River Holdings, Inc.				9,250 % fällig am 15.04.2025	2.000	2.383	0,06		
				5,625 % fällig am 01.02.2029	11.000	10.718	0,25						
				6,750 % fällig am 01.08.2029	7.000	7.102	0,17						

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Scientific Games International, Inc.				Summer BC Bidco LLC				U.S. Renal Care, Inc.			
5,000 % fällig am 15.10.2025	\$ 2.000	\$ 2.070	0,05	5,500 % fällig am 31.10.2026 (a)	\$ 4.000	\$ 4.072	0,10	10,625 % fällig am 15.07.2027	\$ 14.045	\$ 14.782	0,35
7,000 % fällig am 15.05.2028	5.000	5.471	0,13	Sunoco LP				Uber Technologies, Inc.			
7,250 % fällig am 15.11.2029	7.000	7.915	0,19	4,500 % fällig am 15.05.2029	2.750	2.806	0,07	7,500 % fällig am 15.05.2025	3.000	3.241	0,08
8,250 % fällig am 15.03.2026	2.500	2.684	0,06	5,500 % fällig am 15.02.2026	1.000	1.034	0,02	7,500 % fällig am 15.09.2027	6.000	6.602	0,16
SCIH Salt Holdings, Inc.				5,875 % fällig am 15.03.2028	1.000	1.066	0,03	8,000 % fällig am 01.11.2026	3.500	3.781	0,09
4,875 % fällig am 01.05.2028	5.000	5.012	0,12	Superior Plus LP				United Airlines, Inc.			
6,625 % fällig am 01.05.2029	7.000	7.026	0,17	4,500 % fällig am 15.03.2029	4.575	4.718	0,11	4,375 % fällig am 15.04.2026	3.000	3.109	0,07
Scotts Miracle-Gro Co.				Surgery Center Holdings, Inc.				4,625 % fällig am 15.04.2029	4.000	4.145	0,10
4,000 % fällig am 01.04.2031	5.000	4.991	0,12	6,750 % fällig am 01.07.2025	4.500	4.601	0,11	United Rentals North America, Inc.			
Scripps Escrow, Inc.				10,000 % fällig am 15.04.2027	8.750	9.634	0,23	4,000 % fällig am 15.07.2030	3.000	3.096	0,07
5,375 % fällig am 15.01.2031	10.550	10.530	0,25	Switch Ltd.				5,500 % fällig am 15.05.2027	1.000	1.061	0,02
Seagate HDD Cayman				3,750 % fällig am 15.09.2028	1.000	1.015	0,02	5,875 % fällig am 15.09.2026	1.000	1.037	0,02
3,125 % fällig am 15.07.2029	1.750	1.698	0,04	Syneos Health, Inc.				Univar Solutions, Inc.			
3,375 % fällig am 15.07.2031	3.500	3.387	0,08	3,625 % fällig am 15.01.2029	3.000	2.974	0,07	5,125 % fällig am 01.12.2027	3.000	3.164	0,07
Sealed Air Corp.				T-Mobile USA, Inc.				Univision Communications, Inc.			
4,875 % fällig am 01.12.2022	1.000	1.043	0,02	2,250 % fällig am 15.02.2026	2.125	2.144	0,05	4,500 % fällig am 01.05.2029	8.500	8.583	0,20
5,125 % fällig am 01.12.2024	2.000	2.184	0,05	2,625 % fällig am 15.02.2029	5.250	5.191	0,12	5,125 % fällig am 15.02.2025	7.500	7.674	0,18
5,250 % fällig am 01.04.2023	1.500	1.589	0,04	2,875 % fällig am 15.02.2031	7.000	6.956	0,16	6,625 % fällig am 01.06.2027	5.000	5.424	0,13
Sensata Technologies BV				3,375 % fällig am 15.04.2029	2.000	2.069	0,05	9,500 % fällig am 01.05.2025	1.000	1.106	0,03
4,000 % fällig am 15.04.2029	5.000	5.082	0,12	3,500 % fällig am 15.04.2031	7.000	7.251	0,17	UPC Holding BV			
4,875 % fällig am 15.10.2023	1.000	1.074	0,03	4,500 % fällig am 01.02.2026	2.000	2.044	0,05	5,500 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.255	0,12
5,000 % fällig am 01.10.2025	1.000	1.117	0,03	4,750 % fällig am 01.02.2028	2.750	2.949	0,07	Urban One, Inc.			
5,625 % fällig am 01.11.2024	1.500	1.672	0,04	Team Health Holdings, Inc.				7,375 % fällig am 01.02.2028	4.050	4.379	0,10
Sensata Technologies, Inc.				6,375 % fällig am 01.02.2025	20.000	19.063	0,45	Valaris Ltd. (8,250 % Bar oder 12,000 % PIK)			
3,750 % fällig am 15.02.2031	5.000	4.950	0,12	TEGNA, Inc.				8,250 % fällig am 30.04.2028	482	502	0,01
ServiceMaster Co. LLC				4,625 % fällig am 15.03.2028	2.500	2.597	0,06	(b)			
7,450 % fällig am 15.08.2027	4.580	5.380	0,13	4,750 % fällig am 15.03.2026	1.500	1.599	0,04	Veritas U.S., Inc.			
Sigma Holdco BV				5,000 % fällig am 15.09.2029	5.000	5.246	0,12	7,500 % fällig am 01.09.2025	5.000	5.220	0,12
5,750 % fällig am 15.05.2026	€ 5.500	6.354	0,15	5,500 % fällig am 15.09.2024 (j)	1.049	1.069	0,03	Vertical Holdco GmbH			
7,875 % fällig am 15.05.2026	\$ 12.500	12.831	0,30	Tempo Acquisition LLC				6,625 % fällig am 15.07.2028	€ 2.000	2.532	0,06
Simmons Foods, Inc.				6,750 % fällig am 01.06.2025	18.000	18.304	0,43	7,625 % fällig am 15.07.2028	\$ 5.000	5.436	0,13
4,625 % fällig am 01.03.2029	5.000	5.050	0,12	Tenet Healthcare Corp.				Vertical U.S. Newco, Inc.			
Sinclair Television Group, Inc.				4,875 % fällig am 01.01.2026	2.500	2.596	0,06	5,250 % fällig am 15.07.2027	4.000	4.220	0,10
4,125 % fällig am 01.12.2030	3.000	2.951	0,07	5,125 % fällig am 01.11.2027	4.000	4.200	0,10	ViaSat, Inc.			
5,125 % fällig am 15.02.2027	4.000	4.023	0,09	6,125 % fällig am 01.10.2028	10.000	10.685	0,25	5,625 % fällig am 15.09.2025	3.000	3.067	0,07
Sirius XM Radio, Inc.				6,750 % fällig am 15.06.2023	10.000	10.925	0,26	6,500 % fällig am 15.07.2028	3.000	3.204	0,08
4,125 % fällig am 01.07.2030	5.000	5.057	0,12	6,875 % fällig am 15.11.2031	4.000	4.561	0,11	Victors Merger Corp.			
5,000 % fällig am 01.08.2027	2.000	2.100	0,05	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				6,375 % fällig am 15.05.2029	10.500	10.592	0,25
5,500 % fällig am 01.07.2029	2.250	2.455	0,06	4,100 % fällig am 01.10.2046	5.000	4.387	0,10	Viking Cruises Ltd.			
SM Energy Co.				TransDigm, Inc.				5,875 % fällig am 15.09.2027	7.000	6.926	0,16
6,625 % fällig am 15.01.2027	3.000	3.088	0,07	4,625 % fällig am 15.01.2029	8.000	8.026	0,19	7,000 % fällig am 15.02.2029	5.000	5.217	0,12
6,750 % fällig am 15.09.2026	2.500	2.547	0,06	5,500 % fällig am 15.11.2027	10.000	10.437	0,25	13,000 % fällig am 15.05.2025	2.750	3.241	0,08
Southwestern Energy Co.				6,250 % fällig am 15.03.2026	3.500	3.697	0,09	Vine Energy Holdings LLC			
7,500 % fällig am 01.04.2026	3.500	3.710	0,09	6,375 % fällig am 15.06.2026	4.000	4.149	0,10	6,750 % fällig am 15.04.2029	8.750	9.220	0,22
SpA Holdings Oy				Transocean Guardian Ltd.				Virgin Media Finance PLC			
4,875 % fällig am 04.02.2028	7.000	7.077	0,17	5,875 % fällig am 15.01.2024	2.900	2.826	0,07	5,000 % fällig am 15.07.2030	7.000	7.081	0,17
Spectrum Brands, Inc.				Transocean, Inc.				Virgin Media Secured Finance PLC			
3,875 % fällig am 15.03.2031	4.000	3.944	0,09	6,800 % fällig am 15.03.2038	6.000	3.870	0,09	4,500 % fällig am 15.08.2030	5.000	5.044	0,12
5,500 % fällig am 15.07.2030	5.000	5.407	0,13	7,250 % fällig am 01.11.2025	5.750	5.023	0,12	5,500 % fällig am 15.05.2029	3.000	3.229	0,08
5,750 % fällig am 15.07.2025	3.500	3.591	0,08	7,500 % fällig am 15.01.2026	2.000	1.723	0,04	Vizient, Inc.			
Spirit AeroSystems, Inc.				7,500 % fällig am 15.04.2031	7.000	5.176	0,12	6,250 % fällig am 15.05.2027	6.000	6.366	0,15
3,950 % fällig am 15.06.2023	2.750	2.771	0,07	Travel + Leisure Co.				Vmed O2 UK Financing PLC			
4,600 % fällig am 15.06.2028	3.250	3.193	0,08	4,625 % fällig am 01.03.2030	3.000	3.104	0,07	4,250 % fällig am 31.01.2031	5.000	4.919	0,12
5,500 % fällig am 15.01.2025	1.750	1.865	0,04	6,625 % fällig am 31.07.2026	3.750	4.260	0,10	VOC Escrow Ltd.			
7,500 % fällig am 15.04.2025	3.250	3.479	0,08	Trident TPI Holdings, Inc.				5,000 % fällig am 15.02.2028	2.500	2.532	0,06
SPX FLOW, Inc.				6,625 % fällig am 01.11.2025	3.750	3.859	0,09	Wabash National Corp.			
5,875 % fällig am 15.08.2026	6.000	6.215	0,15	9,250 % fällig am 01.08.2024	5.000	5.247	0,12	5,500 % fällig am 01.10.2025	4.500	4.609	0,11
Square, Inc.				TriMas Corp.				WESCO Distribution, Inc.			
2,750 % fällig am 01.06.2026	1.000	1.019	0,02	4,125 % fällig am 15.04.2029	9.000	9.134	0,21	7,125 % fällig am 15.06.2025	5.000	5.410	0,13
3,500 % fällig am 01.06.2031	5.000	5.050	0,12	TriNet Group, Inc.				7,250 % fällig am 15.06.2028	5.000	5.576	0,13
SRS Distribution, Inc.				3,500 % fällig am 01.03.2029	5.000	4.940	0,12	Western Midstream Operating LP			
6,125 % fällig am 01.07.2029	5.000	5.157	0,12	TripAdvisor, Inc.				4,350 % fällig am 01.02.2025	3.000	3.174	0,07
Standard Industries, Inc.				7,000 % fällig am 15.07.2025	2.500	2.695	0,06	5,300 % fällig am 01.02.2030	5.000	5.614	0,13
3,375 % fällig am 15.01.2031	6.500	6.231	0,15	Triton Water Holdings, Inc.				5,450 % fällig am 01.04.2044	4.000	4.329	0,10
4,375 % fällig am 15.07.2030	4.500	4.654	0,11	6,250 % fällig am 01.04.2029	10.000	10.039	0,24	6,500 % fällig am 01.02.2050	14.000	16.249	0,38
4,750 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.240	0,12	Triumph Group, Inc.				Wheel Pros, Inc.			
5,000 % fällig am 15.02.2027	4.000	4.147	0,10	6,250 % fällig am 15.09.2024	3.000	3.056	0,07	6,500 % fällig am 15.05.2029	9.000	9.119	0,21
Staples, Inc.				7,750 % fällig am 15.08.2025	5.000	5.150	0,12	White Cap Buyer LLC			
7,500 % fällig am 15.04.2026	7.500	7.777	0,18	8,875 % fällig am 01.06.2024	2.937	3.271	0,08	6,875 % fällig am 15.10.2028	14.000	15.003	0,35
10,750 % fällig am 15.04.2027	4.000	4.078	0,10	Twilio, Inc.				White Cap Parent LLC (8,250 % Bar oder 8,250 % PIK)			
Stars Group Holdings BV				3,625 % fällig am 15.03.2029	3.000	3.064	0,07	8,250 % fällig am 15.03.2026 (b)	5.250	5.451	0,13
7,000 % fällig am 15.07.2026	2.250	2.332	0,05	3,875 % fällig am 15.03.2031	2.875	2.954	0,07	Williams Scotsman International, Inc.			
Station Casinos LLC				U.S. Acute Care Solutions LLC				4,625 % fällig am 15.08.2028	2.750	2.845	0,07
4,500 % fällig am 15.02.2028	2.000	2.038	0,05	6,375 % fällig am 01.03.2026	6.400	6.635	0,16	WMG Acquisition Corp.			
5,000 % fällig am 01.10.2025	1.586	1.615	0,04	U.S. Foods, Inc.				3,000 % fällig am 15.02.2031	4.000	3.800	0,09
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP				4,750 % fällig am 15.02.2029	10.000	10.213	0,24	3,875 % fällig am 15.07.2030	4.500	4.556	0,11
5,875 % fällig am 15.05.2025	3.150	3.123	0,07	6,250 % fällig am 15.04.2025	2.500	2.653	0,06				

Aufstellung der Wertpapieranlagen US High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
WR Grace & Co-Conn 4,875 % fällig am 15.06.2027 \$	3.000	3.185	0,07	NGL Energy Partners LP 6,125 % fällig am 01.03.2025 \$	1.625	1.478	0,04	TBW Mortgage-Backed Trust 6,470 % fällig am 25.09.2036 ^ \$	662	45	0,00
5,625 % fällig am 01.10.2024	1.000	1.109	0,03	NRG Energy, Inc. 3,375 % fällig am 15.02.2029	2.000	1.964	0,05	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 2,730 % fällig am 25.12.2036 ^	195	193	0,01
WW International, Inc. 4,500 % fällig am 15.04.2029	5.000	5.044	0,12	3,625 % fällig am 15.02.2031	4.250	4.182	0,10	3,066 % fällig am 25.10.2036 ^	118	119	0,00
Wyndham Hotels & Resorts, Inc. 4,375 % fällig am 15.08.2028	3.000	3.124	0,07	5,250 % fällig am 15.06.2029	1.250	1.331	0,03			1.115	0,03
Wynn Las Vegas LLC 5,250 % fällig am 15.05.2027	2.125	2.289	0,05	6,625 % fällig am 15.01.2027	2.750	2.850	0,07	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
5,500 % fällig am 01.03.2025	3.000	3.238	0,08	NSG Holdings LLC 7,750 % fällig am 15.12.2025	1.779	1.902	0,05	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 0,162 % fällig am 25.01.2037 ^	86	36	0,00
Wynn Macau Ltd. 5,125 % fällig am 15.12.2029	1.500	1.549	0,04	PG&E Corp. 5,000 % fällig am 01.07.2028	2.000	2.025	0,05	AKTIEN			
5,500 % fällig am 01.10.2027	2.500	2.609	0,06	5,250 % fällig am 01.07.2030	5.000	5.062	0,12	STAMMAKTIE			
Wynn Resorts Finance LLC 5,125 % fällig am 01.10.2029	3.000	3.173	0,07	Sprint Capital Corp. 6,875 % fällig am 15.11.2028	5.000	6.419	0,15	KOMMUNIKATIONSDIENSTE			
XPO Logistics, Inc. 6,250 % fällig am 01.05.2025	4.000	4.260	0,10	8,750 % fällig am 15.03.2032	7.500	11.409	0,27	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)	167.378	442	0,01
6,750 % fällig am 15.08.2024	1.750	1.820	0,04	Sprint Corp. 7,125 % fällig am 15.06.2024	5.000	5.775	0,14	iHeartMedia, Inc. 'A' (c)	38.621	1.040	0,02
Yum! Brands, Inc. 3,625 % fällig am 15.03.2031	5.000	4.981	0,12	7,250 % fällig am 15.09.2021	10.000	10.169	0,24	iHeartMedia, Inc. 'B' (c)	29.972	726	0,02
4,625 % fällig am 31.01.2032	5.000	5.264	0,12	7,625 % fällig am 15.02.2025	8.750	10.407	0,25			2.208	0,05
4,750 % fällig am 15.01.2030	2.500	2.710	0,06	7,625 % fällig am 01.03.2026	3.000	3.668	0,09	ENERGIE			
6,875 % fällig am 15.11.2037	2.000	2.491	0,06	7,875 % fällig am 15.09.2023	10.000	11.373	0,27	CHC Group LLC (c)	77.756	3	0,00
Zayo Group Holdings, Inc. 4,000 % fällig am 01.03.2027	3.000	2.983	0,07	Talen Energy Supply LLC 6,500 % fällig am 01.06.2025	2.000	1.347	0,03	Diamond Offshore Drilling, Inc. (c)(i)	50.195	308	0,01
6,125 % fällig am 01.03.2028	10.000	10.226	0,24	6,625 % fällig am 15.01.2028	1.000	917	0,02	Noble Corp. (c)	36.603	905	0,02
Ziggo Bond Co. BV 3,375 % fällig am 28.02.2030	2.000	2.346	0,06	7,250 % fällig am 15.05.2027	2.000	1.869	0,04	Noble Corp. (c)(i)	402.310	9.949	0,23
5,125 % fällig am 28.02.2030 \$	3.750	3.846	0,09	10,500 % fällig am 15.01.2026	3.000	2.173	0,05	Valaris Ltd. (c)	67.287	1.943	0,05
6,000 % fällig am 15.01.2027	5.000	5.244	0,12	Tallgrass Energy Partners LP 5,500 % fällig am 15.09.2024	3.309	3.363	0,08			13.108	0,31
Ziggo BV 4,875 % fällig am 15.01.2030	2.200	2.258	0,05	5,500 % fällig am 15.01.2028	1.750	1.783	0,04	FINANZWERT			
5,500 % fällig am 15.01.2027	4.145	4.317	0,10	6,000 % fällig am 31.12.2030	3.000	3.127	0,07	DB Investors, Inc. (c)(i)	30	0	0,00
		3.186.475	75,01	7,500 % fällig am 01.10.2025	1.000	1.098	0,03	Voyager Aviation Holdings LLC (c)	833	0	0,00
				Targa Resources Partners LP 4,000 % fällig am 15.01.2032	4.000	4.120	0,10			0	0,00
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				4,875 % fällig am 01.02.2031	4.000	4.335	0,10	BAUSTOFFE			
Antero Midstream Partners LP 5,375 % fällig am 15.06.2029	4.000	4.175	0,10	5,000 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.281	0,12	Associated Materials Group, Inc. (c)(i)	2.063.103	14.607	0,34
5,750 % fällig am 01.03.2027	1.000	1.043	0,02	5,500 % fällig am 01.03.2030	500	551	0,01	Hexion Holdings Corp. 'B' (c)(i)	56.075	1.037	0,03
Blue Racer Midstream LLC 6,625 % fällig am 15.07.2026	2.000	2.097	0,05	5,875 % fällig am 15.04.2026	2.000	2.106	0,05			15.644	0,37
7,625 % fällig am 15.12.2025	2.500	2.712	0,06	6,500 % fällig am 15.07.2027	2.500	2.717	0,06			30.960	0,73
Calpine Corp. 3,750 % fällig am 01.03.2031	5.000	4.768	0,11	6,875 % fällig am 15.01.2029	2.000	2.257	0,05	OPTIONSSCHEINE			
4,500 % fällig am 15.02.2028	3.000	3.064	0,07	Telecom Italia Capital S.A. 6,375 % fällig am 15.11.2033	3.500	4.187	0,10	DB Investors, Inc. - Exp. 28.06.2069 (i)	113	0	0,00
4,625 % fällig am 01.02.2029	1.500	1.479	0,04	7,200 % fällig am 18.07.2036	2.000	2.582	0,06	VORZUGSWERTPAPIERE			
4,625 % fällig am 01.02.2029	1.500	1.479	0,04	Telecom Italia SpA 5,303 % fällig am 30.05.2024	3.500	3.840	0,09	Sequa Corp. 15,000 %	3.748	4.014	0,09
5,000 % fällig am 01.02.2031	1.500	1.496	0,04	TerraForm Power Operating LLC 4,250 % fällig am 31.01.2023	3.000	3.083	0,07	Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	5.000	1.553	0,04
5,125 % fällig am 15.03.2028	4.000	4.076	0,10	4,750 % fällig am 15.01.2030	2.000	2.052	0,05			5.567	0,13
Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	10.000	9.963	0,23	5,000 % fällig am 31.01.2028	3.750	3.982	0,09				
Covanta Holding Corp. 5,000 % fällig am 01.09.2030	1.000	1.053	0,02	Transocean Sentry Ltd. 5,375 % fällig am 15.05.2023	2.757	2.706	0,06	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
5,875 % fällig am 01.07.2025	1.500	1.556	0,04	Vistra Operations Co. LLC 5,000 % fällig am 31.07.2027	3.250	3.341	0,08	U.S. TREASURY BILLS			
6,000 % fällig am 01.01.2027	2.000	2.087	0,05	5,625 % fällig am 15.02.2027	2.125	2.207	0,05	0,010 % fällig am 14.09.2021 (d)(e)(k) \$	7.000	6.999	0,17
Crestwood Midstream Partners LP 5,625 % fällig am 01.05.2027	4.250	4.374	0,10	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		234.387	5,52	0,015 % fällig am 21.09.2021 (d)(e)(k)	3.000	3.000	0,07
6,000 % fällig am 01.02.2029	2.000	2.098	0,05			3.775.499	88,88			9.999	0,24
CrownRock LP 5,000 % fällig am 01.05.2029	2.750	2.892	0,07	NON-AGENCY-MBS				Summe kurzfristige Instrumente		9.999	0,24
5,625 % fällig am 15.10.2025	6.000	6.227	0,15	Banc of America Funding Trust 2,890 % fällig am 20.02.2036 ^	110	107	0,00	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	3.883.310	91,42
Embarq Corp. 7,995 % fällig am 01.06.2036	1.250	1.419	0,03	Countrywide Alternative Loan Trust 0,553 % fällig am 20.05.2046 ^	72	63	0,00				
Endeavor Energy Resources LP 5,500 % fällig am 30.01.2026	2.000	2.084	0,05	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0,732 % fällig am 25.03.2035	23	20	0,00				
5,750 % fällig am 30.01.2028	5.000	5.338	0,13	0,792 % fällig am 25.02.2036 ^	17	9	0,00				
6,625 % fällig am 15.07.2025	2.000	2.146	0,05	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust 5,863 % fällig am 25.02.2037 ^	379	127	0,01				
Genesis Energy LP 6,500 % fällig am 01.10.2025	3.000	3.036	0,07	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	53	52	0,00				
7,750 % fällig am 01.02.2028	1.750	1.811	0,04	GSR Mortgage Loan Trust 2,756 % fällig am 25.04.2035	2	2	0,00				
8,000 % fällig am 15.01.2027	2.000	2.104	0,05	IndyMac Mortgage Loan Trust 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	238	227	0,01				
High Ridge Brands Co. 8,875 % fällig am 15.03.2025	2.500	34	0,00	MortgageIT Trust 0,732 % fällig am 25.02.2035	56	56	0,00				
Lumen Technologies, Inc. 4,500 % fällig am 15.01.2029	7.000	6.840	0,16	Residential Accredit Loans, Inc. Trust 0,632 % fällig am 25.05.2046 ^	107	95	0,00				
5,800 % fällig am 15.03.2022	4.000	4.121	0,10								
NGL Energy Operating LLC 7,500 % fällig am 01.02.2026	5.000	5.256	0,12								

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Funds: Global			
Investors Series plc – PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)	661.211	\$ 7.835	0,18
PIMCO Select Funds plc – PIMCO			
US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	29.366.634	292.521	6,89
		300.356	7,07
Summe Investmentfonds		\$ 300.356	7,07

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000 %	20.12.2025	\$ 225.000	\$ 5.658	0,13
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ 5.658	0,13

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR plus festgelegter Spread	\$ 63.000	20.09.2021	\$ (28)	\$ 520	\$ 492	0,01
JPM	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR plus festgelegter Spread	12.000	20.09.2021	(5)	74	69	0,00
							\$ (33)	\$ 594	\$ 561	0,01

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 2.267	€ 1.862	\$ 0	\$ (59)	\$ (59)	0,00
BPS	07.2021	€ 1.973	\$ 2.393	53	0	53	0,00
GLM	07.2021	£ 10.156	14.358	327	0	327	0,00
HUS	07.2021	\$ 2.253	€ 1.842	0	(68)	(68)	0,00
	07.2021	14.057	€ 10.156	0	(27)	(27)	0,00
	08.2021	€ 10.156	\$ 14.058	27	0	27	0,00
	08.2021	¥ 8.437	78	2	0	2	0,00
MYI	07.2021	€ 7.265	8.664	50	0	50	0,00
	07.2021	\$ 48	€ 40	0	0	0	0,00
	07.2021	€ 126	£ 91	0	0	0	0,00
SCX	07.2021	€ 99.471	\$ 121.688	3.724	0	3.724	0,09
				\$ 4.183	\$ (154)	\$ 4.029	0,09

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 1.209	CHF 1.085	\$ 0	\$ (36)	\$ (36)	0,00
CBK	07.2021	CHF 1.283	\$ 1.393	6	0	6	0,00
	07.2021	\$ 1.205	CHF 1.080	0	(36)	(36)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen US High Yield Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2021	\$ 1.394	CHF 1.283	\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00
MYI	07.2021	1.188	1.071	0	(30)	(30)	0,00
SCX	07.2021	28	26	0	0	0	0,00
SSB	07.2021	CHF 7	\$ 8	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 560	CHF 515	0	(3)	(3)	0,00
UAG	07.2021	20	18	0	0	0	0,00
				\$ 6	\$ (111)	\$ (105)	0,00

Zum 30. Juni 2021 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€ 4.986	\$ 6.067	\$ 154	\$ 0	\$ 154	0,00
	07.2021	\$ 197	€ 162	0	(5)	(5)	0,00
BPS	07.2021	€ 1	\$ 2	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 241.387	€ 197.436	0	(7.247)	(7.247)	(0,17)
BRC	07.2021	€ 113	\$ 137	4	0	4	0,00
HUS	07.2021	\$ 4.799	€ 3.972	0	(89)	(89)	0,00
MYI	07.2021	8.718	7.322	0	(34)	(34)	0,00
SCX	07.2021	€ 333	\$ 405	10	0	10	0,00
	07.2021	\$ 276.062	€ 225.657	0	(8.455)	(8.455)	(0,20)
TOR	07.2021	276.062	225.657	0	(8.455)	(8.455)	(0,20)
UAG	07.2021	134	110	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 168	\$ (24.288)	\$ (24.120)	(0,57)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 2	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07.2021	\$ 29	£ 21	0	0	0	0,00
GLM	07.2021	24.144	17.078	0	(551)	(551)	(0,01)
HUS	07.2021	£ 18.600	\$ 25.745	50	0	50	0,00
	07.2021	\$ 168	£ 118	0	(4)	(4)	0,00
	08.2021	25.678	18.551	0	(48)	(48)	0,00
MYI	07.2021	£ 6	\$ 9	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 1.060	£ 764	0	(5)	(5)	0,00
SCX	07.2021	24.480	17.220	0	(691)	(691)	(0,02)
SSB	07.2021	£ 18.620	\$ 25.733	9	0	9	0,00
	07.2021	\$ 21	£ 15	0	(1)	(1)	0,00
	08.2021	25.638	18.551	0	(9)	(9)	0,00
UAG	07.2021	24.198	17.078	0	(605)	(605)	(0,01)
				\$ 59	\$ (1.914)	\$ (1.855)	(0,04)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (21.490) (0,51)

Summe Anlagen

\$ 4.167.834 98,11

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 80.446 1,89

Nettovermögen

\$ 4.248.280 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- Wertpapier per Emissionstermin.
- Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- Mit dem Fonds verbunden.
- Bedingt wandelbares Wertpapier.
- Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Associated Materials Group, Inc.	24.08.2020	\$ 13.101	\$ 14.607	0,34
DB Investors, Inc.	18.02.2015	0	0	0,00

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettover-mögens
DB Investors, Inc. - Exp. 28. Juni 2069	18.02.2015	\$ 0	\$ 0	0,00
Diamond Assets LLC 13,000 % fällig am 22.04.2027	12.05.2021	115	116	0,00
Diamond Offshore Drilling, Inc.	12.05.2021	0	308	0,01
Hexion Holdings Corp. 'B'	02.07.2013 - 15.06.2018	4.119	1.037	0,03
Noble Corp.	05.02.2021 - 25.02.2021	5.157	9.949	0,23
Occidental Petroleum Corp. 5,500 % fällig am 01.12.2025	08.12.2020	4.000	4.433	0,10
Occidental Petroleum Corp. 6,125 % fällig am 01.01.2031	08.12.2020 - 23.03.2021	1.268	1.472	0,03
		\$ 27.760	\$ 31.922	0,74

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 7.184 als Sicherheiten verpfändet.

(k) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 5.623 und Barmittel in Höhe von USD 13.280 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 12 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 18.297 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert¹

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 13.377	\$ 3.848.589	\$ 21.344	\$ 3.883.310
Investmentfonds	300.356	0	0	300.356
Finanzderivate ⁽³⁾	0	(15.832)	0	(15.832)
Summen	\$ 313.733	\$ 3.832.757	\$ 21.344	\$ 4.167.834

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.138	\$ 3.549.523	\$ 23.296	\$ 3.573.957
Investmentfonds	393.709	0	0	393.709
Pensionsgeschäfte	0	30.800	0	30.800
Finanzderivate ⁽³⁾	0	25.538	0	25.538
Summen	\$ 394.847	\$ 3.605.861	\$ 23.296	\$ 4.024.004

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BRC	(0,750) %	17.11.2020	TBD ⁽¹⁾	\$ (921)	\$ (916)	(0,02)
RDR	(1,500)	11.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(500)	(500)	(0,01)
	(0,500)	09.06.2021	TBD ⁽¹⁾	(3.958)	(3.956)	(0,09)
	(0,100)	07.04.2021	TBD ⁽¹⁾	(1.554)	(1.554)	(0,04)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (6.926)	(0,16)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 54	\$ 0	\$ 54
BPS	(6.702)	5.840	(862)
BRC	4	(10)	(6)
CBK	(36)	0	(36)
GLM	(224)	208	(16)
HUS	(157)	0	(157)
JPM	69	0	69
MYI	(19)	(10)	(29)
SCX	(5.412)	4.803	(609)
SSB	(4)	0	(4)
TOR	(8.455)	7.440	(1.015)
UAG	(608)	612	4

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	37,93	41,03
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	52,69	43,49
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,80	3,62
Investmentfonds	7,07	9,71
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,76
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,13	0,15
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,51)	0,48
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,16)	(0,38)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,41	2,19
Unternehmensanleihen und Wechsel	88,88	81,68
US-Schatzobligationen	k. A.	1,50
Non-Agency-MBS	0,03	0,03
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,00	0,00
Stammaktien	0,73	0,39
Optionsscheine	0,00	0,02
Vorzugswertpapiere	0,13	0,13
Kurzfristige Instrumente	0,24	2,20
Investmentfonds	7,07	9,71
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,76
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,13	0,15
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	0,01	0,17
Devisenterminkontrakte	0,09	(0,05)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,61)	0,36
Sonstige Aktiva und Passiva	1,89	0,76
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
5,250 % fällig am 11.02.2027 (d)(f)	\$ 300	\$ 318	0,03	GE Capital Funding LLC				ING Groep NV			
6,375 % fällig am 21.08.2026 (d)(f)	700	781	0,07	3,450 % fällig am 15.05.2025	\$ 1.600	\$ 1.742	0,16	4,875 % fällig am 16.05.2029 (d)(f)	\$ 2.100	\$ 2.198	0,21
7,250 % fällig am 12.09.2025 (d)(f)	1.900	2.149	0,20	4,400 % fällig am 15.05.2030	5.050	5.889	0,55	6,875 % fällig am 16.04.2022 (d)(f)	1.200	1.250	0,12
7,500 % fällig am 17.07.2023 (d)(f)	600	654	0,06	4,550 % fällig am 15.05.2032	1.050	1.256	0,12	Intercontinental Exchange, Inc.			
7,500 % fällig am 11.12.2023 (d)(f)	400	445	0,04	GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.				2,100 % fällig am 15.06.2030	2.200	2.185	0,20
Crown Castle International Corp.				3,373 % fällig am 15.11.2025	1.000	1.092	0,10	3,000 % fällig am 15.09.2060	700	679	0,06
3,100 % fällig am 15.11.2029	900	957	0,09	General Motors Financial Co., Inc.				3,750 % fällig am 21.09.2028	300	338	0,03
3,700 % fällig am 15.06.2026	2.238	2.465	0,23	1,275 % fällig am 06.11.2021	400	401	0,04	Intesa Sanpaolo SpA			
4,000 % fällig am 01.03.2027	200	224	0,02	1,509 % fällig am 30.06.2022	100	101	0,01	3,250 % fällig am 23.09.2024	2.600	2.767	0,26
4,150 % fällig am 01.07.2050	700	802	0,07	1,736 % fällig am 14.01.2022	1.700	1.712	0,16	7,750 % fällig am 11.01.2027 (d)(f)	€ 400	582	0,05
4,300 % fällig am 15.02.2029	600	691	0,06	5,250 % fällig am 01.03.2026	300	347	0,03	Itau Unibanco Holding S.A.			
4,450 % fällig am 15.02.2026	100	113	0,01	Global Atlantic Fin Co.				2,900 % fällig am 24.01.2023	\$ 1.500	1.536	0,14
CubeSmart LP				3,125 % fällig am 15.06.2031	200	202	0,02	JAB Holdings BV			
3,125 % fällig am 01.09.2026	600	642	0,06	4,400 % fällig am 15.10.2029	800	885	0,08	2,200 % fällig am 23.11.2030	1.600	1.557	0,15
CyrusOne LP				Globe Life, Inc.				Jefferies Finance LLC			
3,450 % fällig am 15.11.2029	100	106	0,01	2,150 % fällig am 15.08.2030	700	689	0,06	6,250 % fällig am 03.06.2026	1.300	1.365	0,13
DAE Sukuk DfC Ltd.				GLP Capital LP				JPMorgan Chase & Co.			
3,750 % fällig am 15.02.2026	1.200	1.273	0,12	3,350 % fällig am 01.09.2024	700	743	0,07	1,063 % fällig am 23.07.2024	900	913	0,09
Deutsche Bank AG				4,000 % fällig am 15.01.2031	300	324	0,03	2,182 % fällig am 01.06.2028	700	717	0,07
0,898 % fällig am 28.05.2024 (g)	1.900	1.892	0,18	5,750 % fällig am 01.06.2028	700	834	0,08	2,580 % fällig am 22.04.2032	5.100	5.238	0,49
1,346 % fällig am 16.11.2022	500	504	0,05	Goldman Sachs Group, Inc.				3,220 % fällig am 01.03.2025	200	213	0,02
1,369 % fällig am 27.02.2023	600	606	0,06	1,735 % fällig am 29.11.2023	100	103	0,01	3,509 % fällig am 23.01.2029	1.105	1.219	0,11
1,447 % fällig am 01.04.2025 (g)	1.900	1.912	0,18	2,615 % fällig am 22.04.2032	1.000	1.022	0,10	3,782 % fällig am 01.02.2028	40	44	0,00
1,750 % fällig am 19.11.2030	€ 1.900	2.384	0,22	3,500 % fällig am 23.01.2025	2.050	2.217	0,21	3,960 % fällig am 29.01.2027	6.100	6.798	0,64
2,222 % fällig am 18.09.2024	\$ 1.000	1.027	0,10	3,500 % fällig am 16.11.2026	365	397	0,04	4,000 % fällig am 01.04.2025 (d)	2.900	2.940	0,27
2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 200	289	0,03	3,691 % fällig am 05.06.2028	655	724	0,07	Kaisa Group Holdings Ltd.			
3,035 % fällig am 28.05.2032 (g)	\$ 400	408	0,04	3,750 % fällig am 22.05.2025	256	280	0,03	8,500 % fällig am 30.06.2022	600	599	0,06
3,950 % fällig am 27.02.2023	1.600	1.681	0,16	3,814 % fällig am 23.04.2029	25	28	0,00	9,750 % fällig am 28.09.2023	1.600	1.582	0,15
4,625 % fällig am 30.10.2027 (d)(f)	€ 200	247	0,02	3,850 % fällig am 08.07.2024	700	757	0,07	11,250 % fällig am 09.04.2022	300	307	0,03
4,789 % fällig am 30.04.2025 (d)(f)	\$ 200	201	0,02	4,223 % fällig am 01.05.2029	3.700	4.223	0,39	KBC Group NV			
5,625 % fällig am 19.05.2031	€ 800	1.124	0,11	Goodman HK Finance				4,250 % fällig am 24.10.2025 (d)(f)	€ 600	757	0,07
Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust				4,375 % fällig am 19.06.2024	200	217	0,02	Kilroy Realty LP			
5,250 % fällig am 30.05.2025	\$ 443	445	0,04	Goodman U.S. Finance Three LLC				3,050 % fällig am 15.02.2030	\$ 1.800	1.876	0,18
E*TRADE Financial Corp.				3,700 % fällig am 15.03.2028	1.100	1.193	0,11	KKR Group Finance Co. LLC			
4,500 % fällig am 20.06.2028	1.000	1.159	0,11	Great-West Lifeco Finance LP				3,625 % fällig am 25.02.2050	700	752	0,07
Easy Tactic Ltd.				4,581 % fällig am 17.05.2048	300	380	0,04	KWG Group Holdings Ltd.			
11,750 % fällig am 02.08.2023	800	787	0,07	Greenland Global Investment Ltd.				5,875 % fällig am 10.11.2024	300	303	0,03
Enact Holdings, Inc.				6,250 % fällig am 16.12.2022	500	480	0,04	6,000 % fällig am 15.09.2022	200	203	0,02
6,500 % fällig am 15.08.2025	200	221	0,02	Hanover Insurance Group, Inc.				Lazard Group LLC			
EPR Properties				4,500 % fällig am 15.04.2026	1.200	1.358	0,13	3,625 % fällig am 01.03.2027	100	109	0,01
4,500 % fällig am 01.06.2027	450	480	0,04	Healthcare Trust of America Holdings LP				3,750 % fällig am 13.02.2025	300	328	0,03
4,750 % fällig am 15.12.2026	100	109	0,01	3,750 % fällig am 01.07.2027	800	891	0,08	4,500 % fällig am 19.09.2028	200	231	0,02
4,950 % fällig am 15.04.2028	400	432	0,04	Healthpeak Properties, Inc.				Legg Mason, Inc.			
Equitable Holdings, Inc.				3,000 % fällig am 15.01.2030	100	106	0,01	5,625 % fällig am 15.01.2044	200	280	0,03
4,350 % fällig am 20.04.2028	200	230	0,02	Highwoods Realty LP				Life Storage LP			
5,000 % fällig am 20.04.2048	1.800	2.301	0,21	4,125 % fällig am 15.03.2028	500	561	0,05	3,875 % fällig am 15.12.2027	800	894	0,08
ERP Operating LP				4,200 % fällig am 15.04.2029	200	225	0,02	Lloyds Bank PLC			
3,250 % fällig am 01.08.2027	100	109	0,01	Host Hotels & Resorts LP				7,500 % fällig am 02.04.2032	200	158	0,01
Erste Group Bank AG				3,500 % fällig am 15.09.2030	1.300	1.366	0,13	Lloyds Banking Group PLC			
4,250 % fällig am 15.10.2027 (d)(f)	€ 200	254	0,02	3,875 % fällig am 01.04.2024	100	107	0,01	4,375 % fällig am 22.03.2028	800	920	0,09
5,125 % fällig am 15.10.2025 (d)(f)	200	263	0,02	4,000 % fällig am 15.06.2025	1.233	1.336	0,12	4,450 % fällig am 08.05.2025	1.000	1.123	0,10
Essex Portfolio LP				4,500 % fällig am 01.02.2026	500	550	0,05	MGM Growth Properties Operating Partnership LP			
3,500 % fällig am 01.04.2025	\$ 725	785	0,07	HSBC Capital Funding Dollar LP				3,875 % fällig am 15.02.2029	300	305	0,03
3,625 % fällig am 01.05.2027	1.300	1.437	0,13	10,176 % fällig am 30.06.2030 (d)	400	663	0,06	4,500 % fällig am 15.01.2028	100	106	0,01
Fairfax Financial Holdings Ltd.				HSBC Holdings PLC				5,625 % fällig am 01.05.2024	400	434	0,04
2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 200	261	0,02	1,645 % fällig am 18.04.2026	1.600	1.622	0,15	5,750 % fällig am 01.02.2027	100	111	0,01
4,625 % fällig am 29.04.2030	\$ 1.400	1.607	0,15	2,099 % fällig am 04.06.2026	900	926	0,09	Mid-America Apartments LP			
4,850 % fällig am 17.04.2028	300	346	0,03	2,357 % fällig am 18.08.2031	1.600	1.603	0,15	3,750 % fällig am 15.06.2024	1.000	1.082	0,10
Federal Realty Investment Trust				2,633 % fällig am 07.11.2025	700	735	0,07	4,200 % fällig am 15.06.2028	400	459	0,04
1,250 % fällig am 15.02.2026	400	397	0,04	2,848 % fällig am 04.06.2031	800	831	0,08	Mitsubishi HC Capital, Inc.			
3,500 % fällig am 01.06.2030	400	440	0,04	3,950 % fällig am 18.05.2024	800	850	0,08	2,652 % fällig am 19.09.2022	300	307	0,03
Fidelity National Financial, Inc.				3,973 % fällig am 22.05.2030	4.600	5.153	0,48	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
2,450 % fällig am 15.03.2031	200	200	0,02	4,041 % fällig am 13.03.2028	600	666	0,06	0,966 % fällig am 25.07.2022	100	101	0,01
First American Financial Corp.				4,292 % fällig am 12.09.2026	1.000	1.114	0,10	1,036 % fällig am 26.07.2023	2.700	2.737	0,26
4,300 % fällig am 01.02.2023	200	211	0,02	4,300 % fällig am 08.03.2026	1.200	1.355	0,13	1,412 % fällig am 17.07.2025	4.100	4.141	0,39
Ford Motor Credit Co. LLC				4,583 % fällig am 19.06.2029	400	463	0,04	Mizuho Financial Group, Inc.			
1,256 % fällig am 03.08.2022	1.700	1.694	0,16	4,750 % fällig am 04.07.2029 (d)(f)	€ 200	269	0,03	0,786 % fällig am 08.09.2024	1.600	1.609	0,15
1,463 % fällig am 28.03.2022	200	200	0,02	5,875 % fällig am 28.09.2026 (d)(f)	£ 700	1.087	0,10	1,057 % fällig am 11.09.2022	200	202	0,02
1,744 % fällig am 19.07.2024	€ 1.000	1.205	0,11	6,000 % fällig am 22.05.2027 (d)(f)	\$ 900	1.001	0,09	2,201 % fällig am 10.07.2031	2.600	2.599	0,24
2,386 % fällig am 17.02.2026	200	247	0,02	6,375 % fällig am 17.09.2024 (d)(f)	400	443	0,04	2,721 % fällig am 16.07.2023	800	819	0,08
3,087 % fällig am 09.01.2023	\$ 400	409	0,04	6,500 % fällig am 23.03.2028 (d)(f)	500	574	0,05	3,153 % fällig am 16.07.2030	2.400	2.589	0,24
3,550 % fällig am 07.10.2022	300	308	0,03	6,500 % fällig am 15.09.2037	100	139	0,01	Morgan Stanley			
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				6,800 % fällig am 01.06.2038	220	316	0,03	0,735 % fällig am 03.02.2023 (g) CAD	2.000	1.617	0,15
6,500 % fällig am 01.10.2025	600	624	0,06	Hudson Pacific Properties LP				2,188 % fällig am 28.04.2026	\$ 3.600	3.740	0,35
Freedom Mortgage Corp.				3,250 % fällig am 15.01.2030	1.000	1.057	0,10	MPT Operating Partnership LP			
7,625 % fällig am 01.05.2026	900	938	0,09	4,650 % fällig am 01.04.2029	100	115	0,01	2,550 % fällig am 05.12.2023	£ 200	284	0,03
8,125 % fällig am 15.11.2024	1.000	1.037	0,10	Indian Railway Finance Corp. Ltd.				3,500 % fällig am 15.03.2031	\$ 900	910	0,09
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.				3,249 % fällig am 13.02.2030	800	812	0,08	4,625 % fällig am 01.08.2029	600	644	0,06
3,400 % fällig am 30.09.2026	500	546	0,05								

Aufstellung der Wertpapieranlagen US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VER-MÖGENS
Anthem, Inc. 3,650 % fällig am 01.12.2027	\$ 100	\$ 112	0,01	Builders FirstSource, Inc. 6,750 % fällig am 01.06.2027	\$ 492	\$ 528	0,05	Dell International LLC 5,300 % fällig am 01.10.2029	\$ 100	\$ 121	0,01
AP Moller - Maersk A/S 3,750 % fällig am 22.09.2024	800	863	0,08	Caesars Entertainment, Inc. 6,250 % fällig am 01.07.2025	2.600	2.759	0,26	5,450 % fällig am 15.06.2023	400	434	0,04
Apple, Inc. 2,950 % fällig am 11.09.2049	2.400	2.484	0,23	Caesars Resort Collection LLC 5,750 % fällig am 01.07.2025	300	317	0,03	6,020 % fällig am 15.06.2026	8.050	9.669	0,90
APT Pipelines Ltd. 4,250 % fällig am 15.07.2027	4.090	4.520	0,42	3,302 % fällig am 15.01.2035	1.400	1.505	0,14	6,200 % fällig am 15.07.2030	900	1.158	0,11
Aptiv Corp. 4,150 % fällig am 15.03.2024	100	109	0,01	3,701 % fällig am 15.01.2039	900	1.005	0,09	Delta Air Lines Pass-Through Trust 2,000 % fällig am 10.12.2029	1.034	1.042	0,10
Aptiv PLC 4,350 % fällig am 15.03.2029	200	230	0,02	Campbell Soup Co. 2,375 % fällig am 24.04.2030	1.800	1.816	0,17	Delta Air Lines, Inc. 2,900 % fällig am 28.10.2024	1.600	1.629	0,15
Arrow Electronics, Inc. 3,250 % fällig am 08.09.2024	200	213	0,02	Carrier Global Corp. 2,242 % fällig am 15.02.2025	1.200	1.248	0,12	3,625 % fällig am 15.03.2022	800	811	0,08
3,500 % fällig am 01.04.2022	555	564	0,05	CCO Holdings LLC 4,250 % fällig am 01.02.2031	400	408	0,04	4,750 % fällig am 20.10.2028	300	334	0,03
Ashtead Capital, Inc. 4,000 % fällig am 01.05.2028	400	422	0,04	Centene Corp. 2,450 % fällig am 15.07.2028 (a)	1.100	1.116	0,10	7,000 % fällig am 01.05.2025	1.800	2.102	0,20
4,250 % fällig am 01.11.2029	800	866	0,08	Central Nippon Expressway Co. Ltd. 2,091 % fällig am 14.09.2021	2.000	2.007	0,19	Devon Energy Corp. 5,250 % fällig am 15.09.2024	32	36	0,00
AstraZeneca PLC 0,821 % fällig am 17.08.2023	1.787	1.805	0,17	Charter Communications Operating LLC 3,850 % fällig am 01.04.2061	3.400	3.345	0,31	Diamond Sports Group LLC 5,375 % fällig am 15.08.2026	1.800	1.168	0,11
4,000 % fällig am 17.01.2029	1.400	1.610	0,15	3,900 % fällig am 01.06.2052	5.000	5.106	0,48	Diamondback Energy, Inc. 4,750 % fällig am 31.05.2025	900	1.014	0,09
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 9.100	11.121	1,04	4,200 % fällig am 15.03.2028	1.500	1.700	0,16	Eastern Energy Gas Holdings LLC 3,900 % fällig am 15.11.2049	2.300	2.491	0,23
B.C. Unlimited Liability Co. 4,250 % fällig am 15.05.2024	\$ 52	53	0,01	4,800 % fällig am 01.03.2050	2.400	2.762	0,26	eBay, Inc. 2,600 % fällig am 10.05.2031	1.300	1.324	0,12
Bacardi Ltd. 4,450 % fällig am 15.05.2025	500	556	0,05	4,908 % fällig am 23.07.2025	1.700	1.927	0,18	Embraer Netherlands Finance BV 5,050 % fällig am 15.06.2025	100	106	0,01
BAE Systems PLC 3,400 % fällig am 15.04.2030	200	218	0,02	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 3,700 % fällig am 15.11.2029	2.100	2.296	0,21	Enbridge, Inc. 0,655 % fällig am 18.02.2022	2.000	2.005	0,19
Baidu, Inc. 1,720 % fällig am 09.04.2026	200	202	0,02	5,875 % fällig am 31.03.2025	1.200	1.376	0,13	4,250 % fällig am 01.12.2026	300	338	0,03
Baker Hughes a GE Co. LLC 3,337 % fällig am 15.12.2027	500	547	0,05	Chesapeake Energy Corp. 5,500 % fällig am 01.02.2026	1.000	1.058	0,10	Energy Transfer LP 3,900 % fällig am 15.07.2026	1.000	1.093	0,10
Baptist Healthcare System Obligated Group 3,540 % fällig am 15.08.2050	300	324	0,03	Cielo USA, Inc. 3,750 % fällig am 16.11.2022	600	616	0,06	4,200 % fällig am 15.04.2027	300	332	0,03
BAT Capital Corp. 1,125 % fällig am 16.11.2023	€ 100	121	0,01	Citrix Systems, Inc. 3,300 % fällig am 01.03.2030	1.100	1.159	0,11	4,250 % fällig am 15.03.2023	740	777	0,07
BAT International Finance PLC 1,668 % fällig am 25.03.2026	\$ 1.800	1.800	0,17	4,500 % fällig am 01.12.2027	600	681	0,06	4,500 % fällig am 15.04.2024	400	436	0,04
Bayer U.S. Finance LLC 1,194 % fällig am 15.12.2023	900	913	0,09	Comcast Corp. 3,900 % fällig am 01.03.2038	100	115	0,01	4,750 % fällig am 15.01.2026	250	282	0,03
4,250 % fällig am 15.12.2025	1.300	1.450	0,14	5,650 % fällig am 15.06.2035	4.100	5.559	0,52	5,150 % fällig am 15.03.2045	800	927	0,09
4,375 % fällig am 15.12.2028	2.800	3.211	0,30	CommonSpirit Health 2,760 % fällig am 01.10.2024	400	421	0,04	5,300 % fällig am 01.10.2043	60	70	0,01
Beacon Roofing Supply, Inc. 4,500 % fällig am 15.11.2026	400	420	0,04	Community Health Systems, Inc. 5,625 % fällig am 15.03.2027	200	214	0,02	5,500 % fällig am 01.06.2027	1.200	1.409	0,13
Berry Global, Inc. 1,570 % fällig am 15.01.2026	3.000	3.005	0,28	6,625 % fällig am 15.02.2025	1.300	1.376	0,13	5,950 % fällig am 01.10.2043	100	125	0,01
Boardwalk Pipelines LP 3,400 % fällig am 15.02.2031	900	956	0,09	Conagra Brands, Inc. 5,300 % fällig am 01.11.2038	1.000	1.274	0,12	6,125 % fällig am 15.12.2045	5	6	0,00
Boeing Co. 3,250 % fällig am 01.02.2028	600	637	0,06	Constellation Brands, Inc. 3,200 % fällig am 15.02.2023	600	626	0,06	6,500 % fällig am 01.02.2042	100	130	0,01
3,600 % fällig am 01.05.2034	600	634	0,06	3,700 % fällig am 06.12.2026	100	111	0,01	Energy Transfer Partners LP 5,875 % fällig am 01.03.2022	250	255	0,02
5,150 % fällig am 01.05.2030	4.300	5.096	0,48	Continental Airlines Pass-Through Trust 4,000 % fällig am 29.04.2026	250	265	0,02	Enterprise Products Operating LLC 4,200 % fällig am 31.01.2050	1.630	1.883	0,18
5,705 % fällig am 01.05.2040	5.000	6.449	0,60	4,150 % fällig am 11.10.2025	606	645	0,06	4,250 % fällig am 15.02.2048	25	29	0,00
5,930 % fällig am 01.05.2060	700	968	0,09	Continental Resources, Inc. 3,800 % fällig am 01.06.2024	200	212	0,02	5,700 % fällig am 15.02.2042	300	404	0,04
Boston Scientific Corp. 3,750 % fällig am 01.03.2026	1.450	1.609	0,15	Cox Communications, Inc. 3,500 % fällig am 15.08.2027	1.900	2.088	0,20	5,750 % fällig am 01.03.2035	1.600	2.076	0,19
4,000 % fällig am 01.03.2029	600	683	0,06	Crown Castle Towers LLC 3,720 % fällig am 15.07.2043	100	103	0,01	EQM Midstream Partners LP 4,000 % fällig am 01.08.2024	200	206	0,02
BP Capital Markets America, Inc. 3,937 % fällig am 21.09.2028	50	57	0,01	CSC Holdings LLC 5,750 % fällig am 15.01.2030	600	624	0,06	EQT Corp. 3,000 % fällig am 01.10.2022	17	17	0,00
Braskem Finance Ltd. 6,450 % fällig am 03.02.2024	600	679	0,06	CSN Inova Ventures 6,750 % fällig am 28.01.2028	400	443	0,04	Equifax, Inc. 2,600 % fällig am 15.12.2025	500	527	0,05
British Airways Pass-Through Trust 3,300 % fällig am 15.06.2034	193	197	0,02	CVS Health Corp. 3,875 % fällig am 20.07.2025	1.200	1.325	0,12	3,100 % fällig am 15.05.2030	3.000	3.229	0,30
4,125 % fällig am 20.03.2033	334	340	0,03	4,300 % fällig am 25.03.2028	2.651	3.048	0,29	ERAC USA Finance LLC 3,300 % fällig am 01.12.2026	1.000	1.091	0,10
4,250 % fällig am 15.05.2034	59	64	0,01	CVS Pass-Through Trust 5,789 % fällig am 10.01.2026	61	67	0,01	Expedia Group, Inc. 2,950 % fällig am 15.03.2031	550	558	0,05
Broadcom Corp. 3,875 % fällig am 15.01.2027	511	565	0,05	6,036 % fällig am 10.12.2028	49	57	0,01	3,600 % fällig am 15.12.2023	200	213	0,02
Broadcom, Inc. 3,419 % fällig am 15.04.2033	500	526	0,05	DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024	2.500	2.541	0,24	3,800 % fällig am 15.02.2028	1.500	1.632	0,15
3,459 % fällig am 15.09.2026	2.363	2.575	0,24	5,000 % fällig am 01.08.2024	100	103	0,01	6,250 % fällig am 01.05.2025	88	102	0,01
3,469 % fällig am 15.04.2034	569	602	0,06	5,250 % fällig am 15.11.2021	400	404	0,04	Fairstone Financial, Inc. 7,875 % fällig am 15.07.2024	700	732	0,07
4,110 % fällig am 15.09.2028	2.742	3.087	0,29	DaVita, Inc. 4,625 % fällig am 01.06.2030	2.200	2.265	0,21	FedEx Corp. 4,100 % fällig am 01.02.2045	700	801	0,07
4,150 % fällig am 15.11.2030	1.000	1.123	0,11	DCE Midstream Operating LP 5,625 % fällig am 15.07.2027	200	228	0,02	Ferguson Finance PLC 3,250 % fällig am 02.06.2030	300	324	0,03
4,300 % fällig am 15.11.2032	1.100	1.254	0,12					Fiserv, Inc. 3,500 % fällig am 01.07.2029	2.270	2.500	0,23
5,000 % fällig am 15.04.2030	1.300	1.535	0,14					Flex Ltd. 4,750 % fällig am 15.06.2025	300	335	0,03

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc. 2,375 % fällig am 16.02.2031	\$ 700	\$ 684	0,06	Las Vegas Sands Corp. 2,900 % fällig am 25.06.2025	\$ 1.500	\$ 1.564	0,15	PetSmart, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2028	\$ 300	\$ 312	0,03
Gap, Inc. 8,375 % fällig am 15.05.2023	300	338	0,03	3,200 % fällig am 08.08.2024	3.050	3.203	0,30	Phillips 66 0,900 % fällig am 15.02.2024	100	100	0,01
Gartner, Inc. 4,500 % fällig am 01.07.2028	200	212	0,02	3,500 % fällig am 18.08.2026	100	106	0,01	Phosagro DAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3,050 % fällig am 23.01.2025	400	417	0,04
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,949 % fällig am 24.01.2024	€ 300	375	0,04	3,900 % fällig am 08.08.2029	1.000	1.065	0,10	Pioneer Natural Resources Co. 4,450 % fällig am 15.01.2026	700	790	0,07
4,950 % fällig am 19.07.2022	\$ 200	208	0,02	Leidos, Inc. 2,300 % fällig am 15.02.2031	1.800	1.761	0,16	PulteGroup, Inc. 5,000 % fällig am 15.01.2027	300	352	0,03
5,150 % fällig am 11.02.2026	4.100	4.622	0,43	4,375 % fällig am 15.05.2030	600	682	0,06	QVC, Inc. 4,375 % fällig am 15.03.2023	900	950	0,09
6,510 % fällig am 07.03.2022	100	104	0,01	Level 3 Financing, Inc. 3,400 % fällig am 01.03.2027	200	213	0,02	RELX Capital, Inc. 3,000 % fällig am 22.05.2030	1.500	1.604	0,15
General Electric Co. 3,625 % fällig am 01.05.2030	3.100	3.460	0,32	3,875 % fällig am 15.11.2029	2.800	3.002	0,28	Rockies Express Pipeline LLC 3,600 % fällig am 15.05.2025	600	612	0,06
5,550 % fällig am 05.01.2026	300	356	0,03	Live Nation Entertainment, Inc. 6,500 % fällig am 15.05.2027	1.100	1.224	0,11	Rolls-Royce PLC 5,750 % fällig am 15.10.2027	1.000	1.103	0,10
Georgia-Pacific LLC 2,100 % fällig am 30.04.2027	600	620	0,06	Marriott International, Inc. 3,500 % fällig am 15.10.2032	900	957	0,09	5,750 % fällig am 15.10.2027	£ 200	303	0,03
Global Payments, Inc. 2,900 % fällig am 15.05.2030	600	626	0,06	5,750 % fällig am 01.05.2025	2.400	2.772	0,26	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,000 % fällig am 15.03.2027	\$ 500	578	0,05
goeasys Ltd. 5,375 % fällig am 01.12.2024	400	414	0,04	Marvell Technology, Inc. 4,200 % fällig am 22.06.2023	390	415	0,04	5,625 % fällig am 15.04.2023	800	860	0,08
Greene King Finance PLC 5,318 % fällig am 15.09.2031	£ 125	200	0,02	McDonald's Corp. 2,625 % fällig am 01.09.2029	800	842	0,08	5,625 % fällig am 01.03.2025	2.867	3.279	0,31
HCA, Inc. 4,500 % fällig am 15.02.2027	\$ 1.100	1.244	0,12	3,625 % fällig am 01.09.2049	150	167	0,02	5,750 % fällig am 15.10.2027	200	225	0,02
5,250 % fällig am 15.06.2026	1.000	1.158	0,11	Mead Johnson Nutrition Co. 4,600 % fällig am 01.06.2044	100	130	0,01	5,875 % fällig am 30.06.2026	300	355	0,03
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd. 5,625 % fällig am 24.10.2024	600	620	0,06	Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	1.300	1.332	0,12	6,250 % fällig am 15.03.2022	100	103	0,01
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 4,000 % fällig am 01.05.2031	550	556	0,05	5,250 % fällig am 26.04.2026	600	623	0,06	Sands China Ltd. 3,800 % fällig am 08.01.2026	300	322	0,03
5,375 % fällig am 01.05.2025	400	422	0,04	5,375 % fällig am 04.12.2029	600	635	0,06	4,600 % fällig am 08.08.2023	1.730	1.843	0,17
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC 5,000 % fällig am 01.06.2029	2.300	2.355	0,22	5,625 % fällig am 17.07.2027	300	314	0,03	5,125 % fällig am 08.08.2025	2.470	2.766	0,26
Huntsman International LLC 4,500 % fällig am 01.05.2029	1.700	1.935	0,18	5,750 % fällig am 21.07.2028	1.600	1.692	0,16	5,400 % fällig am 08.08.2028	600	697	0,07
Hyatt Hotels Corp. 3,135 % fällig am 01.09.2022	2.000	2.008	0,19	MGM China Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 18.06.2025	800	833	0,08	Santos Finance Ltd. 5,250 % fällig am 13.03.2029	300	342	0,03
Hyundai Capital America 2,000 % fällig am 15.06.2028	1.600	1.589	0,15	5,375 % fällig am 15.05.2024	200	206	0,02	Seagate HDD Cayman 4,125 % fällig am 15.01.2031	900	919	0,09
IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % Bar oder 7,125 % PIK) 6,375 % fällig am 15.05.2029 (b)	100	109	0,01	5,875 % fällig am 15.05.2026	1.100	1.156	0,11	ServiceNow, Inc. 1,400 % fällig am 01.09.2030	1.000	939	0,09
IHS Markit Ltd. 3,625 % fällig am 01.05.2024	300	323	0,03	Micron Technology, Inc. 4,663 % fällig am 15.02.2030	950	1.106	0,10	SF Holding Investment Ltd. 2,875 % fällig am 20.02.2030	1.200	1.226	0,11
4,000 % fällig am 01.03.2026	100	111	0,01	Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % fällig am 20.06.2027	200	220	0,02	Southern Co. 2,950 % fällig am 01.07.2023	70	73	0,01
4,750 % fällig am 01.08.2028	600	710	0,07	Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % fällig am 15.12.2030	£ 468	714	0,07	Southwest Airlines Co. 4,750 % fällig am 04.05.2023	1.410	1.513	0,14
Imperial Brands Finance PLC 3,125 % fällig am 26.07.2024	1.800	1.896	0,18	Moody's Corp. 3,250 % fällig am 20.05.2050	\$ 900	944	0,09	Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust 6,650 % fällig am 01.08.2022	105	107	0,01
3,875 % fällig am 26.07.2029	1.500	1.629	0,15	Motorola Solutions, Inc. 2,300 % fällig am 15.11.2030	2.300	2.262	0,21	Spectra Energy Partners LP 3,500 % fällig am 15.03.2025	1.900	2.047	0,19
4,250 % fällig am 21.07.2025	500	551	0,05	MPLX LP 3,500 % fällig am 01.12.2022	200	208	0,02	Spirit AeroSystems, Inc. 5,500 % fällig am 15.01.2025	600	639	0,06
Incitec Pivot Finance LLC 3,950 % fällig am 03.08.2027	500	545	0,05	4,500 % fällig am 15.04.2038	900	1.034	0,10	Spirit Airlines Pass-Through Trust 3,650 % fällig am 15.08.2031	503	495	0,05
Infor, Inc. 1,750 % fällig am 15.07.2025	600	613	0,06	NetApp, Inc. 2,375 % fällig am 22.06.2027	1.300	1.364	0,13	4,100 % fällig am 01.10.2029	137	143	0,01
Integrus Baptist Medical Center, Inc. 3,875 % fällig am 15.08.2050	500	566	0,05	Newcrest Finance Pty. Ltd. 4,200 % fällig am 13.05.2050	200	230	0,02	Sprint Spectrum Co. LLC 4,738 % fällig am 20.03.2025	1.594	1.714	0,16
International Flavors & Fragrances, Inc. 3,268 % fällig am 15.11.2040	1.800	1.850	0,17	5,750 % fällig am 15.11.2041	200	265	0,02	Standard Industries, Inc. 3,375 % fällig am 15.01.2031	200	192	0,02
Jazz Securities DAC 4,375 % fällig am 15.01.2029	1.000	1.038	0,10	Nissan Motor Co. Ltd. 3,043 % fällig am 15.09.2023	4.000	4.174	0,39	4,375 % fällig am 15.07.2030	1.200	1.241	0,12
JetBlue Pass-Through Trust 2,750 % fällig am 15.11.2033	282	290	0,03	4,345 % fällig am 17.09.2027	200	220	0,02	4,750 % fällig am 15.01.2028	600	629	0,06
4,000 % fällig am 15.05.2034	97	107	0,01	4,810 % fällig am 17.09.2030	300	339	0,03	5,000 % fällig am 15.02.2027	200	207	0,02
JT International Financial Services BV 3,500 % fällig am 28.09.2023	1.100	1.172	0,11	Norfolk Southern Corp. 4,100 % fällig am 15.05.2049	45	53	0,01	Station Casinos LLC 4,500 % fällig am 15.02.2028	200	204	0,02
Kansas City Southern 3,125 % fällig am 01.06.2026	300	325	0,03	4,100 % fällig am 15.05.2121	200	220	0,02	Stryker Corp. 3,650 % fällig am 07.03.2028	600	676	0,06
Keurig Dr Pepper, Inc. 5,085 % fällig am 25.05.2048	500	661	0,06	NXP BV 4,625 % fällig am 01.06.2023	1.400	1.505	0,14	Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029	1.900	1.921	0,18
Kinder Morgan Energy Partners LP 5,500 % fällig am 01.03.2044	800	1.005	0,09	4,875 % fällig am 01.03.2024	1.900	2.093	0,20	Suntory Holdings Ltd. 2,250 % fällig am 16.10.2024	900	934	0,09
6,950 % fällig am 15.01.2038	1.480	2.120	0,20	ONEOK Partners LP 5,000 % fällig am 15.09.2023	200	216	0,02	Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,625 % fällig am 28.04.2026	500	544	0,05
Kinder Morgan, Inc. 1,464 % fällig am 15.01.2023	400	406	0,04	Oracle Corp. 1,650 % fällig am 25.03.2026 (g)	2.000	2.028	0,19	Syngenta Finance NV 4,441 % fällig am 24.04.2023	1.650	1.743	0,16
7,750 % fällig am 15.01.2032	2.000	2.872	0,27	2,300 % fällig am 25.03.2028 (g)	6.800	6.981	0,65	4,892 % fällig am 24.04.2025	200	222	0,02
Kraft Heinz Foods Co. 3,000 % fällig am 01.06.2026	1.203	1.282	0,12	4,000 % fällig am 15.07.2046	600	652	0,06	5,182 % fällig am 24.04.2028	2.200	2.516	0,24
3,750 % fällig am 01.04.2030	1.100	1.209	0,11	4,000 % fällig am 15.11.2047	600	656	0,06	T-Mobile USA, Inc. 2,550 % fällig am 15.02.2031	4.900	4.969	0,46
				Pacific National Finance Pty. Ltd. 4,750 % fällig am 22.03.2028	1.700	1.858	0,17	3,750 % fällig am 15.04.2027	500	554	0,05
				Penske Truck Leasing Co. LP 3,375 % fällig am 01.02.2022	1.000	1.012	0,09	3,875 % fällig am 15.04.2030	1.200	1.346	0,13
				3,450 % fällig am 01.07.2024	200	215	0,02				
				3,900 % fällig am 01.02.2024	100	107	0,01				
				4,450 % fällig am 29.01.2026	100	113	0,01				
				Petroleos Mexicanos 5,950 % fällig am 28.01.2031	600	584	0,05				
				7,690 % fällig am 23.01.2050	100	96	0,01				

Aufstellung der Wertpapieranlagen US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
Tencent Holdings Ltd. 3,240 % fällig am 03.06.2050 3,975 % fällig am 11.04.2029	\$ 1.200 700	\$ 1.178 781	0,11 0,07	Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024 5,625 % fällig am 26.08.2028	\$ 1.500 5.065	\$ 1.520 5.296	0,14 0,50	Exelon Corp. 4,050 % fällig am 15.04.2030	\$ 800	\$ 912	0,09
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC 7,000 % fällig am 15.10.2028	500	649	0,06	Yara International ASA 3,148 % fällig am 04.06.2030 4,750 % fällig am 01.06.2028	500 200	536 236	0,05 0,02	FirstEnergy Corp. 2,250 % fällig am 01.09.2030 4,400 % fällig am 15.07.2027	400 200	384 218	0,04 0,02
Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 3,650 % fällig am 10.11.2021	200	201	0,02	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 3,550 % fällig am 01.04.2025 3,700 % fällig am 19.03.2023 4,250 % fällig am 15.08.2035	600 200 228	651 210 252	0,06 0,02 0,02	FirstEnergy Transmission LLC 4,350 % fällig am 15.01.2025	1.400	1.537	0,14
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 2,200 % fällig am 21.07.2021	208	208	0,02					Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. 4,375 % fällig am 19.09.2022	200	208	0,02
Time Warner Cable LLC 5,875 % fällig am 15.11.2040	1.400	1.816	0,17			402.082	37,58	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029 3,250 % fällig am 25.02.2030	900 1.100	884 1.098	0,08 0,10
Toyotsu Tsusho Corp. 3,625 % fällig am 13.09.2023	1.100	1.172	0,11	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				Georgia Power Co. 3,250 % fällig am 30.03.2027 3,250 % fällig am 15.03.2051	420 1.400	455 1.416	0,04 0,13
Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC 3,250 % fällig am 15.05.2030 4,000 % fällig am 15.03.2028	100 1.000	108 1.133	0,01 0,11	AEP Texas, Inc. 6,650 % fällig am 15.02.2033	300	404	0,04	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025 5,950 % fällig am 29.07.2026	500 800	515 864	0,05 0,08
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 2,450 % fällig am 16.03.2031	750	756	0,07	Ameren Illinois Co. 3,250 % fällig am 15.03.2050	400	434	0,04	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	250	262	0,02
Trimble, Inc. 4,150 % fällig am 15.06.2023	100	106	0,01	American Electric Power Co., Inc. 4,300 % fällig am 01.12.2028	455	524	0,05	Interstate Power & Light Co. 3,600 % fällig am 01.04.2029	1.400	1.559	0,15
Tyson Foods, Inc. 5,100 % fällig am 28.09.2048	400	528	0,05	American Water Capital Corp. 3,750 % fällig am 01.09.2047	600	678	0,06	IPALCO Enterprises, Inc. 3,700 % fällig am 01.09.2024	1.500	1.616	0,15
U.S. Airways Pass-Through Trust 5,900 % fällig am 01.04.2026	263	275	0,03	Appalachian Power Co. 7,000 % fällig am 01.04.2038	900	1.347	0,13	Jersey Central Power & Light Co. 4,300 % fällig am 15.01.2026	1.100	1.218	0,11
Unigel Luxembourg S.A. 8,750 % fällig am 01.10.2026	400	434	0,04	AT&T, Inc. 2,550 % fällig am 01.12.2033 3,500 % fällig am 01.06.2041 3,650 % fällig am 01.06.2051 3,800 % fällig am 01.12.2057 4,300 % fällig am 15.02.2030 4,450 % fällig am 01.04.2024	3.589 4.300 3.200 1.264 400 1.000	3.559 4.475 3.331 1.319 463 1.093	0,33 0,42 0,31 0,12 0,04 0,10	Kentucky Utilities Co. 3,300 % fällig am 01.06.2050	1.500	1.589	0,15
Union Pacific Corp. 3,750 % fällig am 05.02.2070	200	221	0,02	Azure Power Energy Ltd. 5,500 % fällig am 03.11.2022	500	508	0,05	MidAmerican Energy Co. 3,150 % fällig am 15.04.2050 3,650 % fällig am 15.04.2029	3.200 1.400	3.427 1.584	0,32 0,15
United Airlines Pass-Through Trust 2,700 % fällig am 01.11.2033 2,875 % fällig am 07.04.2030 3,100 % fällig am 07.04.2030 3,700 % fällig am 01.09.2031 3,750 % fällig am 03.03.2028 4,000 % fällig am 11.10.2027 4,150 % fällig am 25.02.2033 4,550 % fällig am 25.08.2031 5,875 % fällig am 15.04.2029	384 438 244 530 690 201 211 84 952	387 449 248 542 731 212 231 91 1.058	0,04 0,04 0,02 0,05 0,07 0,02 0,02 0,01 0,10	Black Hills Corp. 3,150 % fällig am 15.01.2027 4,250 % fällig am 30.11.2023	400 600	427 645	0,04 0,06	Midwest Connector Capital Co. LLC 3,625 % fällig am 01.04.2022 3,900 % fällig am 01.04.2024 4,625 % fällig am 01.04.2029	100 1.600 900	102 1.674 957	0,01 0,16 0,09
UnitedHealth Group, Inc. 3,850 % fällig am 15.06.2028	300	345	0,03	CenterPoint Energy, Inc. 4,250 % fällig am 01.11.2028	300	345	0,03	Mississippi Power Co. 3,950 % fällig am 30.03.2028 4,250 % fällig am 15.03.2042	500 1.900	563 2.249	0,05 0,21
Univision Communications, Inc. 5,125 % fällig am 15.02.2025	100	102	0,01	Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	1.500	1.495	0,14	Narragansett Electric Co. 3,395 % fällig am 09.04.2030	400	439	0,04
Vale Overseas Ltd. 3,750 % fällig am 08.07.2030 6,250 % fällig am 10.08.2026 6,875 % fällig am 21.11.2036	1.800 300 300	1.919 361 412	0,18 0,03 0,04	Cleco Corporate Holdings LLC 4,973 % fällig am 01.05.2046	700	841	0,08	Nevada Power Co. 2,400 % fällig am 01.05.2030	1.800	1.855	0,17
Valero Energy Corp. 4,350 % fällig am 01.06.2028	600	683	0,06	Cleveland Electric Illuminating Co. 3,500 % fällig am 01.04.2028	1.561	1.671	0,16	New York State Electric & Gas Corp. 3,300 % fällig am 15.09.2049	4.010	4.168	0,39
Verisk Analytics, Inc. 4,125 % fällig am 15.03.2029	200	227	0,02	Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 5,300 % fällig am 01.03.2035	900	1.143	0,11	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,250 % fällig am 01.06.2030 3,250 % fällig am 01.04.2026 5,650 % fällig am 01.05.2079	1.000 1.800 400	1.009 1.955 466	0,09 0,18 0,04
ViaSat, Inc. 5,625 % fällig am 15.04.2027	300	314	0,03	Contemporary Ruiding Development Ltd. 2,625 % fällig am 17.09.2030	1.500	1.499	0,14	NGPL PipeCo LLC 4,875 % fällig am 15.08.2027	700	803	0,08
Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % fällig am 31.01.2031 4,250 % fällig am 31.01.2031	€ 1.100 \$ 1.000	1.312 984	0,12 0,09	DTE Electric Co. 1,900 % fällig am 01.04.2028	3.800	3.861	0,36	NiSource, Inc. 3,600 % fällig am 01.05.2030	300	333	0,03
VMware, Inc. 3,900 % fällig am 21.08.2027 4,650 % fällig am 15.05.2027 4,700 % fällig am 15.05.2030	3.695 750 900	4.109 862 1.066	0,38 0,08 0,10	Duke Energy Carolinas LLC 2,450 % fällig am 15.08.2029 6,000 % fällig am 15.01.2038	600 50	626 71	0,06 0,01	Northern States Power Co. 2,600 % fällig am 01.06.2051	2.000	1.906	0,18
Volkswagen Group of America Finance LLC 4,000 % fällig am 12.11.2021	900	913	0,09	Duke Energy Florida LLC 3,200 % fällig am 15.01.2027	100	109	0,01	Novatek OAO Via Novatek Finance DAC 4,422 % fällig am 13.12.2022	500	524	0,05
Weir Group PLC 2,200 % fällig am 13.05.2026	1.500	1.508	0,14	Duquesne Light Holdings, Inc. 2,532 % fällig am 01.10.2030	1.200	1.181	0,11	Odebrecht Drilling Norbe Ltd. 6,350 % fällig am 01.12.2021 ^	3	3	0,00
Western Digital Corp. 4,750 % fällig am 15.02.2026	400	445	0,04	East Ohio Gas Co. 2,000 % fällig am 15.06.2030	600	594	0,06	Oncor Electric Delivery Co. LLC 3,700 % fällig am 15.11.2028	1.600	1.812	0,17
Westinghouse Air Brake Technologies Corp. 3,450 % fällig am 15.11.2026 4,400 % fällig am 15.03.2024 4,950 % fällig am 15.09.2028	100 395 3.100	107 428 3.601	0,01 0,04 0,34	Enable Midstream Partners LP 4,400 % fällig am 15.03.2027	1.400	1.545	0,14	ONEOK, Inc. 4,000 % fällig am 13.07.2027 4,350 % fällig am 15.03.2029 4,550 % fällig am 15.07.2028 6,000 % fällig am 15.06.2035 6,350 % fällig am 15.01.2031 7,500 % fällig am 01.09.2023	300 400 200 1.300 924	332 452 228 1.008 1.683 1.041	0,03 0,04 0,02 0,09 0,16 0,10
Williams Cos., Inc. 4,000 % fällig am 15.09.2025 4,850 % fällig am 01.03.2048	225 470	249 573	0,02 0,05	Endeavor Energy Resources LP 5,750 % fällig am 30.01.2028	100	107	0,01	Pacific Gas & Electric Co. 2,100 % fällig am 01.08.2027 2,500 % fällig am 01.02.2031 3,000 % fällig am 15.06.2028 3,150 % fällig am 01.01.2026 3,450 % fällig am 01.07.2025 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ 3,500 % fällig am 01.08.2050 3,750 % fällig am 01.07.2028 4,250 % fällig am 15.03.2046 ^	2.300 200 900 1.200 2.600 300 2.000 300 1.100	2.236 188 905 1.239 2.727 315 1.785 315 1.051	0,21 0,02 0,08 0,12 0,26 0,03 0,17 0,03 0,10
Woodside Finance Ltd. 3,650 % fällig am 05.03.2025 4,500 % fällig am 04.03.2029	985 400	1.053 448	0,10 0,04	Evergy Corp. 1,900 % fällig am 15.06.2028 2,950 % fällig am 01.09.2026	200 400	200 427	0,02 0,04				
WRKCo, Inc. 3,900 % fällig am 01.06.2028	400	452	0,04	Evergy Mississippi LLC 2,850 % fällig am 01.06.2028	1.700	1.818	0,17				
				Evergy Metro, Inc. 2,250 % fällig am 01.06.2030	1.200	1.223	0,11				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VER- MÖGENS
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	\$ 100	\$ 96	0,01	Washington Gas Light Co.	\$ 600	\$ 675	0,06	5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 8.800	\$ 2.516	0,23
4,950 % fällig am 01.07.2050	1.400	1.442	0,14	3,650 % fällig am 15.09.2049				6,350 % fällig am 12.08.2028	900	263	0,02
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara	800	804	0,08	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		959.531	89,67	6,950 % fällig am 12.08.2031	12.600	3.694	0,35
Petrobras Global Finance BV	1.629	1.780	0,17	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				8,200 % fällig am 12.08.2026	7.800	2.532	0,24
5,093 % fällig am 15.01.2030	800	981	0,09	Ginnie Mae, TBA				Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
7,250 % fällig am 17.03.2044				2,000 % fällig am 01.07.2051	1.000	1.019	0,10	2,800 % fällig am 23.06.2030	\$ 300	307	0,03
Piedmont Natural Gas Co., Inc.				2,500 % fällig am 01.08.2051	2.300	2.376	0,22	Qatar Government International Bond			
3,350 % fällig am 01.06.2050	1.400	1.447	0,14	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				3,750 % fällig am 16.04.2030	2.500	2.834	0,26
Plains All American Pipeline LP				3,500 % fällig am 01.08.2051	9.440	9.943	0,93	Saudi Government International Bond			
4,650 % fällig am 15.10.2025	100	112	0,01	4,000 % fällig am 01.08.2051	3.300	3.517	0,33	2,250 % fällig am 02.02.2033	2.700	2.628	0,25
Progress Energy, Inc.	204	291	0,03	US-SCHATZOBIGATIONEN				South Africa Government International Bond			
7,750 % fällig am 01.03.2031				U.S. Treasury Bonds				4,850 % fällig am 30.09.2029	300	319	0,03
Puget Energy, Inc.				1,250 % fällig am 15.05.2050	344	281	0,03	10,500 % fällig am 21.12.2026	ZA 8.200	653	0,06
4,100 % fällig am 15.06.2030	700	785	0,07	1,375 % fällig am 15.08.2050 (i)	15.060	12.700	1,19	Ukraine Government International Bond			
ReNew Power Synthetic				1,875 % fällig am 15.02.2041 (h)(i)	30.700	30.062	2,81	7,750 % fällig am 01.09.2021	\$ 100	101	0,01
3,250 % fällig am 12.03.2024	400	421	0,04	2,000 % fällig am 15.02.2050 (j)	41.050	40.341	3,77	7,750 % fällig am 01.09.2022	400	421	0,04
Rio Oil Finance Trust				2,250 % fällig am 15.05.2041	6.000	6.245	0,58	AKTIEN			
8,200 % fällig am 06.04.2028	240	278	0,03	2,250 % fällig am 15.08.2049	7.682	7.961	0,74	STAMMAKTIE			
9,250 % fällig am 06.07.2024	109	121	0,01	U.S. Treasury Notes				FINANZWERTE			
San Diego Gas & Electric Co.				1,625 % fällig am 15.05.2031 (i)	18.290	18.573	1,74	Stearns Holdings LLC 'B' (c)(g)	14.062	20	0,00
7,750 % fällig am 01.10.2030	700	677	0,06	NON-AGENCY-MBS				OPTIONSSCHEINE			
4,100 % fällig am 15.06.2049	1.100	1.330	0,12	Countrywide Alternative Loan Trust				Guaranteed Rate, Inc. – Exp. 31. Dezember 2060	67	8	0,00
Sempra Energy				1,477 % fällig am 25.08.2035 ^	44	40	0,01	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.134.015	105,98	
3,250 % fällig am 15.06.2027	3.889	4.223	0,39	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				INVESTMENTFONDS			
3,750 % fällig am 15.11.2025	500	549	0,05	0,530 % fällig am 25.11.2034	259	239	0,02	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Southern California Edison Co.				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (e)	250.000	2.543	0,24
2,850 % fällig am 01.08.2029	800	832	0,08	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				PIMCO Funds: Global Investors Series plc – PIMCO Asia High Yield Bond Fund (e)	382.285	4.530	0,42
3,650 % fällig am 01.02.2050	1.300	1.303	0,12	1,022 % fällig am 25.02.2036 ^	306	301	0,03	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	19.997	199	0,02
3,700 % fällig am 01.08.2025	500	545	0,05	Citigroup Mortgage Loan Trust	1.294	726	0,07	Summe Investmentfonds	\$ 7.272	0,68	
3,900 % fällig am 01.12.2041	108	112	0,01	0,292 % fällig am 25.01.2037							
4,125 % fällig am 01.03.2048	1.200	1.283	0,12	Ellington Loan Acquisition Trust	263	264	0,02				
4,200 % fällig am 01.03.2029	200	226	0,02	1,192 % fällig am 25.05.2037							
4,650 % fällig am 01.10.2043	400	461	0,04	Long Beach Mortgage Loan Trust							
5,950 % fällig am 01.02.2038	200	260	0,02	1,067 % fällig am 25.07.2034	1.139	1.135	0,11				
6,850 % fällig am 01.04.2029	2.035	2.542	0,24	New Century Home Equity Loan Trust							
Southern Co. Gas Capital Corp.				0,562 % fällig am 25.02.2036	182	165	0,01				
1,750 % fällig am 15.01.2031	500	474	0,04	STAATSEMISSIONEN							
3,250 % fällig am 15.06.2026	2.700	2.930	0,27	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond	600	653	0,06				
Sprint Communications, Inc.				Export-Import Bank of India							
6,000 % fällig am 15.11.2022	300	318	0,03	1,213 % fällig am 28.03.2022 (g)	500	502	0,05				
Sprint Corp.				3,250 % fällig am 15.01.2030	400	407	0,04				
7,125 % fällig am 15.06.2024	100	116	0,01	Israel Government International Bond	2.000	2.283	0,21				
7,625 % fällig am 15.02.2025	1.600	1.903	0,18	Italy Government International Bond	600	680	0,06				
7,875 % fällig am 15.09.2023	700	796	0,07	6,875 % fällig am 27.09.2023							
State Grid Overseas Investment Ltd.				Peru Government International Bond							
1,625 % fällig am 05.08.2030	200	190	0,02	5,400 % fällig am 12.08.2034	PEN 400	99	0,01				
Systems Energy Resources, Inc.											
2,140 % fällig am 09.12.2025	800	809	0,08								
Targa Resources Partners LP											
5,500 % fällig am 01.03.2030	300	330	0,03								
Transcanada Trust											
5,300 % fällig am 15.03.2077	150	160	0,02								
Verizon Communications, Inc.											
0,800 % fällig am 20.03.2026	5.500	5.604	0,52								
2,100 % fällig am 22.03.2028	500	511	0,05								
Vistra Operations Co. LLC											
3,700 % fällig am 30.01.2027	50	53	0,01								
Vodafone Group PLC											
4,250 % fällig am 17.09.2050	1.400	1.638	0,15								

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend^d, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldı können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2021	27	\$ (34)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2021	293	252	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2021	120	560	0,05
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2021	2	18	0,00
				\$ 796	0,07
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 796	0,07

Aufstellung der Wertpapieranlagen US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Group Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 200	\$ 2	0,00
Anadarko Petroleum Corp.	1,000	20.06.2022	\$ 500	26	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	5.600	8	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2022	1.700	(13)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	500	1	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 700	6	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	400	2	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	200	1	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	300	3	0,00
Canadian Natural Resources Ltd.	1,000	20.06.2022	\$ 100	0	0,00
DISH DBS Corp.	5,000	20.06.2023	200	(1)	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	1.600	2	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2023	400	8	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	500	13	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	300	10	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.000	6	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2021	400	(1)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2022	100	(1)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2022	300	(2)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2023	200	(1)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	1.400	(2)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 3.300	337	0,03
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	1.000	41	0,01
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.12.2022	\$ 300	(2)	0,00
Simon Property Group LP	1,000	20.06.2022	100	0	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	€ 800	5	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	1.000	1	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	2.400	22	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	500	2	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	100	(1)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	200	(1)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	1.600	3	0,00
				\$ 474	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 9.800	\$ 25	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	183.330	327	0,03
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 15.600	105	0,01
iTraxx Europe Main 35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	18.000	26	0,01
				\$ 483	0,05

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2031	£ 8.600	\$ (31)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750	15.09.2051	300	(8)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,789	02.01.2023	BRL 203.400	(47)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 4.900	(70)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	2.700	(39)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	1.700	(83)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,963	22.04.2031	9.600	121	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,935	22.06.2051	\$ 600	(17)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,943	15.06.2051	1.700	(52)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,945	23.06.2051	600	(19)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,968	23.06.2051	900	(33)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,848	17.12.2025	ZAR 52.700	(138)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,848	11.01.2026	31.900	(83)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,850	07.01.2026	400	(1)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,025	04.12.2025	150.300	(326)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,680	08.06.2026	13.100	(11)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,723	08.06.2026	11.000	(8)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	15.09.2031	€ 1.400	1	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,000	19.09.2023	HUF 115.000	(9)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	352.100	(26)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	¥ 231.200	8	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,015	03.06.2026	MXN 344.900	(410)	(0,04)
					\$ (1.281)	(0,12)
					\$ (324)	(0,03)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend³, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	2.310	\$ 263	\$ 481	0,05
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	1.540	170	321	0,03
							\$ 433	\$ 802	0,08

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 99,664	07.07.2021	1,000	\$ 6	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,156	05.08.2021	300	3	1	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	100,473	05.08.2021	300	3	1	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,234	05.08.2021	800	4	3	0,00
					\$ 16	\$ 5	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000 %	20.10.2021	300	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	5.100	(5)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.800	(2)	0	0,00
BPS	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	100,000	21.07.2021	500	(3)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,825	18.08.2021	1.600	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	900	(1)	0	0,00
BRC	Call - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	2.600	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	2.600	(3)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	21.07.2021	3.800	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	3.800	(5)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.07.2021	1.700	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,700	18.08.2021	5.300	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,750	18.08.2021	1.700	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.600	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.600	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	2.400	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	9.300	(10)	(6)	0,00
CBK	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	101,000	20.10.2021	700	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	1.600	(2)	0	0,00
DUB	Call - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,500	21.07.2021	17.500	(19)	(23)	(0,01)
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,600	21.07.2021	17.500	(31)	(2)	0,00
	Call - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Kauf	0,475	18.08.2021	2.000	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	2.000	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	1.500	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	18.08.2021	5.800	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.800	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	15.09.2021	1.600	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.11.2021	1.900	(2)	(2)	0,00
FBF	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	104,000	15.09.2021	300	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	15.09.2021	3.000	(3)	(1)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.300	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	1.500	(2)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	18.08.2021	1.700	(2)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.10.2021	3.800	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	3.000	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.07.2021	1.600	(2)	0	0,00
JPM	Put - OTC CDX.IG-36 5-Year Index	Verkauf	0,900	21.07.2021	900	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 35 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.10.2021	1.800	(2)	(1)	0,00
MYC	Put - OTC CDX.HY-36 5-Year Index	Verkauf	98,000	21.07.2021	500	(1)	0	0,00
						\$ (150)	\$ (58)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175 %	15.03.2023	6.930	\$ (257)	\$ (471)	(0,05)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	14.07.2021	1.700	(11)	(18)	0,00
CBK	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	14.07.2021	1.700	(11)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	06.07.2021	2.100	(16)	(44)	(0,01)
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	23.07.2021	2.000	(13)	(16)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	23.07.2021	2.000	(13)	(8)	0,00
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	06.07.2021	2.100	(17)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	21.07.2021	900	(7)	(5)	0,00
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	21.07.2021	900	(7)	(4)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,017	11.08.2021	1.700	(17)	(23)	0,00
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	11.08.2021	1.700	(17)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	4.620	(167)	(314)	(0,03)
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,018	07.07.2021	700	(5)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,015	19.07.2021	2.200	(9)	(14)	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,019	19.07.2021	2.200	(9)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,019	02.07.2021	1.000	(6)	(24)	0,00
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,022	02.07.2021	1.000	(6)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,018	10.08.2021	1.600	(22)	(36)	0,00
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	10.08.2021	1.600	(22)	(1)	0,00
							\$ (632)	\$ (986)	(0,09)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2.500 % fällig am 01.08.2051	\$ 102,234	12.08.2021	1.100	\$ (3)	\$ (2)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2.500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	8.900	(30)	(15)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,156	05.08.2021	600	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,473	05.08.2021	600	(4)	(1)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,234	05.08.2021	1.600	(5)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,375	07.07.2021	100	0	0	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,547	07.07.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,609	07.07.2021	900	(4)	0	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	99,672	07.07.2021	300	(1)	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,203	07.07.2021	2.500	(9)	(4)	0,00
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,375	07.07.2021	100	0	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,547	07.07.2021	100	0	0	0,00
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,641	07.07.2021	500	(2)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,172	05.08.2021	600	(4)	(1)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,406	05.08.2021	1.700	(7)	(3)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,688	05.08.2021	500	(2)	(1)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	99,938	05.08.2021	100	0	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,406	05.08.2021	1.700	(4)	(5)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,801	05.08.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,078	05.08.2021	200	(1)	0	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,102	05.08.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,344	05.08.2021	300	(1)	(1)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,586	05.08.2021	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2051	104,258	05.08.2021	200	(1)	(1)	0,00
					\$ (85)	\$ (38)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 300	\$ (6)	\$ 13	\$ 7	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	700	(20)	31	11	0,00
BPS	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	600	(36)	31	(5)	0,00
BRC	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20.12.2024	400	5	4	9	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2024	250	(6)	11	5	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.100	3	23	26	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	2.700	(66)	109	43	0,01
BRC	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2025	500	11	2	13	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	400	(2)	7	5	0,00
BRC	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2023	500	(27)	13	(14)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.400	(53)	36	(17)	0,00
CBK	State Grid Overseas Investment Ltd.	1,000	20.12.2024	200	3	2	5	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2021	1.500	(44)	51	7	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	500	(12)	20	8	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2023	100	(5)	2	(3)	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	8	8	0,00
FBF	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	700	(11)	26	15	0,00
GLM	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	2.300	(26)	85	59	0,01
GST	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(2)	5	3	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.12.2021	100	(4)	4	0	0,00
GST	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	8	8	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	400	(16)	11	(5)	0,00

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV	1,000 %	20.06.2022	\$ 300	\$ (17)	\$ 15	\$ (2)	0,00
JPM	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	0	10	10	0,00
MYC	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20.06.2025	300	0	0	0	0,00
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	2	1	0,00
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	600	(4)	6	2	0,00
					\$ (336)	\$ 535	\$ 199	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35%	5,000 %	20.12.2023	\$ 100	\$ 12	\$ (1)	\$ 11	0,00
CBK	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35%	5,000	20.12.2021	1.300	127	(94)	33	0,00
CBK	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35%	5,000	20.12.2023	100	10	1	11	0,00
GST	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35%	5,000	20.12.2021	100	8	(6)	2	0,00
GST	CDX.HY-29 5-Year Index 25-35%	5,000	20.12.2022	100	14	(7)	7	0,00
GST	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35%	5,000	20.12.2023	400	48	(4)	44	0,01
GST	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	5.699	(211)	272	61	0,01
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35%	5,000	20.12.2023	300	33	0	33	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	100	(3)	4	1	0,00
					\$ 38	\$ 165	\$ 203	0,02

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds 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 Rückkehrungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 3.533	BRL 18.757	\$ 205	\$ 0	\$ 205	0,02
	08.2021	184	RUB 13.813	4	0	4	0,00
	09.2021	864	IDR 12.459.379	0	(15)	(15)	0,00
	09.2021	510	PLN 1.935	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	548	RUB 39.991	0	(7)	(7)	0,00
	02.2022	ZAR 3.149	\$ 197	0	(17)	(17)	0,00
	07.2021	€ 2.829	3.431	76	0	76	0,01
	07.2021	MXN 14.465	700	0	(25)	(25)	0,00
	07.2021	\$ 5.161	¥ 564.410	0	(75)	(75)	(0,01)
	09.2021	696	MXN 14.465	25	0	25	0,00
BRC	11.2021	1.698	34.273	0	(5)	(5)	0,00
	07.2021	MXN 6.816	\$ 340	0	(2)	(2)	0,00
	08.2021	\$ 966	MXN 20.021	35	0	35	0,00
CBK	09.2021	334	PLN 1.271	0	0	0	0,00
	07.2021	PEN 45.277	\$ 11.935	324	(215)	109	0,01
	07.2021	\$ 1.173	BRL 5.926	8	0	8	0,00
	07.2021	712	MXN 14.465	13	0	13	0,00
	07.2021	5.700	PEN 22.638	209	0	209	0,02
	07.2021	195	RUB 15.026	11	0	11	0,00
	08.2021	PEN 3.321	\$ 908	38	0	38	0,00
	08.2021	\$ 413	RUB 31.036	9	0	9	0,00
	09.2021	PEN 8.086	\$ 2.181	64	0	64	0,01
	09.2021	\$ 81	ZAR 1.116	0	(4)	(4)	0,00
GLM	03.2022	PEN 6.834	\$ 1.835	50	0	50	0,01
	07.2021	BRL 24.683	4.901	0	(18)	(18)	0,00
	07.2021	£ 6.560	9.274	212	0	212	0,02
	07.2021	\$ 814	RUB 62.803	44	0	44	0,00
	08.2021	4.885	BRL 24.683	18	0	18	0,00
	08.2021	1.090	COP 4.152.103	20	0	20	0,00
	08.2021	579	RUB 43.355	11	0	11	0,00
	09.2021	429	MXN 9.017	20	0	20	0,00
	09.2021	398	PLN 1.513	0	(1)	(1)	0,00
	09.2021	658	RUB 48.213	0	(5)	(5)	0,00
JPM	09.2021	49	ZAR 678	0	(2)	(2)	0,00
	11.2021	1.186	PEN 4.445	0	(23)	(23)	0,00
	02.2022	173	ZAR 2.702	11	0	11	0,00
	07.2021	MXN 7.750	\$ 392	3	0	3	0,00
	07.2021	\$ 1.725	€ 1.445	0	(12)	(12)	0,00
	09.2021	ZAR 2.590	\$ 178	0	(1)	(1)	0,00
	07.2021	€ 72	86	0	0	0	0,00
	07.2021	£ 3	4	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 400	€ 336	0	(2)	(2)	0,00
	07.2021	357	£ 258	0	(1)	(1)	0,00
MYI	07.2021	135	RUB 10.375	6	0	6	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SCX	08.2021	CAD 2.488	\$ 2.051	\$ 42	\$ 0	\$ 42	0,00
	09.2021	\$ 158	ZAR 2.177	0	(7)	(7)	0,00
	07.2021	€ 25.570	\$ 31.281	958	0	958	0,09
	12.2021	\$ 2.226	INR 167.167	0	(22)	(22)	0,00
SSB	08.2021	£ 6.563	\$ 9.070	3	0	3	0,00
				\$ 2.419	\$ (460)	\$ 1.959	0,18

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	\$ 1.625	€ 1.340	\$ 0	\$ (35)	\$ (35)	0,00
BPS	07.2021	111.377	91.043	0	(3.409)	(3.409)	(0,32)
BRC	07.2021	€ 193	\$ 233	4	0	4	0,00
	07.2021	\$ 123.370	€ 100.845	0	(3.778)	(3.778)	(0,35)
GLM	07.2021	€ 556	\$ 663	3	0	3	0,00
JPM	07.2021	498	595	4	0	4	0,00
MYI	07.2021	332	395	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 5.628	€ 4.601	0	(172)	(172)	(0,02)
SCX	07.2021	€ 937	\$ 1.134	23	0	23	0,00
	07.2021	\$ 129.670	€ 105.995	0	(3.971)	(3.971)	(0,37)
SSB	07.2021	€ 38	\$ 46	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 130	€ 108	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 37	\$ (11.368)	\$ (11.331)	(1,06)

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2021	£ 8.055	\$ 11.155	\$ 28	\$ 0	\$ 28	0,00
BRC	07.2021	92	129	2	0	2	0,00
	07.2021	\$ 18	£ 13	0	0	0	0,00
GLM	07.2021	147.648	104.439	0	(3.371)	(3.371)	(0,32)
MYI	07.2021	£ 385	\$ 540	9	0	9	0,00
	07.2021	\$ 1.674	£ 1.180	0	(44)	(44)	0,00
SCX	07.2021	£ 107.950	\$ 149.333	206	0	206	0,02
	07.2021	\$ 148.098	£ 104.439	0	(3.821)	(3.821)	(0,36)
	08.2021	149.258	107.888	0	(203)	(203)	(0,02)
SSB	07.2021	£ 108.298	\$ 149.673	66	0	66	0,01
	07.2021	\$ 144.019	£ 101.637	0	(3.613)	(3.613)	(0,34)
	08.2021	149.105	107.888	0	(50)	(50)	0,00
				\$ 311	\$ (11.102)	\$ (10.791)	(1,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (20.036) (1,87)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG

US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

Uniform Mortgage-Backed Security, TBA
2,000 % fällig am 01.08.2051

PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
\$ 1.700	\$ (1.713)	(0,16)

Summe Leerverkaufte Wertpapiere

\$ (1.713) (0,16)

Summe Anlagen

\$ 1.120.010 104,67

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (49.983) (4,67)

Nettovermögen

\$ 1.070.027 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc. 2,572 % fällig am 03.06.2031	26.05.2020	\$ 1.400	\$ 1.441	0,13
Deutsche Bank AG 0,898 % fällig am 28.05.2024	25.05.2021	1.900	1.892	0,18
Deutsche Bank AG 1,447 % fällig am 01.04.2025	30.03.2021	1.900	1.912	0,18
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	21.06.2021	406	408	0,04
Export-Import Bank of India 1,213 % fällig am 28.03.2022	19.12.2019	499	502	0,05
Morgan Stanley 0,735 % fällig am 03.02.2023	30.01.2020	1.512	1.617	0,15
Oracle Corp. 1,650 % fällig am 25.03.2026	22.03.2021	1.999	2.028	0,19
Oracle Corp. 2,300 % fällig am 25.03.2028	22.03.2021	6.783	6.981	0,65
Stearns Holdings LLC 'B'	15.03.2021	25	20	0,00
		\$ 16.424	\$ 16.801	1,57

(h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 1.175 als Sicherheiten verpfändet.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 73.266 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 610 als Sicherheiten erhalten.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 10 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 14.739 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Barmittel in Höhe von USD 18.250 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.133.987	\$ 28	\$ 1.134.015
Investmentfonds	7.272	0	0	7.272
Finanzderivate ⁽³⁾	(34)	(19.530)	0	(19.564)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(1.713)	0	(1.713)
Summen	\$ 7.238	\$ 1.112.744	\$ 28	\$ 1.120.010

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.261.305	\$ 0	\$ 1.261.305
Investmentfonds	13.289	0	0	13.289
Pensionsgeschäfte	0	2.887	0	2.887
Finanzderivate ⁽³⁾	(23)	18.494	(1)	18.470
Summen	\$ 13.266	\$ 1.282.686	\$ (1)	\$ 1.295.951

⁽¹⁾ 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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	0,050 %	08.06.2021	13.07.2021	\$ (1.155)	\$ (1.155)	(0,11)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (1.155)	(0,11)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPG	(0,080) %	30.06.2021	01.07.2021	\$ (1.822)	\$ (1.822)	(0,17)
	0,050	10.06.2021	12.07.2021	(27.504)	(27.505)	(2,57)
	0,070	23.06.2021	07.07.2021	(980)	(980)	(0,09)
CSN	0,050	30.06.2021	01.07.2021	(9.571)	(9.571)	(0,90)
	0,070	28.06.2021	06.07.2021	(2.442)	(2.442)	(0,23)

Aufstellung der Wertpapieranlagen US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf Finanzierungs-geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
TDM	(0,040) %	29.06.2021	01.07.2021	\$ (16.724)	\$ (16.724)	(1,56)
	0,050	16.06.2021	16.07.2021	(5.699)	(5.699)	(0,53)
	0,070	18.06.2021	19.07.2021	(7.867)	(7.867)	(0,74)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (72.610)	(6,79)

⁽¹⁾ In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 1 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 150	\$ 0	\$ 150
BPS	(3.388)	2.990	(398)
BRC	(3.679)	3.220	(459)
CBK	517	(820)	(303)
DUB	(47)	(60)	(107)
FBF	13	0	13
GLM	(3.061)	2.480	(581)
GST	113	0	113
JPM	27	(120)	(93)
MYC	(71)	90	19
MYI	(167)	(30)	(197)
SAL	(17)	0	(17)
SCX	(6.830)	6.230	(600)
SSB	(3.596)	3.240	(356)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	79,74	74,35
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	25,15	31,39
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,09	1,13
Investmentfonds	0,68	1,13
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,07	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	0,06
Freiverkehrsfinauzderivate	(1,87)	1,51
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,16)	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,11)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(6,79)	(3,61)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,65	1,18
Unternehmensanleihen und Wechsel	89,67	89,25
US-Regierungsbehörden	1,58	6,22
US-Schatzobligationen	10,86	7,95
Non-Agency-MBS	0,03	0,03
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,24	0,23
Staatsemissionen	1,95	1,98
Stammaktien	0,00	k. A.
Optionscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,03
Investmentfonds	0,68	1,13
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,07	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,05	0,02
Zinsswaps	(0,12)	0,02
Freiverkehrsfinauzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,08	0,03
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,09)	(0,04)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,02
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,02	0,02
Devisenterminkontrakte	0,18	0,00
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(2,07)	1,49
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,16)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,67)	(9,81)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen US Short-Term Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
AUSTRALIEN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Driver Australia Six Trust 0,910 % fällig am 21.12.2027 AUD	2.984	\$ 2.247	0,07
NON-AGENCY-MBS			
FirstMac Mortgage Funding Trust 0,895 % fällig am 08.03.2049 \$	446	446	0,02
Liberty Funding Pty. Ltd. 1,260 % fällig am 10.10.2049 AUD	137	103	0,00
		549	0,02
Summe Australien		2.796	0,09
CAYMAN INSELN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Assurant CLO Ltd. 1,438 % fällig am 20.10.2029 \$	5.000	5.003	0,16
Atlas Senior Loan Fund Ltd. 1,058 % fällig am 20.04.2028	440	440	0,01
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 1,184 % fällig am 28.07.2028	1.898	1.899	0,06
Catamaran CLO Ltd. 1,444 % fällig am 22.04.2030	895	896	0,03
CBAM CLO Ltd. 1,308 % fällig am 20.10.2029	1.100	1.101	0,03
	7.000	7.005	0,22
CIFC Funding Ltd. 1,036 % fällig am 25.10.2027	1.518	1.520	0,05
Crestline Denali CLO Ltd. 1,308 % fällig am 20.01.2030	5.422	5.411	0,17
Gallatin CLO Ltd. 1,236 % fällig am 21.01.2028	3.916	3.917	0,12
	2.226	2.227	0,07
KKR Financial CLO Ltd. 1,460 % fällig am 18.07.2030	1.000	1.001	0,03
LCM LP 1,228 % fällig am 20.10.2027	5.869	5.871	0,18
Mountain View CLO Ltd. 1,008 % fällig am 13.10.2027	2.045	2.045	0,06
Nassau Ltd. 1,334 % fällig am 15.10.2029	1.400	1.398	0,04
Oaktree CLO Ltd. 1,450 % fällig am 13.05.2029	1.363	1.365	0,04
OCF CLO Ltd. 0,984 % fällig am 15.07.2027	544	544	0,02
Palmer Square CLO Ltd. 1,006 % fällig am 15.08.2026	624	625	0,02
Telos CLO Ltd. 1,140 % fällig am 17.04.2028	2.559	2.562	0,08
Tralee CLO Ltd. 1,298 % fällig am 20.10.2028	985	986	0,03
Venture CLO Ltd. 1,064 % fällig am 15.04.2027	7.711	7.698	0,24
	1.759	1.761	0,06
	5.700	5.704	0,18
		60.979	1,90
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ADCB Finance Cayman Ltd. 1,420 % fällig am 25.10.2022 AUD	900	681	0,02
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025 \$	2.500	2.576	0,08
	500	541	0,02
	2.700	2.868	0,09
CK Hutchison International Ltd. 1,875 % fällig am 03.10.2021	760	763	0,02
	1.000	1.017	0,03
Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.03.2023	4.000	4.205	0,13
	10.837	11.342	0,36
QNB Finance Ltd. 1,125 % fällig am 17.06.2024	32.100	32.114	1,00
		56.107	1,75

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
NON-AGENCY-MBS			
Exantas Capital Corp. 2,601 % fällig am 17.04.2037 \$	8.624	\$ 8.639	0,27
Summe Cayman Inseln		125.725	3,92
CHILE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Santander Chile 1,335 % fällig am 28.11.2021	3.000	3.008	0,09
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Danske Bank A/S 1,171 % fällig am 08.12.2023	12.700	12.767	0,40
	7.600	7.688	0,24
	5.937	5.966	0,19
	2.400	2.663	0,08
Summe Dänemark		29.084	0,91
FINNLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Nordea Bank Abp 1,075 % fällig am 30.08.2023	6.000	6.071	0,19
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Credit Agricole S.A. 1,237 % fällig am 22.03.2024	9.400	9.513	0,30
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Deutsche Bank AG 0,898 % fällig am 28.05.2024 (f)	2.600	2.589	0,08
	3.700	3.741	0,12
HSH Portfoliomanagement AoeR 0,500 % fällig am 09.09.2022	2.200	2.200	0,07
Summe Deutschland		8.530	0,27
HONGKONG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AIA Group Ltd. 0,707 % fällig am 20.09.2021	15.900	15.899	0,50
INDIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Reliance Industries Ltd. 5,400 % fällig am 14.02.2022	3.000	3.083	0,10
State Bank of India 4,000 % fällig am 24.01.2022	7.400	7.527	0,23
		10.610	0,33
STAATSEMISSIONEN			
Export-Import Bank of India 1,149 % fällig am 21.08.2022	11.200	11.250	0,35
Summe Indien		21.860	0,68
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
AlbaCore EURO CLO DAC 1,530 % fällig am 18.07.2031 €	1.100	1.309	0,04
Black Diamond CLO DAC 1,244 % fällig am 03.10.2029 \$	1.938	1.938	0,06
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,700 % fällig am 15.01.2031 €	20.000	23.718	0,74
	1.252	1.486	0,05
Cork Street CLO DAC 0,590 % fällig am 27.11.2028	911	1.080	0,03
Dorchester Park CLO DAC 1,088 % fällig am 20.04.2028 \$	1.086	1.087	0,04
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 1,550 % fällig am 20.07.2031 €	13.300	15.798	0,49
Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029	834	991	0,03

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
0,650 % fällig am 26.06.2030 €	9.400	\$ 11.135	0,35
Hayfin Emerald CLO DAC 1,450 % fällig am 15.02.2033	2.100	2.496	0,08
Mackay Shields Euro CLO DAC 1,550 % fällig am 15.08.2033	2.200	2.613	0,08
OAK Hill European Credit Partners DAC 0,740 % fällig am 20.10.2031	1.400	1.658	0,05
Voya Euro CLO DAC 0,750 % fällig am 15.10.2030	11.027	13.088	0,41
		78.397	2,45
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AerCap Ireland Capital DAC 3,500 % fällig am 26.05.2022 \$	2.386	2.444	0,08
	1.000	1.017	0,03
	4.650	4.721	0,15
	1.600	1.664	0,05
	3.600	3.639	0,11
SMBC Aviation Capital Finance DAC 2,650 % fällig am 15.07.2021	3.750	3.752	0,12
	4.850	4.963	0,15
	3.700	3.933	0,12
		26.133	0,81
NON-AGENCY-MBS			
Dilosk RBMS DAC 0,210 % fällig am 20.12.2057 €	1.201	1.426	0,05
Mulcair Securities DAC 0,461 % fällig am 24.04.2071	917	1.092	0,03
		2.518	0,08
Summe Irland		107.048	3,34
ISRAEL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Israel Electric Corp. Ltd. 6,875 % fällig am 21.06.2023 \$	2.100	2.346	0,07
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aozora Bank Ltd. 2,550 % fällig am 09.09.2022	2.000	2.040	0,06
	3.800	3.821	0,12
Central Nippon Expressway Co. Ltd. 0,616 % fällig am 15.02.2022	29.600	29.666	0,93
	4.400	4.407	0,14
	500	502	0,02
	500	501	0,02
	1.000	1.003	0,03
	3.000	3.020	0,09
Mitsubishi HC Capital, Inc. 2,652 % fällig am 19.09.2022	8.500	8.703	0,27
	1.300	1.322	0,04
	500	533	0,02
Mizuho Financial Group, Inc. 0,777 % fällig am 25.05.2024	5.900	5.938	0,18
	7.700	7.741	0,24
	8.890	8.955	0,28
	4.000	4.058	0,13
Nissan Motor Co. Ltd. 3,043 % fällig am 15.09.2023	10.000	10.434	0,32
Nomura Holdings, Inc. 1,851 % fällig am 16.07.2025	16.300	16.676	0,52
	6.500	6.836	0,21
ORIX Corp. 2,900 % fällig am 18.07.2022	600	616	0,02
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,292 % fällig am 16.10.2024 AUD	3.000	2.303	0,07
Summe Japan		119.075	3,71
JERSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Heathrow Funding Ltd. 4,875 % fällig am 15.07.2023 \$	3.000	3.004	0,09

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
LUXEMBURG				SUPRANATIONAL				USA				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Delos Finance SARL 1,897 % fällig am 06.10.2023	\$	210	0,01	Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 0,650 % fällig am 10.02.2026	\$	10.000	0,31	Residential Mortgage Securities PLC 1,284 % fällig am 20.09.2065	1.660	2.297	0,07	
				0,850 % fällig am 10.02.2027	18.800	18.587	0,58	1,299 % fällig am 20.06.2070	176	246	0,01	
				Summe supranational		28.485	0,89	Ripon Mortgages PLC 0,881 % fällig am 20.08.2056	15.401	21.324	0,67	
NIEDERLANDE				SCHWEIZ				RMAC PLC				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,780 % fällig am 12.06.2046				
BNPP AM Euro CLO BV 0,600 % fällig am 15.04.2031	€	2.000	2,371	Credit Suisse Group AG 1,424 % fällig am 12.06.2024	1.000	1.016	0,03	1,050 % fällig am 12.06.2046	3.792	5.267	0,16	
Cairn CLO BV 0,650 % fällig am 20.10.2028		327	388	2,193 % fällig am 05.06.2026	2.500	2.561	0,08	Sage AR Funding No. 1 PLC 1,299 % fällig am 17.11.2030	3.000	4.149	0,13	
Contego CLO BV 0,369 % fällig am 15.11.2026		1.474	1.747	Summe Schweiz		3.577	0,11	Stratton Mortgage Funding PLC 0,901 % fällig am 25.09.2051	7.693	10.657	0,33	
Contego CLO DAC 0,640 % fällig am 23.01.2030		13.500	15.979	VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				0,948 % fällig am 20.07.2060	25.235	35.000	1,09	
Tikehau CLO BV 0,600 % fällig am 04.08.2028		960	1.139	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,949 % fällig am 12.03.2052	5.854	8.123	0,25	
			0,04	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 2,750 % fällig am 05.10.2021	809	814	0,03	1,249 % fällig am 25.05.2051	2.443	3.393	0,11	
			0,67	First Abu Dhabi Bank PJSC 1,134 % fällig am 16.04.2022	17.400	17.479	0,54	Towd Point Mortgage Funding PLC 0,949 % fällig am 20.07.2045	6.643	9.208	0,29	
			0,24	Summe Vereinigte Arabische Emirate		18.293	0,57	1,111 % fällig am 20.10.2051	1.163	1.616	0,05	
			0,91	GROSSBRITANNIEN				Tudor Rose Mortgages PLC 1,299 % fällig am 20.06.2048	7.076	9.814	0,31	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Großbritannien				
ING Groep NV 1,020 % fällig am 01.04.2027	\$	4.500	4.549	Barclays PLC 1,536 % fällig am 16.05.2024	12.450	12.683	0,40					
LeasePlan Corp. NV 2,875 % fällig am 24.10.2024		2.900	3.048	1,586 % fällig am 15.02.2023	10.074	10.149	0,32					
			0,10	4,338 % fällig am 16.05.2024	300	320	0,01					
			0,24	BP Capital Markets PLC 0,840 % fällig am 19.09.2022	375	377	0,01					
Summe Niederlande			0,91	HSBC Holdings PLC 1,407 % fällig am 11.03.2025	10.000	10.207	0,32					
SAUDI-ARABIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				USA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Saudi Arabian Oil Co. 1,250 % fällig am 24.11.2023		600	607	Imperial Brands Finance PLC 3,125 % fällig am 26.07.2024	5.000	5.265	0,16	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 1,217 % fällig am 25.03.2035	\$	700	698	0,02
1,625 % fällig am 24.11.2025		2.200	2.224	3,750 % fällig am 21.07.2022	17.766	18.232	0,57	2,717 % fällig am 25.03.2034	115	116	0,00	
			0,07	Lloyds Banking Group PLC 1,331 % fällig am 20.03.2023	AUD	1.100	836	0,03	Chesapeake Funding LLC 3,230 % fällig am 15.08.2030	295	298	0,01
			0,09	1,437 % fällig am 07.03.2025	2.360	1.807	0,06	CIT Mortgage Loan Trust 1,442 % fällig am 25.10.2037	9.102	9.200	0,29	
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Countrywide Asset-Backed Certificates				
Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021		3.500	3.523	Nationwide Building Society 3,622 % fällig am 26.04.2023	\$	2.000	2,051	0,06	0,647 % fällig am 25.06.2036	517	513	0,02
Summe Saudi-Arabien			0,20	Natwest Group PLC 2,359 % fällig am 22.05.2024	1.000	1.031	0,03	1,592 % fällig am 25.10.2034	994	1.002	0,03	
SINGAPUR				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				EFS Volunteer LLC				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,026 % fällig am 25.10.2035				
BOC Aviation Ltd. 2,375 % fällig am 15.09.2021		2.600	2.604	Santander UK Group Holdings PLC 1,089 % fällig am 15.03.2025	19.000	19.074	0,59	EquiFirst Mortgage Loan Trust 3,092 % fällig am 25.10.2034	582	613	0,02	
2,750 % fällig am 18.09.2022		7.345	7.481	Standard Chartered PLC 1,260 % fällig am 14.10.2023	15.200	15.355	0,48	Finance America Mortgage Loan Trust 0,917 % fällig am 25.08.2034	959	953	0,03	
3,000 % fällig am 23.05.2022		4.300	4.365			98.626	3,08	First NLC Trust 0,162 % fällig am 25.08.2037	271	175	0,01	
Summe Singapur			0,45					Fremont Home Loan Trust 0,827 % fällig am 25.01.2035	596	593	0,02	
SÜDKOREA				NON-AGENCY-MBS				GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,592 % fällig am 25.12.2035				
Hyundai Capital Services, Inc. 3,000 % fällig am 06.03.2022		3.573	3.633	Avon Finance No. 2 PLC 0,949 % fällig am 20.09.2048	£	14.837	20,566	0,64	Home Equity Asset Trust 1,037 % fällig am 25.06.2034	906	904	0,03
KEB Hana Bank 0,894 % fällig am 02.10.2022		7.600	7.634	Canada Square Funding PLC 0,829 % fällig am 17.06.2058 (b)	7.200	9.965	0,31	Long Beach Mortgage Loan Trust 1,067 % fällig am 25.04.2035	2.483	2.490	0,08	
2,125 % fällig am 18.10.2021		2.000	2.009	Dukinfield PLC 1,334 % fällig am 20.12.2052	2.210	3.059	0,10	LP Credit Card ABS Master Trust 1,661 % fällig am 20.08.2024	3.144	3.149	0,10	
Korea Southern Power Co. Ltd. 1,010 % fällig am 30.10.2024	AUD	2.300	1.747	Durham Mortgages B PLC 0,688 % fällig am 31.03.2054	2.292	3.165	0,10	MASTR Asset-Backed Securities Trust 0,792 % fällig am 25.09.2034	1.138	1.118	0,03	
			0,06	Eurohome UK Mortgages PLC 0,230 % fällig am 15.06.2044	529	718	0,02	Mill City Mortgage Loan Trust 2,750 % fällig am 25.07.2059	1.601	1.624	0,05	
			0,47	Finsbury Square PLC 1,048 % fällig am 16.06.2069	6.896	9.559	0,30	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 1,142 % fällig am 25.09.2033	938	936	0,03	
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Navient Private Education Loan Trust				
Export-Import Bank of Korea 0,726 % fällig am 25.06.2022	\$	1.025	1.029	Hawksmoor Mortgages PLC 1,099 % fällig am 25.05.2053	12.106	16.808	0,52	1,701 % fällig am 15.10.2031	7.200	7.329	0,23	
1,381 % fällig am 27.04.2023		1.029	1.047	Permanent Master Issuer PLC 0,734 % fällig am 15.07.2058	\$	11.400	11,417	0,36	2,650 % fällig am 15.12.2028	2.101	2.140	0,07
			0,03	Polaris RMBS 1,299 % fällig am 27.04.2057	£	966	1.338	0,04	Nelnet Student Loan Trust 0,692 % fällig am 27.02.2051	1.777	1.783	0,05
			0,06	Precise Mortgage Funding PLC 0,760 % fällig am 12.03.2055	965	1.335	0,04	0,792 % fällig am 27.09.2038	3.387	3.378	0,10	
Summe Südkorea			0,53					NovaStar Mortgage Funding Trust 0,752 % fällig am 25.01.2036	1.812	1.805	0,06	
SPANIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Pretium Mortgage Credit Partners LLC				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,179 % fällig am 27.06.2069				
Banco Santander S.A. 1,694 % fällig am 19.01.2023	AUD	1.200	913					RAAC Trust 2,192 % fällig am 25.05.2044	1.836	1.889	0,06	
			0,03					SLC Student Loan Trust 0,216 % fällig am 15.05.2029	1.905	1.894	0,06	
			0,03					0,294 % fällig am 15.03.2027	655	654	0,02	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
DBCG Mortgage Trust				0,850 % fällig am 17.02.2027 \$	33.500	\$ 33.051	1,03	0,015 % fällig am			
0,801 % fällig am 15.06.2034	\$ 21.800	\$ 21.828	0,68	0,900 % fällig am 26.02.2027	41.900	41.425	1,29	04.08.2021 (c)(d)	\$ 9.600	\$ 9.600	0,30
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates				0,920 % fällig am 26.02.2027	29.100	28.794	0,90	Pacific Gas and Electric Co.			
3,151 % fällig am 28.09.2036	3.110	3.195	0,10	0,960 % fällig am 05.03.2026	28.300	28.257	0,88	1,531 % fällig am 15.11.2021	5.900	5.912	0,18
GS Mortgage Securities Corp. Trust				1,000 % fällig am 23.03.2026	7.900	7.900	0,25				
3,648 % fällig am 10.01.2047	674	697	0,02	1,020 % fällig am 24.02.2027	45.000	44.703	1,40				
GSR Mortgage Loan Trust				1,115 % fällig am 26.02.2027	31.500	31.403	0,98				
2,064 % fällig am 25.06.2034	70	71	0,00	Freddie Mac				U.S. TREASURY BILLS			
3,213 % fällig am 25.11.2035 ^A	183	176	0,01	0,401 % fällig am 15.05.2037	65	65	0,00	0,005 % fällig am			
Impac CMB Trust				0,451 % fällig am 15.04.2041	227	228	0,01	13.07.2021 (c)(d)	16.300	16.300	0,51
0,732 % fällig am 25.03.2035	140	137	0,00	0,465 % fällig am 15.10.2037				0,011 % fällig am			
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.				- 15.10.2040	47.984	48.110	1,50	26.08.2021 (c)(d)	15.400	15.399	0,48
4,128 % fällig am 05.07.2031	4.500	4.776	0,15	0,492 % fällig am 25.07.2050	20.175	20.376	0,64	0,013 % fällig am			
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				0,501 % fällig am 15.02.2034				01.07.2021 (c)(d)	10.000	10.000	0,31
1,101 % fällig am 15.06.2032	2.232	2.237	0,07	- 15.08.2056	10.011	10.081	0,31	0,013 % fällig am			
2,410 % fällig am 15.06.2035	2.229	2.237	0,07	0,511 % fällig am 15.06.2037	749	761	0,02	15.07.2021 (c)(d)	7.900	7.900	0,25
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0,551 % fällig am 15.10.2036				0,014 % fällig am			
1,706 % fällig am 25.03.2033	425	423	0,01	- 15.06.2042	68	69	0,00	13.07.2021 (c)(d)	10.600	10.600	0,33
2,024 % fällig am 25.05.2033	313	322	0,01	0,581 % fällig am 15.10.2040	101	102	0,00	0,015 % fällig am			
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust				0,600 % fällig am 15.10.2025	12.000	11.894	0,37	14.09.2021 (c)(d)	7.200	7.199	0,22
0,851 % fällig am 15.02.2033	848	848	0,03	0,601 % fällig am 15.11.2050	81	80	0,00	0,017 % fällig am			
New Residential Mortgage Loan Trust				0,621 % fällig am 15.05.2036				07.09.2021 (c)(d)	8.900	8.899	0,28
3,500 % fällig am 25.12.2057	725	754	0,02	- 15.12.2041	188	191	0,01	0,022 % fällig am			
4,500 % fällig am 25.05.2058	287	311	0,01	0,650 % fällig am 22.10.2025	75.000	74.797	2,33	10.08.2021 (c)(d)	13.100	13.099	0,41
Sequoia Mortgage Trust				0,800 % fällig am 27.10.2026	110.000	109.024	3,40	0,022 % fällig am			
0,779 % fällig am 20.10.2034	732	717	0,02	0,850 % fällig am 23.12.2026	15.000	14.814	0,46	12.11.2021 (c)(d)	10.900	10.898	0,34
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				1,527 % fällig am 25.07.2044	5	5	0,00	0,023 % fällig am			
2,530 % fällig am 25.03.2034	15	15	0,00	2,122 % fällig am 15.01.2038 (a)	1.043	67	0,00	28.09.2021 (c)(d)	11.100	11.099	0,35
Structured Asset Mortgage Investments Trust				2,500 % fällig am 25.10.2048	1.349	1.397	0,04	0,025 % fällig am			
0,758 % fällig am 19.10.2034	584	575	0,02	3,000 % fällig am 25.09.2045	3.882	3.901	0,12	24.08.2021 (c)(d)	36.200	36.198	1,13
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				4,000 % fällig am 01.08.2048	2.998	3.198	0,10	0,027 % fällig am			
0,552 % fällig am 25.04.2045	2	2	0,00	Ginnie Mae				28.10.2021 (c)(d)(g)	3.400	3.400	0,11
0,632 % fällig am 25.12.2045	45	45	0,00	0,410 % fällig am 20.06.2051	28.200	28.084	0,88	0,028 % fällig am			
2,903 % fällig am 25.10.2035	364	365	0,01	0,570 % fällig am 20.02.2067	1.159	1.165	0,04	28.09.2021 (c)(d)	8.300	8.299	0,26
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust				0,584 % fällig am 20.12.2068	1.478	1.474	0,05	0,028 % fällig am			
4,218 % fällig am 15.07.2046	800	847	0,03	0,599 % fällig am 20.10.2037	202	204	0,01	05.10.2021 (c)(d)	11.400	11.399	0,35
Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust				0,760 % fällig am 20.06.2051	16.100	16.061	0,50	0,029 % fällig am			
1,301 % fällig am 15.06.2045	4.885	4.880	0,15	0,860 % fällig am 20.12.2065				12.11.2021 (c)(d)	8.500	8.499	0,26
		58.268	1,82	- 20.08.2067	3.958	4.010	0,13	0,030 % fällig am			
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				0,910 % fällig am 20.01.2066	1.140	1.161	0,04	12.11.2021 (c)(d)	9.200	9.199	0,29
Fannie Mae				0,960 % fällig am 20.11.2066	1.129	1.153	0,04	0,032 % fällig am			
0,342 % fällig am 25.01.2037	50	50	0,00	1,029 % fällig am 20.04.2067	5.196	5.276	0,16	30.09.2021 (c)(d)	11.900	11.899	0,37
0,402 % fällig am 25.04.2037	14	14	0,00	1,110 % fällig am 20.03.2066	743	761	0,02	0,038 % fällig am			
0,422 % fällig am 25.04.2037	8	8	0,00	1,510 % fällig am 20.06.2071	8.200	8.923	0,28	09.12.2021 (c)(d)	8.000	7.998	0,25
0,442 % fällig am 25.07.2037	63	64	0,00	2,000 % fällig am 20.03.2027				0,046 % fällig am			
0,462 % fällig am 25.05.2037	44	45	0,00	- 20.03.2030	42	43	0,00	27.07.2021 (c)(d)	60.000	59.998	1,87
0,465 % fällig am 25.11.2047	4.143	4.136	0,13	2,125 % fällig am 20.11.2029	3	3	0,00	0,047 % fällig am			
0,482 % fällig am 25.04.2037	528	534	0,02	2,250 % fällig am 20.08.2024	1	1	0,00	19.10.2021 (c)(d)	19.200	19.197	0,60
0,492 % fällig am 25.05.2037				2,500 % fällig am 20.01.2049	1.405	1.472	0,05				
- 25.10.2040	50	50	0,00	3,083 % fällig am 20.09.2066	1.973	2.099	0,07	Summe kurzfristige Instrumente		324.590	10,13
0,512 % fällig am 25.05.2037	73	74	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.842.67	88,70	
0,542 % fällig am 25.10.2030				2,490 % fällig am 01.10.2037	145	154	0,01				
- 25.06.2060	27.512	27.827	0,87	4,000 % fällig am 01.09.2049	7.637	8.130	0,25	AKTIEN			
0,565 % fällig am 25.08.2050	3.379	3.394	0,11	US-SCHATZOBIGATIONEN				INVESTMENTFONDS			
0,592 % fällig am 25.08.2037	75	76	0,00	U.S. Treasury Notes				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
0,642 % fällig am 25.12.2049	44	44	0,00	0,125 % fällig am 31.03.2023	182.300	182.040	5,68	PIMCO Select Funds plc –			
0,700 % fällig am 30.07.2025	22.000	21.914	0,68	Summe USA		1.623.839	50,67	PIMCO US Dollar Short-			
0,762 % fällig am 25.03.2038	85	86	0,00	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				Term Floating			
0,772 % fällig am 25.12.2037	63	64	0,00	KURZFRISTIGE SCHULDITITEL				NAV Fund (e)	534.934	5.328	0,17
0,792 % fällig am 25.01.2041	92	93	0,00	Federal Home Loan Bank				BÖRSENGEHADELTE FONDS			
0,875 % fällig am 18.12.2026	36.000	35.625	1,11	0,008 % fällig am				PIMCO ETFs plc – PIMCO			
1,092 % fällig am 25.05.2037	219	226	0,01	27.08.2021 (c)(d)	7.900	7.900	0,25	US Dollar Short			
Federal Home Loan Bank				0,014 % fällig am				Maturity UCITS ETF (e)	3.040.012	308.709	9,63
0,750 % fällig am 24.02.2026	28.000	27.858	0,87	06.08.2021 (c)(d)	13.700	13.699	0,43	Summe Investmentfonds	\$ 314.03	9,80	
0,830 % fällig am 10.02.2027	37.000	36.479	1,14								

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHADELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Canada Bankers' Acceptance December Futures	Long	12.2022	1.795	\$ (714)	(0,02)
3-Month Canada Bankers' Acceptance March Futures	Long	03.2023	2.894	(4.275)	(0,14)

Aufstellung der Wertpapieranlagen US Short-Term Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2021	426	\$ 61	0,00	
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2021	4.652	1.896	0,06	
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2021	1.235	(2.932)	(0,09)	
				\$ (5.964)	(0,19)	
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (5.964)	(0,19)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.IG-36 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2026	\$ 69.700	\$ (44)	0,00

ZINSSWAPS - BASISWAPS

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
3-Month USD-LIBOR ⁽³⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,098 %	13.01.2023	\$ 52.000	\$ (20)	0,00	
3-Month USD-LIBOR ⁽³⁾	1-Month USD-LIBOR + 0,098 %	13.01.2023	39.800	(16)	0,00	
				\$ (36)	0,00	
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (80)	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds 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.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
FAR	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	\$ 101,422	07.07.2021	7.600	\$ (33)	\$ (7)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	05.08.2021	5.200	(18)	(8)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,797	05.08.2021	5.200	(16)	(7)	0,00
GSC	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2051	101,227	07.07.2021	2.800	(14)	(4)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2051	101,367	05.08.2021	3.800	(13)	(11)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,023	07.09.2021	5.600	(35)	(20)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	99,102	07.09.2021	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,023	07.09.2021	5.600	(24)	(30)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,102	07.09.2021	100	0	(1)	0,00
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	102,234	12.08.2021	13.400	(43)	(22)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	102,297	12.08.2021	25.200	(85)	(43)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.09.2051	101,313	07.09.2021	13.800	(43)	(56)	(0,01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	102,047	07.07.2021	8.800	(30)	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2051	104,047	07.07.2021	8.800	(15)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	101,984	05.08.2021	3.700	(13)	(4)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2051	103,984	05.08.2021	3.700	(8)	(3)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,695	07.09.2021	3.500	(11)	(5)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2051	103,984	07.09.2021	8.500	(26)	(20)	0,00
					\$ (428)	\$ (242)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	07.2021	AUD 2.110	\$ 1.591	\$ 7	\$ 0	\$ 7	0,00
BPS	07.2021	19.812	15.397	523	0	523	0,02
	07.2021	€ 19.651	23.463	159	0	159	0,01

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2021	¥ 10.990	\$ 100	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07.2021	\$ 6.195	£ 4.403	0	(113)	(113)	0,00
CBK	08.2021	671	MXN 14.024	31	0	31	0,00
	01.2022	ILS 12.454	\$ 3.814	0	(20)	(20)	0,00
GLM	07.2021	£ 158.890	224.627	5.128	0	5.128	0,16
	01.2022	ILS 52.348	16.102	26	(41)	(15)	0,00
HUS	07.2021	€ 1.991	2.369	8	0	8	0,00
	07.2021	\$ 11.671	€ 9.629	0	(252)	(252)	(0,01)
	07.2021	203.528	£ 147.016	0	(432)	(432)	(0,01)
	07.2021	8.152	ILS 26.468	0	(29)	(29)	0,00
	08.2021	£ 145.042	\$ 200.765	379	0	379	0,01
JPM	07.2021	\$ 1.074	£ 774	0	(5)	(5)	0,00
	01.2022	19.534	ILS 64.783	412	0	412	0,01
	08.2022	ILS 26.496	\$ 8.190	4	0	4	0,00
MYI	07.2021	AUD 819	620	5	0	5	0,00
	07.2021	€ 22.264	26.554	152	0	152	0,01
	07.2021	\$ 1.939	AUD 2.563	0	(14)	(14)	0,00
	07.2021	6	€ 5	0	0	0	0,00
	08.2021	AUD 2.563	\$ 1.939	14	0	14	0,00
SCX	07.2021	CAD 2.660	2.140	0	(8)	(8)	0,00
	07.2021	€ 71.269	87.187	2.669	0	2.669	0,08
	07.2021	\$ 2.758	£ 1.973	0	(33)	(33)	0,00
SSB	07.2021	8.633	AUD 11.158	0	(256)	(256)	(0,01)
	07.2021	6.697	£ 4.724	0	(171)	(171)	(0,01)
TOR	07.2021	CAD 6.279	\$ 5.198	127	0	127	0,00
UAG	07.2021	AUD 6.865	5.321	167	0	167	0,01
	07.2021	\$ 9.424	AUD 12.423	0	(97)	(97)	0,00
	08.2021	AUD 12.423	\$ 9.425	97	0	97	0,00
				\$ 9.909	\$ (1.471)	\$ 8.438	0,27

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2021 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2021	€ 99	\$ 120	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
CBK	07.2021	\$ 26.301	€ 22.093	0	(101)	(101)	0,00
MYI	07.2021	€ 281	\$ 341	8	0	8	0,00
RBC	07.2021	\$ 80.430	€ 65.744	0	(2.463)	(2.463)	(0,08)
SCX	07.2021	€ 10	\$ 12	0	0	0	0,00
	07.2021	\$ 94.149	€ 76.959	0	(2.883)	(2.883)	(0,09)
SSB	07.2021	€ 120	\$ 143	1	0	1	0,00
	07.2021	\$ 19	€ 16	0	0	0	0,00
TOR	07.2021	93.962	76.806	0	(2.878)	(2.878)	(0,09)
				\$ 12	\$ (8.325)	\$ (8.313)	(0,26)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (117)	0,00
Summe Anlagen						\$ 3.150.555	98,31
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 54.157	1,69
Nettovermögen						\$ 3.204.712	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
(b) Wertpapier per Emissionstermin.
(c) Nullkuponwertpapier.
(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
(e) Mit dem Fonds verbunden.
(f) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
CIMIC Group Ltd.	0,010 %	09.07.2021	23.02.2021	\$ 2.298	\$ 2.298	0,07
Deutsche Bank AG	0,898	28.05.2024	25.05.2021 - 26.05.2021	2.603	2.589	0,08
				\$ 4.901	\$ 4.887	0,15

Aufstellung der Wertpapieranlagen US Short-Term Fund (Forts.)

(g) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2021 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 613 und Barmittel in Höhe von USD 4.550 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 12.738 wurden zum 30. Juni 2021 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.789.612	\$ 53.067	\$ 2.842.679
Investmentfonds	5.328	308.709	0	314.037
Finanzderivate ⁽³⁾	(4.989)	(1.172)	0	(6.161)
Summen	\$ 339	\$ 3.097.149	\$ 53.067	\$ 3.150.555

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2020 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.032.605	\$ 35.638	\$ 3.068.243
Investmentfonds	37.224	341.068	0	378.292
Pensionsgeschäfte	0	213.234	0	213.234
Finanzderivate ⁽³⁾	(1.334)	(4.057)	(12)	(5.403)
Summen	\$ 35.890	\$ 3.582.850	\$ 35.626	\$ 3.654.366

⁽¹⁾ 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.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 10	\$ 0	\$ 10
BPS	570	(350)	220
CBK	(90)	0	(90)
FAR	(22)	0	(22)
GLM	5.113	(4.520)	593
GSC	(66)	0	(66)
HUS	(326)	281	(45)
JPM	257	(260)	(3)
MYI	165	0	165
RBC	(2.463)	2.150	(313)
SCX	(255)	0	(255)
SSB	(426)	332	(94)
TOR	(2.751)	2.400	(351)
UAG	167	0	167

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

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

	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	39,05	37,73
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	48,36	44,39
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,29	1,85
Investmentfonds	9,80	10,35
Pensionsgeschäfte	k. A.	5,84
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,19)	(0,04)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	(0,07)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,00	(0,05)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2021 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Australien	0,09	0,36
Bermudas	k. A.	0,08
Kanada	k. A.	0,76
Cayman Inseln	3,92	4,90
Chile	0,09	0,08
China	k. A.	0,10

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2021 (%)	31. Dez. 2020 (%)
Dänemark	0,91	0,75
Finnland	0,19	0,17
Frankreich	0,30	0,68
Deutschland	0,27	0,06
Hongkong	0,50	0,56
Indien	0,68	0,31
Irland	3,34	2,27
Israel	0,07	0,07
Japan	3,71	4,38
Jersey, Kanalinseln	0,09	0,08
Luxemburg	0,01	0,03
Multinational	k. A.	0,01
Niederlande	0,91	0,78
Katar	k. A.	0,03
Saudi-Arabien	0,20	0,18
Singapur	0,45	0,78
Südkorea	0,53	0,78
Spanien	0,03	k. A.
Supranational	0,89	k. A.
Schweiz	0,11	0,20
Vereinigte Arabische Emirate	0,57	0,50
Großbritannien	10,04	11,78
USA	50,67	50,15
Kurzfristige Instrumente	10,13	3,14
Investmentfonds	9,80	10,35
Pensionsgeschäfte	k. A.	5,84
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,19)	(0,04)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	(0,12)
Zinsswaps — Basisswaps	0,00	0,00
Zinsswaps	k. A.	0,05
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	0,00
Devisenterminkontrakte	0,27	(0,24)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,26)	0,19
Sonstige Aktiva und Passiva	1,69	0,00
Nettovermögen	100,00	100,00

1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die einzelnen in diesem Bericht beschriebenen Teilfonds (nachfolgend jeweils als ein „Teilfonds“ und gemeinsam als die „Teilfonds“ bezeichnet) sind Teilfonds der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und mit gesonderter Haftung zwischen den Teilfonds und mit beschränkter Haftung, die gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 in Irland eingetragen und von der Zentralbank von Irland (die „Zentralbank“) nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren („OGAW“)) (Verordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinien“) genehmigt wurde. Bei der Gesellschaft handelt es sich um eine Umbrella-Gesellschaft, die aus verschiedenen Teilfonds besteht, die jeweils eine oder mehrere Anteilklassen umfassen. Nach dem Ermessen des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“ oder die „Verwaltungsratsmitglieder“) dürfen für einen Teilfonds mehrere Anteilklassen („Klassen“) ausgegeben werden. Für jeden einzelnen Teilfonds wird ein gesondertes Vermögenswertportfolio geführt, welches in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die auf diesen Teilfonds zutreffen, angelegt wird. Der Verwaltungsrat darf mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Teilfonds auflegen. Der Verwaltungsrat darf gemäß den Anforderungen der Zentralbank zu gegebener Zeit Klassen Teilfonds auflegen. Die Gesellschaft wurde am 10. Dezember 1997 gegründet.

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

Wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft vorgesehen, wurden Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Ltd und PIMCO Europe GmbH (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) als Anlageberatungsgesellschaften für verschiedene Teilfonds der Gesellschaft bestellt. PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) haben von der Zentralbank die Genehmigung erhalten, als Anlageberatungsgesellschaft für irische Fonds zu agieren.

Gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft kann jede Anlageberatungsgesellschaft die diskretionäre Anlageverwaltung der Teilfonds vorbehaltlich aller gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen einer oder mehreren Unter-Anlageberatungsgesellschaften übertragen. Wenn für einen bestimmten Teilfonds eine Anlageberatungsgesellschaft bestellt wurde, hat die Anlageberatungsgesellschaft die jeweils übrigen Anlageberatungsgesellschaften, PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd., als Unter-Anlageberatungsgesellschaft bezüglich des bzw. der jeweiligen Fonds bestellt. Die Gebühren der einzelnen entsprechend bestellten Unter-Anlageberatungsgesellschaften sind von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften im Namen der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr zu begleichen.

Parametric Portfolio Associates, LLC wurde bestellt, um die Umsetzung der Anlagepolitik des Strategic Income Fund zu unterstützen und verfügt über einen begrenzten Ermessensspielraum bei der Anlage. In dieser Hinsicht verfügt Parametric Portfolio Associates, LLC über eine Ermessensbefugnis, für die bestimmte Parameter und Einschränkungen gelten, die zwischen der Anlageberatungsgesellschaft und Research Affiliates, LLC vereinbart wurden. Research Affiliates, LLC wurde zur Unter-Anlageberatungsgesellschaft mit Ermessensbefugnis bezüglich der oben erwähnten Fonds bestellt.

Der Sitz der Gesellschaft befindet sich in 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irland.

2. WICHTIGE BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Die bei der Erstellung dieses Abschlusses verwendeten wesentlichen Rechnungslegungs- und Schätzungsmethoden sind mit denen konform, die die Gesellschaft für den geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (der „geprüfte Jahresabschluss“) verwendet hat. Die Jahresabschlüsse werden für alle Fonds unter der Fortführungsprämisse erstellt.

Erstellungsgrundlage

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

Der ungeprüfte verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Jahresabschluss, der von den Abschlussprüfern einen uneingeschränkten Bestätigungsvermerk erhalten hat und der im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen (FRS 102), dem Irischen Statut, bestehend aus dem Companies Act (Gesetz über Aktiengesellschaften) von 2014 und den OGAW-Richtlinien erstellt wurde, gelesen werden. Bei den in Irland

allgemein für die Erstellung von Rechnungsabschlüssen anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen handelt es sich um diejenigen, die vom FRC herausgegeben werden.

Die in der Aufstellung der ausgewiesenen Gesamtgewinne und -verluste sowie in einer Überleitung der Eigenkapitalveränderungen aufzuführenden Angaben sind nach Meinung des Verwaltungsrats in der Betriebsergebnisrechnung sowie im Ausweis der Nettovermögensänderungen 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.

Dieser Abschluss wurde nach der Anschaffungskostenregelung unter Zugrundelegung der Neubewertung der ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten Finanzvermögen und -verbindlichkeiten aufgestellt.

Alle Beträge wurden, sofern nicht anders angegeben, auf die nächsten Tausend gerundet. Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Die Aufstellung der Wertpapieranlagen bestimmter Fonds kann übertragbare Wertpapiere enthalten, die sowohl einen Nennwert von Null als auch einen beizulegenden Marktwert von Null aufweisen, wenn der tatsächliche Nennwert und der beizulegende Marktwert auf die nächsten Tausend gerundet werden.

3. ANLAGEN ZUM MARKTWERT UND MARKTBEWERTUNGSHIERARCHIE

Die Gesellschaft muss Angaben bezüglich der Marktbewertungshierarchie machen, in die die Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingestuft werden. Die Angaben beruhen auf einer dreistufigen Marktbewertungshierarchie für die in Bewertungsverfahren zur Bemessung des beizulegenden Zeitwerts verwendeten Inputfaktoren.

Der beizulegende Zeitwert ist definiert als der Betrag, zu dem in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ein Vermögenswert ausgetauscht, eine Verbindlichkeit beglichen oder ein Eigenkapitalinstrument gewährt würde. Es sind getrennte Angaben zur Marktbewertungshierarchie für jede Hauptklasse von Aktiva und Passiva erforderlich, die die Bewertung zum Marktwert in Stufen teilt (Stufen 1, 2 und 3). Diese Inputfaktoren oder Verfahren zur Bewertung von Wertpapieren geben nicht unbedingt das Risiko wieder, dass mit der Anlage in diesen Wertpapieren verbunden ist. Die Stufen 1, 2 und 3 der Marktbewertungshierarchie sind wie folgt definiert:

- Stufe 1 – Quotierte Preise auf aktiven Märkten oder Börsen für identische Aktiva und Passiva.
- Stufe 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.
- Stufe 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 nach seinem Ermessen handeln, einschließen kann.

Eine Analyse der zum beizulegenden Marktwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Teilfonds zum 30. Juni 2021 und zum 31. Dezember 2020 ist der Aufstellung der Wertpapieranlagen zu entnehmen. Die von den Fonds angewandte Methode zur Klassifizierung der zum beizulegenden Marktwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten unter Verwendung einer Marktwertwerthierarchie stimmt mit der in den geprüften Jahresabschlüssen angewandten Methode überein, mit Ausnahme von US-Terminkontrakten auf festverzinsliche Wertpapiere, deren Bewertung während des Berichtszeitraums vom Abwicklungspreis um 15:00 Uhr an der Börse auf den Mittelkurs um 16:00 Uhr verschoben wurde und die nun von PIMCO als Stufe 2 der Zeitwerthierarchie eingestuft werden, nachdem sie zuvor als Stufe 1 eingestuft wurden.

4. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Innerhalb der durch die Anlageziele und Anlagepolitik der Teilfonds und nach Maßgabe der von der Zentralbank jeweils festgesetzten Grenzen und des laut Prospektbestimmungen erlaubten Umfangs

sind die Finanzderivate und Anlagetechniken von allen Teilfonds für eine effiziente Portfolioverwaltung einzusetzen. Die Teilfonds können diese Finanzderivate und Anlagetechniken zur Absicherung gegen Zinsänderungen, Devisenkursänderungen in anderen Währungen als der Funktionswährung, gegen Änderungen in Wertpapierkursen oder als Teil ihrer allgemeinen Anlagestrategie einsetzen.

Der durch die Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt USD 801.665/(USD 2.493.637) (30. Juni 2020: USD 10.524.727/(USD 444.719)).

Der durch die Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt USD 2.300.919/(USD 6.866.201) (30. Juni 2020: USD 10.680.57/(USD 100.488.606)).

Der durch die Rückkaufgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt USD 235.411/(USD 132.328) (30. Juni 2020: USD 215.306/(USD 3.252.502)).

5. DIVIDENDENAUSCHÜTTUNGSPOLITIK

Wie in der jeweiligen Teilfondsergänzung angegeben, können Dividendenausschüttungen festgesetzt werden auf:

- Nettokapitalerträge, die aus Zinsen und Dividenden abzüglich Aufwendungen bestehen.
- Realisierte Gewinne aus der Veräußerung von Anlagen abzüglich realisierter und nicht realisierter Verluste (einschließlich Gebühren und Aufwendungen). Für den Fall, dass die bei der Veräußerung von Anlagen realisierten Gewinne abzüglich der realisierten und nicht realisierten Verluste negativ sind, können die Teilfonds dennoch Dividenden aus den Nettokapitalerträgen und/oder Kapital bezahlen.
- Andere Mittel (einschließlich Kapital), die nach dem Gesetz aus dem betreffenden Teilfonds bzw. der betreffenden Anteilsklasse des betreffenden Teilfonds ausgeschüttet werden können.

Verwaltungsgebühren und andere Gebühren oder ein Teil davon können dem Kapital belastet werden. Das kann dazu führen, dass das Kapital sinkt und Erträge mit einem verminderten Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erwirtschaftet werden. Dieser Zyklus kann sich solange fortsetzen, bis das Kapital aufgezehrt ist. Der Grund für die Belastung des Kapitals ist, den an die Anteilhaber ausschüttbaren Betrag zu maximieren.

Für die Anteilsklasse Income II kann der Verwaltungsrat in seinem Ermessen entscheiden, die Gebühren aus dem Kapital zu bezahlen und das Renditedifferenzial zwischen den jeweiligen abgesicherten Anteilsklassen und den grundlegenden Anteilsklassen zu berücksichtigen (was einer Ausschüttung aus dem Kapital entspricht). Das Renditedifferenzial kann positiv oder negativ sein und wird unter Berücksichtigung des Beitrags der Anteilsklassenbesicherung aus den besicherten Klassen berechnet.

Im Fall der Anteilsklassen M Retail und des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, des Asia Strategic Interest Bond Fund, des Euro Income Bond Fund, des Euro Short-Term Fund, des Income Fund, des Low Duration Income Fund, des Mortgage Opportunities Fund und des US Short-Term Fund werden, mit Ausnahme der Anteilsklassen G Institutional, G Retail, Class E ausschüttend Q, Class E ausschüttend II Q und Investor ausschüttend A, Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Anteilsklassen G Institutional, G Retail und Investor ausschüttend A werden Dividenden jährlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilhabers jährlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Im Falle aller anderen Teilfonds mit ausschüttenden Anteilsklassen werden Ausschüttungen vierteljährlich festgesetzt und werden, abhängig von der Entscheidung des Anteilhabers, in bar ausgezahlt oder nach der Erklärung in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Dividendenausschüttungen an Inhaber rückgabeberechtigter Anteile werden in der Betriebsergebnisrechnung als Finanzierungskosten klassifiziert. Die auf die thesaurierenden Anteile entfallenden Erträge oder Kapitalzuwachs werden weder festgesetzt noch ausgeschüttet. Stattdessen wird der Nettoinventarwert (NIW) je Anteil der thesaurierenden Anteile entsprechend dieser Erträge oder dieses Wertzuwachses erhöht. Dividendenausschüttungen, die nicht in Anteile reinvestiert werden, werden den Anteilhabern per Banküberweisung ausgezahlt. Dividendenausschüttungen, die nach Ablauf von sechs Jahren ab dem Datum ihrer Erklärung nicht eingefordert werden, verfallen und fließen an den jeweiligen Teilfonds zurück. Die Anteilhaber können sich entscheiden, die Dividendenausschüttungen in zusätzliche Anteile zu reinvestieren oder sich die

Dividendenausschüttungen bar auszahlen zu lassen, indem sie das entsprechende Kästchen im Antragsformular auswählen.

Für die nachfolgenden Teilfonds wurde ein Teil der Dividendenausschüttungen gemäß der Betriebsergebnisrechnung aus dem Kapital gezahlt (Angaben in Tausend):

Fonds	Am 30. Jun. 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2020 abgeschlossener Berichtszeitraum
Diversified Income Duration Hedged Fund	\$ 810	\$ 0
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 3.474	€ 1.030
Euro Income Bond Fund	0	3.716
Global Bond Ex-US Fund	\$ 1	\$ 0
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	885	0
Global Investment Grade Credit ESG Fund	5	0
Global Low Duration Real Return Fund	41	0
Income Fund	0	1.542
Low Duration Income Fund	0	3
UK Long Term Corporate Bond Fund	£ 28	£ 0

6. 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. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann diesen Brokern Full-Service-Provisionssätze zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen verwendet werden können. Diejenigen Anlageberatungsgesellschaften, bei denen es sich um MiFID-Investmentgesellschaften handelt oder die gleichwertigen aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterliegen, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Teilfonds 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. Dementsprechend sind etwaige Verbindlichkeiten, die im Namen eines Teilfonds der Gesellschaft entstanden oder diesem zuzuordnen sind, ausschließlich aus den Vermögenswerten des betreffenden Teilfonds zu begleichen, und weder die Gesellschaft noch ein Verwaltungsratsmitglied, Konkursverwalter, Revisor, Insolvenzverwalter, kommissarischer Insolvenzverwalter oder eine sonstige Person dürfen die Vermögenswerte dieses Teilfonds zum Ausgleich von Verbindlichkeiten im Namen eines anderen Teilfonds der Gesellschaft verwenden oder sind verpflichtet, sie hierzu zu verwenden, unabhängig davon, wann diese Verbindlichkeit entstanden ist.

8. ÄNDERUNGEN AM PROSPEKT, AN DER GRÜNDUNGSUKRUNDE UND DER SATZUNG

Am 13. Januar 2021 wurde die Ergänzung für den Diversified Income Fund aktualisiert, um klarzustellen, dass Ausschüttungen für die Anteilsklassen N Retail im Fonds monatlich festgesetzt werden.

Am 9. März 2021 wurden der Verkaufsprospekt und die Ergänzungen für das Unternehmen gemäß der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR) aktualisiert und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen. Darüber hinaus wurden an diesem Tag die Anlageziele des Emerging Markets Bond ESG Fund, des Global Bond ESG Fund und des Global Investment Grade Credit ESG Fund dahingehend geändert, dass sie nachhaltige Anlagen einschließen und somit speziell auf nachhaltige Anlagen ausgerichtet sind.

Am 26. März 2021 wurde der PIMCO ESG Income Fund von der Zentralbank zugelassen, und die Ergänzung für diesen Teilfonds wurde in den konsolidierten Verkaufsprospekt aufgenommen.

Am 19. April 2021 wurde die Ergänzung für den PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund aktualisiert, um die Angaben zum Gebührenverzicht zu berücksichtigen.

Am 25. Mai 2021 wurde die Ergänzung für den PIMCO Climate Bond Fund aktualisiert und dabei ein Verzicht auf Verwaltungsgebühren für die Investor-Anteilsklassen eingeführt; zudem wurde die Ergänzung für den Euro Short-Term Fund aktualisiert und dabei ein Verzicht auf Verwaltungsgebühren für alle Anteilsklassen eingeführt; außerdem wurde die Ergänzung für den Euro Credit Fund aktualisiert und bekannt gegeben, dass die vorhandenen Verwaltungsgebühren für die Class H Institutional bis zum 19. Januar 2023 verlängert wurden.

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Die Gründungsurkunde und die Satzung des Gesellschaft wurden während des Berichtszeitraums nicht geändert.

9. GEBÜHREN UND KOSTEN

(a) An die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Gebühren

Die an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlenden Gebühren sind im Verkaufsprospekt aufgeführt und dürfen 2,50 % per annum des NIW des jeweiligen Teilfonds nicht übersteigen.

(b) Verwaltungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder liefert für jeden Teilfonds, wie im Verkaufsprospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste, für die jeder Teilfonds eine einzige Verwaltungsgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Verwaltungsgebühr (wie im Verkaufsprospekt definiert) für jeden Teilfonds läuft an jedem Handelstag (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Teilfonds definiert) auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Verwaltungsgebühr vollständig oder teilweise an die Anlageberatungsgesellschaften entrichten, um die von diesen erbrachten Anlageberatungs- und anderen Dienste zu bezahlen und damit die Anlageberatungsgesellschaften die Kosten für die Administrations-, Verwahr- und anderen Dienste begleichen können, die die Verwaltungsgesellschaft für die Teilfonds erbracht hat.

Die Verwaltungsgebühr für die einzelnen Klassen der einzelnen Teilfonds (angegeben in Prozent pro Jahr ihres NIW) lautet wie folgt:

	Anteilsklassen Inst'l, G Inst'l, Inv, Admin (%)	H Inst'l (%)	Class E, G Retail, M Retail, N Retail Class T (%)	Class R (%)	Class W (%)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	0,65	0,82	1,55	k. A.	k. A.
Asia Strategic Interest Bond Fund	0,65	k. A.	1,50	k. A.	k. A.
PIMCO Capital Securities Fund	0,79	k. A.	1,69	0,93	k. A.
PIMCO Climate Bond Fund ⁽¹⁾	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.
Commodity Real Return Fund	0,74	k. A.	1,64	k. A.	k. A.
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	0,90	k. A.	1,80	k. A.	k. A.
Diversified Income Fund	0,69	0,86	1,59	k. A.	0,55
Diversified Income Duration Hedged Fund	0,69	k. A.	1,59	k. A.	k. A.
Dynamic Bond Fund	0,90	1,07	1,80	0,99	k. A.
Dynamic Multi-Asset Fund	0,85	1,02	1,85	k. A.	k. A.
Emerging Local Bond Fund	0,89	1,06	1,89	k. A.	k. A.
Emerging Markets Bond Fund	0,79	0,96	1,69	k. A.	k. A.
Emerging Markets Bond ESG Fund	0,89	k. A.	1,74	k. A.	k. A.
Emerging Markets Corporate Bond Fund	0,95	k. A.	1,85	k. A.	k. A.
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund ⁽²⁾	0,95	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	0,85	k. A.	1,75	k. A.	k. A.
PIMCO ESG Income Fund	0,59	k. A.	1,49	0,82	k. A.
Euro Bond Fund	0,46	k. A.	1,36	k. A.	k. A.
Euro Credit Fund ⁽³⁾	0,46	0,38	1,36	k. A.	k. A.
Euro Income Bond Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.
Euro Long Average Duration Fund	0,46	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.

	Anteilsklassen Inst'l, G Inst'l, Inv, Admin (%)	H Inst'l (%)	Class E, G Retail, M Retail, N Retail Class T (%)	Class R (%)	Class W (%)
Euro Short-Term Fund ⁽⁴⁾	0,29	k. A.	1,04	k. A.	k. A.
PIMCO European High Yield Bond Fund	0,55	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund ⁽⁵⁾	0,32	0,49	0,82	k. A.	k. A.
Global Advantage Fund	0,70	k. A.	1,70	k. A.	k. A.
Global Bond Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	0,39
Global Bond ESG Fund	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.
Global Bond Ex-US Fund	0,49	0,66	1,39	k. A.	k. A.
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	0,95	k. A.	2,15	k. A.	k. A.
Global High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.
Global Investment Grade Credit Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	0,39
Global Investment Grade Credit ESG Fund	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.
Global Libor Plus Bond Fund	0,49	k. A.	1,20	k. A.	k. A.
Global Low Duration Real Return Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.
Global Real Return Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	k. A.
Income Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.
Income Fund II ⁽⁶⁾	0,55	k. A.	1,45	k. A.	k. A.
Inflation Strategy Fund	0,90	k. A.	2,10	k. A.	k. A.
Low Average Duration Fund	0,46	0,63	1,36	0,75	k. A.
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.
Low Duration Income Fund ⁽⁷⁾	0,55	0,72	1,45	k. A.	k. A.
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	0,99	k. A.	2,20	k. A.	k. A.
Mortgage Opportunities Fund	0,69	0,86	1,59	k. A.	k. A.
StocksPLUS TM Fund	0,55	0,72	1,45	k. A.	k. A.
PIMCO StocksPLUS TM AR Fund	0,69	k. A.	1,59	k. A.	k. A.
Strategic Income Fund	0,85	k. A.	1,75	k. A.	k. A.
Total Return Bond Fund	0,50	0,67	1,40	0,77	k. A.
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	1,40	k. A.	2,50	k. A.	k. A.
UK Corporate Bond Fund	0,46	0,63	k. A.	k. A.	k. A.
UK Long Term Corporate Bond Fund	0,46	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
US High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.
US Investment Grade Corporate Bond Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.
US Short-Term Fund ⁽⁸⁾	0,45	0,62	0,85	k. A.	k. A.

⁽¹⁾ Bei dieser Zahl wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,05 % für die Investor Class von 31. Mai 2021 bis 31. Mai 2023 nicht berücksichtigt. Der Gebührenverzicht endet am 1. Juni 2023.

- (2) Bei allen Klassen (mit Ausnahme der Class R, Class E, M Retail und Class T) wird bei dieser Zahl ein Gebührenerzicht des Managers in Höhe von 0,10 % p.a. bis 31. März 2021 berücksichtigt. Der Gebührenerzicht endete am 1. April 2021. Bei dem in der Tabelle angegebenen Wert ist der Gebührenerzicht nicht berücksichtigt.
- (3) In den Gebühren der Class H Institutional wird ein Gebührenerzicht des Managers in Höhe von 0,25 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenerzicht wird bis zum 30. Juni 2022 verlängert und läuft zum 1. Juli 2022 ab.
- (4) In den Gebühren der Class Institutional und der Class E wird ein Gebührenerzicht des Managers in Höhe von 0,11 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenerzicht läuft zum 19. Januar 2023 ab.
- (5) Bei der Institutional und der Class H Institutional wird bei dieser Zahl ein Gebührenerzicht des Managers in Höhe von 0,14 % p.a. berücksichtigt. Für die Class E wird ein Gebührenerzicht des Managers in Höhe von 0,54 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenerzicht läuft am 18. Januar 2023 ab.
- (6) Bei allen Klassen wird bei dieser Zahl ein Gebührenerzicht des Managers in Höhe von 0,04 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenerzicht läuft zum 1. Januar 2023 ab.
- (7) Bei allen Klassen wird bei dieser Zahl ein Gebührenerzicht des Managers in Höhe von 0,05 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenerzicht verlängert sich für alle Klassen bis zum 31. Dezember 2022 und läuft zum 1. Januar 2023 ab.
- (8) In den Gebühren für die Anteilsklassen Class E, G Retail und M Retail wird ein Gebührenerzicht des Managers in Höhe von 0,30 % p.a. berücksichtigt, der sich bis zu dem Zeitpunkt verlängert, zu dem der Manager durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Teilfonds entscheidet, diesen Gebührenerzicht künftig nicht mehr anzuwenden oder zu reduzieren.

Die Verwaltungsgebühren aller Teilfonds blieben mit Ausnahme der oben angeführten Änderungen an den Gebührenerzichten gegenüber dem 31. Dezember 2020 unverändert.

Der PIMCO ESG Income Fund und Income Fund II wurden während dieses Berichtszeitraums aufgelegt.

Die Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen H Institutional, Class E, G Retail, M Retail und Class T fällt allgemein höher aus als die Verwaltungsgebühr für die anderen Anteilsklassen. Aus dieser höheren Gebühr kann die Verwaltungsgesellschaft die Kosten für Vertriebs-, Mittler- oder andere Dienste begleichen, die Vertriebsstellen, Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder andere Intermediäre den Anteilinhabern dieser Anteilsklassen der Teilfonds direkt oder indirekt erbringen. Da es sich bei der Verwaltungsgebühr um einen festen Betrag handelt, wird das Risiko von Preiserhöhungen bei den Kosten für durch die Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste von der Verwaltungsgesellschaft und nicht von den Anteilinhabern getragen. Die Verwaltungsgesellschaft trägt darüber hinaus das Risiko, dass das Ausgabenniveau für diese Dienste aufgrund eines sinkenden Nettovermögens die Höhe der Verwaltungsgebühr übersteigt. Auf der anderen Seite würde die Verwaltungsgesellschaft, und nicht die Anteilinhaber, von allen Preissenken bei den Kosten für die Dienste profitieren, die die Verwaltungsgebühr abdeckt. Dazu zählen gesunkene Ausgabenniveaus, in Prozent vom Nettovermögen, aufgrund steigenden Nettovermögens.

Aufgrund der Art der Emission von Class Z wird in der Betriebsergebnisrechnung keine Verwaltungsgebühr ausgewiesen (die Class Z werden primär für andere Teilfonds der Gesellschaft oder für Direktanlagen durch institutionelle Anleger angeboten, die mit den Anlageberatungsgesellschaften oder einem verbundenen Unternehmen von PIMCO eine Anlageverwaltungsvereinbarung oder sonstige Vereinbarung abgeschlossen haben). Um doppelte Gebühren zu vermeiden, wird die Verwaltungsgebühr für die Class Z auf 0,00 % pro Jahr festgesetzt.

(c) Anlageberatungsdienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Anlageberatungsdienstleistungen. Zu diesen Dienstleistungen gehören die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte jedes Teilfonds. Die Gebühren der Anlageberatungsgesellschaften (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr beglichen.

(d) Administrations-, Verwahr- sowie sonstige Dienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste. Diese Dienste beinhalten Administrations-, Übertragungsstellen-, Fondsbuchhaltungs-, Verwahr- und Unterdepotdienste für die einzelnen Teilfonds. Die Gebühren und Aufwendungen des Administrators und der Verwahrstelle (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr bzw. von den Anlageberatungsgesellschaften gezahlt.

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft bestimmte sonstige Dienste. Diese können enthalten: Dienste der Notierungs- und Zahlstellen- sowie sonstige Vertretungsdienste vor Ort, Buchhaltungs-, Prüf-, Rechts- sowie sonstige Dienste qualifizierter Berater, Gesellschaftssekretärsdienste, Druck-, Veröffentlichungs- und Übersetzungsdienste sowie die Erbringung und Koordination bestimmter Aufsichts-, Administrations- und Anteilinhaberdienste, die für den Betrieb der Teilfonds erforderlich sind. Gebühren und ordentliche Aufwendungen für diese Dienste (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften für die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr gezahlt.

Die Teilfonds übernehmen sonstige Aufwendungen im Zusammenhang mit ihrem Betrieb, die nicht von der Verwaltungsgebühr abgedeckt werden und die variieren und die Gesamthöhe der Aufwendungen der Teilfonds beeinflussen können. Hierzu zählen unter anderem Steuern und staatliche Abgaben, Maklergebühren, Provisionen und sonstige Transaktionskosten (einschließlich u. a. Gebühren und Aufwendungen im Zusammenhang mit Due-Diligence-Prüfungen von Anlagen und potenziellen Anlagen und/oder im Zusammenhang mit Verhandlungen über solche 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 bezahlte den unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2021 Honorare in Höhe von EUR 90.000 (30. Juni 2020: €90.000). Darüber hinaus werden jedem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied alle angemessenen Auslagen erstattet. Nicht unabhängige Verwaltungsratsmitglieder erhalten eine separate Vergütung für ihre Tätigkeit als Verwaltungsratsmitglieder der Fonds. Die Verwaltungsrats honorare sind in den „Sonstigen Aufwendungen“ der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

Servicegebühr Die Servicegebühr, die ausschließlich für die Investor Classes anfällt, ist an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen und darf verwendet werden, um Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu vergüten, die Dienste im Zusammenhang mit dem Vertrieb und der Vermarktung von Anteilen erbringen und/oder für die Erbringung bestimmter Anteilinhaberdienstleistungen oder für die Verwaltung von Plänen oder Programmen, die Teilfondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, und um sonstige verbundene Aufwendungen zu erstatten (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert). Die Verwaltungsgesellschaft erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Anteilinhaber der Investor Classes. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten identische Dienstleistungen für die erhobenen Gebühren. Diese Dienste können beinhalten: die Beantwortung von Anteilinhaberanfragen zu den Teilfonds und ihrer Wertentwicklung, die Unterstützung von Anteilinhabern beim Erwerb, der Rücknahme und dem Tausch von Anteilen, die Führung von individueller Kontoinformationen und die Bereitstellung von Kontoauszügen an die Anteilinhaber sowie die Führung sonstiger Unterlagen, die für die Anlage der Anteilinhaber im Teilfonds relevant sind.

Pläne oder Programme, die Teilfondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, können fondsgebundene Versicherungsprodukte sowie Pensions-, Altersvorsorgungs- oder Sparpläne von Arbeitgebern beinhalten. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten Dienstleistungen entsprechend der Vereinbarungen mit den Finanzintermediären, mit denen die Anteilinhaber ein Dienstleistungsverhältnis unterhalten. Die Servicegebühr errechnet sich jährlich aus 0,35 % des NIW des jeweiligen Teilfonds, der auf die Investor Classes entfällt. Die Servicegebühren blieben seit dem 31. Dezember 2020 unverändert. Die Servicegebühr wird aus dem NIW gezahlt, der auf den NIW der Investor Classes dieser Teilfonds entfällt. Die Servicegebühr für die einzelnen Teilfonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Servicegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Bestandspflegegebühr Die Bestandspflegegebühr für Administrative-Anteilsklassen ist zahlbar an die Vertriebsstelle für persönliche Dienstleistungen, die sie den Anteilinhabern der Teilfonds erbringt, und für die Führung der Anteilinhaberkonten, einschließlich der Vergütung und der Aufwendungen (einschließlich Telefonkosten und Gemeinkosten) von Finanzberatern und sonstigen Mitarbeitern beteiligter oder involvierter Händler, bestimmter Banken oder anderer Finanzintermediäre, die bei der Abwicklung von Kauf- oder Rücknahmeanträgen oder der Abwicklung von Dividendenzahlungen unterstützend tätig sind, den Anteilinhabern regelmäßig Informationen über ihre Beteiligung an den Teilfondsanteilen liefern, Informationen von der Gesellschaft an die Anteilinhaber weitergeben, laufende Beratungsleistungen in Bezug auf die Eignung bestimmter vom Teilfonds angebotener Anlagemöglichkeiten vor dem Hintergrund der Anteilinhaberanforderungen erbringen, Anfragen der Anteilinhaber zu diesen Diensten beantworten oder Mitarbeiter für die Erbringung derartiger Dienste schulen.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Administrative-Anteilsklassen. Die Bestandspflegegebühr wird auf Basis eines prozentualen Anteils des NIW des jeweiligen Teilfonds berechnet und den jeweiligen Anteilsklassen der betreffenden Teilfonds wie im Verkaufsprospekt angegeben zugewiesen. Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Teilfonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Bestandspflegegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Teilfonds (dargestellt in Prozent des NIW) beläuft sich mit Ausnahme des StocksPLUS™ Fund auf 0,50 % p.a. des auf die Administrative Classes entfallenden NIW. Die Bestandspflegegebühr für den StocksPLUS™ Fund (dargestellt in Prozent des NIW) beläuft sich 0,75 % p.a. des auf die Administrative Classes entfallenden NIW.

Die Servicegebühren blieben seit dem 31. Dezember 2020 unverändert.

(e) Vertriebsgebühr

Die Vertriebsgebühr, die für die Anteilsklassen der Class T anwendbar ist, wird an die Vertriebsstelle für Dienstleistungen bezahlt, die diese Anteilhabern des Teilfonds erbracht hat.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Anteilsklassen der T Class. Die Vertriebsgebühr errechnet sich jährlich aus 0,40 % des NIW des jeweiligen Teilfonds, der auf die Anteilsklassen der Class T entfällt, außer in Bezug auf den PIMCO Asia High Yield Bond Fund, den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, den Dynamic Bond Fund, den Euro Bond Fund, den Global Bond Fund, den Global Bond ESG Fund, den Global Bond Ex-US Fund, den Global Libor Plus Bond Fund, den Global Low Duration Real Return Fund, den Global Real Return Fund, den PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund und den Total Return Bond Fund. Für diese Teilfonds wird eine Vertriebsgebühr in Höhe von 0,30 % p.a. auf den NIW der Anteilklasse Class T dieser Teilfonds bezahlt.

Die Vertriebsgebühr für die einzelnen Teilfonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Vertriebsgebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

(f) Ausgabenbegrenzung (einschließlich Verzicht auf und Nachzahlung von Verwaltungsverbindlichkeiten)

Gemäß der geltenden Fassung des Verwaltungsvertrags zwischen der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft vom 28. Januar 1998 ist die Verwaltungsgesellschaft mit der Gesellschaft übereingekommen, die gesamten jährlichen Betriebskosten eines Teilfonds für alle Klassen des Teilfonds zu verwalten, wobei sie auf ihre Verwaltungsgebühr ganz oder teilweise verzichtet bzw. diese ganz oder teilweise reduziert oder erstattet, falls (und für den Zeitraum, in dem) diese Betriebskosten aufgrund gezahlter Gründungskosten sowie anteiliger Verwaltungsratsgehälter die Summe aus der Verwaltungsgebühr der Klasse dieses Teilfonds (vor Anrechnung eines etwa anwendbaren Verzichts auf die Verwaltungsgebühr) aus etwa anfallenden Service- und Bestandspflegegebühren sowie aus sonstigen von dieser Teilfondsklasse zu tragenden Kosten, die die oben beschriebene Verwaltungsgebühr nicht abdeckt, (ausgenommen Gründungskosten und anteilige Verwaltungsratsgehälter) zzgl. 0,0049 % pro Jahr (täglich auf Basis des Teilfonds-NIW berechnet) überschreiten.

In jedem Monat, in dem der Verwaltungsvertrag gilt, darf die Verwaltungsgesellschaft von einem Teilfonds einen beliebigen Anteil der Verwaltungsgebühr wiedererlangen, auf die sie verzichtet, die sie reduziert oder erstattet hat, und dies gemäß dem Verwaltungsvertrag (der „Erstattungsbeitrag“) während der vorangegangenen 36 Monate, vorausgesetzt dieser an die Verwaltungsgesellschaft gezahlte Betrag erfüllt folgende Bedingungen: 1) er darf pro Jahr 0,0049 % vom durchschnittlichen (täglich berechneten) Nettovermögen der Klasse des betreffenden Teilfonds nicht überschreiten; 2) er liegt nicht über dem Gesamterstattungsbeitrag; 3) enthält keine der Verwaltungsgesellschaft zuvor erstatteten Beträge; bzw. 4) führt nicht dazu, dass eine Klasse eines Teilfonds einen negativen Ertrag behält.

Die in der Betriebsergebnisrechnung angegebene Verwaltungsgebühr wird vor Berücksichtigung des jeweils gegebenenfalls gewährten Verzichts auf Verwaltungsgebühren angegeben. Die Verzichte auf Verwaltungsgebühren werden in der Betriebsergebnisrechnung unter Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen. Die Verwaltungsgebühr wird der Verwaltungsgesellschaft nach Berücksichtigung des Verzichts gezahlt.

10. TRANSAKTIONEN ZWISCHEN VERBUNDENEN PARTEIEN

Bei der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften, den Vertriebsstellen und den Verwaltungsratsmitgliedern handelt es sich um verbundene Parteien. An diese Parteien gegebenenfalls zahlbare Gebühren werden in Erläuterung 9 offengelegt.

Zum 30. Juni 2021 hielt die Verwaltungsgesellschaft 1.701.949 (31. Dezember 2020: 2.472.397) Anteile des US Short-Term Fund.

Die einzelnen Teilfonds dürfen in die anderen Teilfonds der Gesellschaft und/oder andere Organisationen für gemeinsame Anlagen investieren, die von der Anlageberatungsgesellschaft oder mit der Anlageberatungsgesellschaft verbundenen Unternehmen verwaltet werden („verbundene Teilfonds“).

Bestimmte Teilfonds halten Umbrellafonds-interne Überkreuzinvestitionen in Class Z-Anteilen anderer Teilfonds der Gesellschaft. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Class Z und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Class Z dieser Teilfonds 0,00 % pro Jahr.

Die folgenden Teilfonds hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Teilfonds der Gesellschaft eliminiert.

	30. Jun. 2021
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Emerging Markets Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Euro Income Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Mortgage Opportunities Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Libor Plus Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Libor Plus Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund

Die folgenden Teilfonds hielten zum 31. Dezember 2020 Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft im vergleichenden Finanzstatus der Teilfonds eliminiert.

31. Dez. 2020	
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Emerging Markets Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Euro Income Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Mortgage Opportunities Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Libor Plus Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund

Die folgenden Teilfonds hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft in der vergleichenden Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen der Teilfonds eliminiert.

30. Jun. 2020	
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund

30. Jun. 2020	
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Euro Income Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond Fund	Mortgage Opportunities Fund
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Libor Plus Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US High Yield Bond Fund	US Short-Term Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Bestimmte Teilfonds investieren in die Class Z des PIMCO China Bond Fund und des PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, die als mit der Gesellschaft verbunden gelten. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Class Z und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Class Z beider Teilfonds 0,00 % pro Jahr.

Bestimmte Teilfonds investieren in den PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF, den PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF, den PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF und den PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF, und diese gelten als mit der Gesellschaft verbunden. Da diese Teilfonds keine gebührenfreien Anteilsklassen haben, wird die Verwaltungsgebühr vom Dachfonds und dem verbundenen Zielfonds bezahlt. Ein Verzicht auf die Anlageberatungsgebühr wird daher vor der Zahlung durch den Teilfonds an den Manager ausgeglichen, was in der Betriebsergebnisrechnung innerhalb der Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen wird.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2021 und zum 30. Juni 2020 kauften und verkauften die unten erwähnten Teilfonds Wertpapiere verbundener Teilfonds, sie nahmen Käufe und Verkäufe in Bezug auf Überkreuzinvestitionen und Käufe und Verkäufe von Anlagen in verbundenen Teilfonds vor (Angaben in Tausend):

30. Jun. 2021		
Fonds	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 476.155	\$ 310.434
Asia Strategic Interest Bond Fund	69.996	64.354
PIMCO Capital Securities Fund	845.165	1.191.736
PIMCO Climate Bond Fund	11.968	1.494
Commodity Real Return Fund	22.307	0
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	44.767	49.432
Diversified Income Fund	973.923	537.584
Diversified Income Duration Hedged Fund	130.376	134.615
Dynamic Bond Fund	276.373	195.696
Dynamic Multi-Asset Fund	66.749	512
Emerging Local Bond Fund	1.523.472	1.681.711
Emerging Markets Bond Fund	1.455.269	1.411.919
Emerging Markets Bond ESG Fund	332.845	138.221

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	30. Jun. 2021	
	Käufe	Verkäufe
Emerging Markets Corporate Bond Fund	\$ 80.292	\$ 81.268
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	81.047	90.757
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	4.216	11.101
Euro Bond Fund	246.021	385.391
Euro Credit Fund	185.502	181.361
Euro Income Bond Fund	165.192	143.934
Euro Long Average Duration Fund	9.359	19.356
Euro Short-Term Fund	218.575	47.256
PIMCO European High Yield Bond Fund	5.053	17.913
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	64.040	37.222
Global Advantage Fund	84.451	77.945
Global Bond Fund	728.342	862.621
Global Bond ESG Fund	81.937	68.338
Global Bond Ex-US Fund	164.934	113.836
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	307.471	221.627
Global High Yield Bond Fund	882.601	847.028
Global Investment Grade Credit Fund	3.381.312	6.920.596
Global Investment Grade Credit ESG Fund	55.455	42.453
Global Libor Plus Bond Fund	562.966	308.701
Global Low Duration Real Return Fund	133.023	130.500
Global Real Return Fund	311.792	243.309
Income Fund	14.970.668	16.293.363
Income Fund II	5.201	2.800
Inflation Strategy Fund	32.814	28.623
Low Average Duration Fund	271.544	150.048
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	222.950	160.522
Low Duration Income Fund	212.426	210.954
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	35.204	27.500
Mortgage Opportunities Fund	1.481.018	1.550.800
StocksPLUS™ Fund	98.263	187.221
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	500	300
Strategic Income Fund	191.956	234.073
Total Return Bond Fund	523.024	931.031
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	12.402	8.900
UK Corporate Bond Fund	41.989	205.885
UK Long Term Corporate Bond Fund	33.182	51.886
US High Yield Bond Fund	692.948	634.867
US Investment Grade Corporate Bond Fund	123.870	167.666
US Short-Term Fund	151.853	1.137.458

Fonds	30. Jun. 2020	
	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 107.971	\$ 64.306
PIMCO Capital Securities Fund	340.158	570.807
Commodity Real Return Fund	920	23.626
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	25.757	25.745
Diversified Income Fund	3.304.994	2.080.964
Diversified Income Duration Hedged Fund	200.102	235.615
Dynamic Bond Fund	267.841	399.661
Dynamic Multi-Asset Fund	52.538	116.810
Emerging Asia Bond Fund	10.211	12.662
Emerging Local Bond Fund	1.426.290	1.448.838
Emerging Markets Bond Fund	1.130.958	1.064.716
Emerging Markets Bond ESG Fund	97.765	18.642
Emerging Markets Corporate Bond Fund	108.069	109.897
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	78.758	76.376
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	22.832	21.453
Euro Bond Fund	169.228	236.870
Euro Credit Fund	145.155	108.518

Fonds	30. Jun. 2020	
	Käufe	Verkäufe
Euro Income Bond Fund	\$ 299.046	\$ 158.899
Euro Long Average Duration Fund	12.734	10.241
Euro Short-Term Fund	31.353	2.144
PIMCO European High Yield Bond Fund	13.814	6.489
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	29.410	73.482
Global Advantage Fund	86.422	100.422
Global Bond Fund	1.625.320	1.766.477
Global Bond ESG Fund	30.221	23.905
Global Bond Ex-US Fund	117.631	148.822
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	558.034	571.295
Global High Yield Bond Fund	963.534	802.685
Global Investment Grade Credit Fund	4.521.266	4.145.154
Global Investment Grade Credit ESG Fund	10.859	3.728
Global Libor Plus Bond Fund	370.028	391.318
Global Low Duration Real Return Fund	284.322	341.308
Global Real Return Fund	399.795	353.375
Income Fund	14.637.229	15.782.046
Inflation Strategy Fund	25.394	24.900
Low Average Duration Fund	146.130	190.763
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	206.186	153.989
Low Duration Income Fund	111.635	82.086
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	23.792	36.300
Mortgage Opportunities Fund	666.603	652.571
StocksPLUS™ Fund	672.633	645.862
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	301	200
Strategic Income Fund	321.715	398.866
Total Return Bond Fund	720.430	984.318
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	900	1.121
UK Corporate Bond Fund	45.035	54.115
UK Long Term Corporate Bond Fund	42.030	133.059
US High Yield Bond Fund	645.803	499.988
US Investment Grade Corporate Bond Fund	577.384	438.324
US Short-Term Fund	1.204.579	1.245.379

Die folgende Tabelle gibt den Wert der umlaufenden Anteile wieder, die zum 30. Juni 2021 und zum 31. Dezember 2020 von der Allianz Gruppe, von Teilfonds der Gesellschaft, von mit der Gesellschaft verbundenen Teilfonds und von Mitarbeitern der Anlageberatungsgesellschaft als verbundenen Parteien der Gesellschaft gehalten werden und 20 % des Nettovermögens des Teilfonds übersteigen.

Fonds	30. Juni 2021 % Gehalten	31. Dez. 2020 % Gehalten
Asia Strategic Interest Bond Fund	56,57	76,26
PIMCO Climate Bond Fund	36,27	77,61
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	23,83	22,95
Emerging Markets Bond Fund	32,10	29,70
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	35,79	44,86
Euro Credit Fund	21,98	k. A.
PIMCO European High Yield Bond Fund	99,96	99,91
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	59,80	57,19
Global Investment Grade Credit ESG Fund	33,40	k. A.
Income Fund II	100,00	k. A.
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	97,44	98,47
Strategic Income Fund	37,14	48,81
US Short-Term Fund	33,75	30,18

Während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2020 verkaufte der Income Fund Wertpapiere im Wert von USD 153.125.758 (während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2021 wurden keine Wertpapiere verkauft) an Repack Bond Collateral Ltd. (die „Gesellschaft“), eine befreite Gesellschaft mit beschränkter Haftung nach dem Recht der Cayman Inseln, die eine verbundene Partei der Anlageberatungsgesellschaft ist. Es wurden keine Gebühren von der Körperschaft an die Anlageberatungsgesellschaft gezahlt. Zum 30. Juni 2021 hielt der Income Fund 10.285 Schuldverschreibungen (31. Dezember 2020: 11.128 Schuldverschreibungen) von BNP Paribas Issuance BV., die durch von der Körperschaft begebene Schuldverschreibungen besichert sind.

Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs an Anteilen und Verträgen

Zum 30. Juni 2021 hielt V. Mangala Ananthanarayanan 8.757,87 (31. Dezember 2020: 8.757,87) Anteile des Dynamic Multi-Asset Fund, 8.099,97 (31. Dezember 2020: 7.990,84) Anteile des Global Investment Grade Credit Fund und 21.601,33 (31. Dezember 2020: 21.184,85) Anteile des Income Fund, wobei es sich jeweils um Teilfonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2021 hielt Craig A. Dawson 18.118,23 (31. Dezember 2020: 18.118,23) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 92.850,51 (31. Dezember 2020: 92.850,51) Anteile des Global Libor Plus Bond Fund und 97.370,98 (31. Dezember 2020: 97.370,98) Anteile des Low Duration Income Fund, wobei es sich um alle Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2021 hielt David M. Kennedy 4.875,31 (31. Dezember 2020: 5.026,09) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 16.786,79 (31. Dezember 2020: 16.786,79) Anteile des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund. Beide sind Teilfonds der Gesellschaft.

Während der zum 30. Juni 2021 und 30. Juni 2020 endenden Berichtszeiträume hielt kein anderes Verwaltungsratsmitglied eine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Während der zum 30. Juni 2021 und 30. Juni 2020 endenden Berichtszeiträume hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen 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 ist davon überzeugt, dass Vorkehrungen (durch schriftliche Verfahren nachgewiesen) getroffen wurden, um sicherzustellen, dass Transaktionen mit verbundenen Parteien wie oben beschrieben durchgeführt werden, und dass diese Vorkehrungen während des Berichtszeitraums eingehalten wurden.

12. WECHSELKURSE

Um einen gemeinsamen Abschluss für die Teilfonds und Finanzdaten für die Gesellschaft zu erhalten (was nach irischem Gesellschaftsrecht erforderlich ist), wurden die Beträge im Finanzstatus zu dem am 30. Juni 2021 geltenden Wechselkurs von Euro in USD (USD/EUR 0,84324) (31. Dezember 2020: USD/EUR 0,81729) und von Pfund Sterling in USD (USD/GBP 0,72388) (31. Dezember 2020: USD/GBP 0,73156) umgerechnet. Die Beträge in der Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen wurden zu einem durchschnittlichen während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2021 geltenden Wechselkurs von Euro in USD (USD/EUR 0,82989) (30. Juni 2020: USD/EUR 0,90801) und von Pfund Sterling in USD (USD/GBP 0,72041) (30. Juni 2020: USD/GBP 0,79407) umgerechnet.

Die folgende Tabelle gibt die für die Umrechnung der Anlagen und sonstigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf von der Funktionswährung des jeweiligen Teilfonds abweichende Währungen lauten, in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar, die Funktionswährungen von Teilfonds der Gesellschaft, verwendeten Wechselkurse wieder.

Die Wechselkurse für den argentinischen Peso („ARS“) zum 30. Juni 2021 enthalten einen Abschlag von 77 % (31. Dezember 2020: 68 %), der auf eine Abweichung zwischen den offiziellen und inoffiziellen Wechselkursen Argentiniens zurückzuführen ist.

Fremd-währung	30. Jun. 2021 Berichtswesen		
	EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67315
ARS	200,57137	k. A.	169,13000
AUD	1,57962	1,84009	1,33200
BRL	5,95067	k. A.	5,01785
CAD	1,46880	1,71065	1,23830
CHF	1,09619	k. A.	0,92435
CLP	863,46608	k. A.	728,11000
CNH	7,66193	8,92534	6,46085

Fremd-währung	30. Jun. 2021 Berichtswesen		
	EUR	GBP	USD
CNY	7,66264	k. A.	6,46145
COP	4.428,15281	k. A.	3.734,00000
CZK	25,50700	k. A.	21,50855
DKK	7,43625	8,66245	6,27055
DOP	k. A.	k. A.	57,02000
EGP	k. A.	k. A.	15,69500
EUR (or €)	1,00000	1,16490	0,84324
GBP (or £)	0,85845	1,00000	0,72388
GHS	k. A.	k. A.	5,89000
HKD	9,20953	k. A.	7,76585
HUF	351,03019	k. A.	296,00305
IDR	17.195,55857	k. A.	14.500,00000
ILS	3,86426	k. A.	3,25850
INR	88,14799	k. A.	74,33000
JPY (or ¥)	131,62311	153,32715	110,99000
KES	k. A.	k. A.	107,90000
KRW	1.335,50195	k. A.	1.126,15000
KZT	k. A.	k. A.	427,24500
MXN	23,61187	27,50536	19,91050
MYR	k. A.	k. A.	4,15150
NGN	k. A.	k. A.	410,00000
NOK	10,20491	11,88765	8,60520
NZD	1,69717	1,97703	1,43113
PEN	4,54496	k. A.	3,83250
PHP	k. A.	k. A.	48,81500
PLN	4,51472	k. A.	3,80700
RON	k. A.	k. A.	4,15255
RSD	k. A.	k. A.	99,17500
RUB	86,63449	k. A.	73,05375
SEK	10,14200	11,81437	8,55215
SGD	1,59409	1,85695	1,34420
THB	k. A.	k. A.	32,05000
TRY	10,30251	12,00135	8,68750
TWD	33,04216	k. A.	27,86250
UAH	k. A.	k. A.	27,27995
UGX	k. A.	k. A.	3.560,00000
USD (or \$)	1,18590	1,38145	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	43,49500
VND	k. A.	k. A.	23.016,00000
ZAR	16,93318	k. A.	14,27875
ZMW	k. A.	k. A.	22,63500

Fremd-währung	31. Dez. 2020 Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67315
ARS	172,88760	k. A.	141,30000
AUD	1,58563	1,77146	1,29592
BRL	6,35536	k. A.	5,19420
CAD	1,55880	1,74149	1,27400
CHF	1,08156	k. A.	0,88395
CLP	869,33221	k. A.	710,50000
CNH	7,94898	8,88059	6,49665
CNY	8,00177	k. A.	6,53980
COP	k. A.	k. A.	3.420,50000
CZK	26,26197	k. A.	21,46375
DKK	7,44347	8,31584	6,08350
DOP	k. A.	k. A.	58,14500
EGP	k. A.	k. A.	15,73000
EUR (or €)	1,00000	1,11720	0,81729
GBP (or £)	0,89510	1,00000	0,73156
GHS	k. A.	k. A.	5,86500
HKD	9,48722	k. A.	7,75385
HUF	362,68497	k. A.	296,42025
IDR	17.190,87623	19.205,63839	14.050,00000

Fremdwährung	31. Dez. 2020		
	Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
ILS	3,92857	k. A.	3,21080
INR	89,40173	k. A.	73,06750
JPY (or ¥)	126,32541	141,13069	103,24500
KES	k. A.	k. A.	109,20000
KRW	1.329,14227	k. A.	1.086,30000
KZT	k. A.	k. A.	421,14000
MXN	24,37984	27,23715	19,92550
MYR	k. A.	k. A.	4,02250
NGN	k. A.	k. A.	394,75000
NOK	10,47597	11,70375	8,56195
NZD	1,69938	1,89854	1,38889
PEN	4,42595	k. A.	3,61730
PHP	k. A.	k. A.	48,02350
PLN	4,55895	k. A.	3,72600
RON	k. A.	k. A.	3,97815
RSD	k. A.	k. A.	96,08000
RUB	90,49913	k. A.	73,96440
SEK	10,04846	11,22614	8,21255
SGD	1,61710	1,80663	1,32165
THB	k. A.	k. A.	29,96000
TRY	9,09403	10,15985	7,43250
TWD	34,37931	k. A.	28,09800
UAH	k. A.	k. A.	28,33500
USD (or \$)	1,22355	1,36695	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	42,47500
VND	k. A.	k. A.	23.082.50000
ZAR	17,97242	k. A.	14,68875

13. FINANZIELLE RISIKEN

Durch ihre Aktivitäten sind die Teilfonds verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt, z. B. dem Marktrisiko (einschließlich Preisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), dem Kreditrisiko und dem Liquiditätsrisiko. Der allgemeine Risikomanagementprozess für die Teilfonds konzentriert sich auf die Unvorhersehbarkeit der Finanzmärkte und versucht, potenziell nachteilige Effekte auf die finanzielle Entwicklung der Teilfonds 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. Dezember 2020 angegeben sind.

14. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN FÜR DIE IN HONGKONG VERTRIEBENEN FONDS

Als verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft werden diejenigen Personen verstanden, die im von der Securities and Futures Commission of Hong Kong herausgegebenen Code on Unit Trusts and Mutual Funds („SFC-Code“) definiert sind. Alle Transaktionen, die während des Berichtszeitraums zwischen den von der SFC zugelassenen Fonds („von der SFC zugelassene Fonds“), wie im Abschnitt über allgemeine Merkmale des Jahresberichts beschrieben, und der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und den Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft und ihren jeweiligen verbundenen Personen getätigt wurden, erfolgten im Rahmen des normalen Geschäftsverkehrs und zu üblichen Geschäftsbedingungen.

Die über einen Makler, der eine mit der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und den Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft verbundene Person ist, ausgeführten Transaktionen gestalteten sich für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2021 und 30. Juni 2020 wie folgt:

Fonds	30. Jun. 2021		30. Jun. 2020	
	Gesamtwert Käufe und Verkäufe ('000)	% von Gesamtwert Käufe und Verkäufe	Summe Käufe und Verkäufe ('000)	% von Gesamtwert Käufe und Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 429.899	4,14	\$ 404.543	20,13
Asia Strategic Interest Bond Fund	142.892	9,77	48.485	21,49

Fonds	30. Jun. 2021		30. Jun. 2020	
	Gesamtwert Käufe und Verkäufe ('000)	% von Gesamtwert Käufe und Verkäufe	Summe Käufe und Verkäufe ('000)	% von Gesamtwert Käufe und Verkäufe
Commodity Real Return Fund	370.838	2,30	279.634	2,39
Diversified Income Fund	6.447.302	2,68	10.985.599	2,24
Emerging Local Bond Fund	1.476.831	3,86	2.999.196	4,54
Emerging Markets Bond Fund	1.448.877	8,69	2.835.786	7,33
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	52.453	3,84	188.907	7,32
Global Bond Fund	5.879.245	2,24	10.644.419	3,46
Global High Yield Bond Fund	1.910.927	5,55	2.762.287	6,63
Global Investment Grade Credit Fund	10.347.102	4,87	12.622.457	4,49
Global Real Return Fund	3.280.330	4,26	2.111.988	4,66
Income Fund	32.362.843	3,69	47.488.880	4,52
Income Fund II	2.517	0,47	k. A.	k. A.
Low Average Duration Fund	59.789	0,46	663.041	3,45
Total Return Bond Fund	888.078	1,27	2.224.767	2,24
US High Yield Bond Fund	370.385	2,57	1.205.461	6,18

Für die in der obigen Tabelle aufgeführten Transaktionen wurden in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2021 und zum 30. Juni 2020 keine Provisionen erhoben.

Nähere Einzelheiten zu den von den Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft gehaltenen Anteilen an von der SFC zugelassenen Teilfonds für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021 und das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 sind in Erläuterung 10 aufgeführt. Nähere Einzelheiten zu den an die Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft gezahlten Honoraren für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2021 und 30. Juni 2020 sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

Nähere Einzelheiten zum Wert der umlaufenden Anteile, die zum 30. Juni 2021 und zum 31. Dezember 2020 von verbundenen Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften gehalten werden und 20 % des Nettovermögens der von der SFC zugelassenen Teilfonds übersteigen, sind in Erläuterung 10 aufgeführt. Nähere Einzelheiten zu den an die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften gezahlten Honorare sind in Erläuterung 9 sowie in der Betriebsergebnisrechnung aufgeführt.

Die Verwaltungsratsmitglieder und leitenden Angestellten der Verwahrstelle haben in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2021 und 30. Juni 2020 keine Anteile an den von der SFC zugelassenen Teilfonds gehalten. Wie in Anmerkung 9 dargelegt, werden die Honorare und Aufwendungen der Verwahrstelle von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr oder von den Anlageberatungsgesellschaften bezahlt. Alle Bankguthaben der von der SFC zugelassenen Teilfonds werden entweder von State Street Bank and Trust Co. als Beauftragte der Verwahrstelle oder direkt bei einer Unterverwahrstelle gehalten. Auf diese Bankguthaben darf die Verwahrstelle Zinsen erwirtschaften bzw. den von der SFC zugelassenen Teilfonds in Rechnung stellen.

15. GRUNDKAPITAL
(a) Genehmigte Anteile

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft beträgt €38.092 und ist in 30.000 Zeichneranteile zu je €1,27 und 500.000.000.000 Aktien ohne Nennwert aufgeteilt, die ursprünglich als „nicht klassifizierte Anteile“ bezeichnet wurden.

(b) Zeichneranteile

Bis auf sieben sind die ursprünglichen 30.000 Zeichneranteile zurückgenommen worden. Die Zeichneranteile sind nicht Bestandteil des NIW der Gesellschaft und werden daher im Abschluss nur in Form dieser Erläuterung erwähnt. Nach Ansicht des Verwaltungsrates geben diese Offenlegungen die Art des Geschäftes der Gesellschaft als Investmentfonds wieder.

(c) Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile

Das ausgegebene gewinnberechtigte Grundkapital entspricht jederzeit dem NIW der Teilfonds. Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile werden auf Antrag des Anteilinhabers zurückgenommen und sind als Finanzverbindlichkeiten klassifiziert.

16. NETTOINVENTARWERTE

Im Folgenden sind das rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhabern zuzuschreibende Nettovermögen der einzelnen Teilfonds, die ausgegebenen und umlaufenden Anteile und der NIW je Anteil der vergangenen drei Jahre (Angaben in Tausend, ausgenommen Beträge je Anteil) aufgeführt. Der in diesem Abschluss ausgewiesene NIW je Anteil kann

Anpassungen gemäß FRS 102 enthalten, was dazu führen kann, dass der NIW oder die Gesamterträge der Anteilinhaber von den in diesem Abschluss ausgewiesenen Werten abweichen. Das Nettovermögen geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen und umlaufenden Anteile kann vom NIW aufgrund gerundeter Werte abweichen:

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
PIMCO Asia High Yield Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 2.079.225	\$ 890.928	\$ 226.380
Institutional:			
thesaurierend	\$ 687.687	\$ 265.889	\$ 33.585
ausgegeben und umlaufende Anteile	58.986	23.044	3.061
NIW je Anteil	\$ 11,66	\$ 11,54	\$ 10,97
Erträge	\$ 128.746	\$ 43.289	\$ 9.285
ausgegeben und umlaufende Anteile	12.593	4.163	888
NIW je Anteil	\$ 10,22	\$ 10,40	\$ 10,46
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 37.397	CHF 6.108	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	3.569	586	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,48	CHF 10,43	k. A.
Erträge	CHF 5.761	CHF 860	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	571	83	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,10	CHF 10,32	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 149.566	€ 38.336	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	14.205	3.662	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,53	€ 10,47	k. A.
Erträge	€ 67.617	€ 11.559	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	6.689	1.120	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,11	€ 10,32	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	£ 208	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	21	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,83	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 1.311	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	133	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,88	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 267.489	\$ 66.319	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	26.692	6.506	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,02	\$ 10,19	k. A.
Investor AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 5.197	AUD 366	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	512	35	k. A.
NIW je Anteil	AUD 10,15	AUD 10,34	k. A.
Investor EUR (Hedged):			
Erträge	€ 724	€ 226	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	73	22	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,90	€ 10,11	k. A.
Investor RMB (Hedged):			
Erträge	CNH 28.299	CNH 8.387	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	275	81	k. A.
NIW je Anteil	CNH 103,09	CNH 103,59	k. A.
Investor SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 7.799	SGD 1.175	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	778	115	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,02	SGD 10,19	k. A.
Administrative:			
Erträge	\$ 67.591	\$ 18.459	\$ 5.984
ausgegeben und umlaufende Anteile	6.612	1.775	572
NIW je Anteil	\$ 10,22	\$ 10,40	\$ 10,46
Class E:			
thesaurierend	\$ 59.194	\$ 6.725	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	5.457	624	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,85	\$ 10,79	k. A.

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)			
Erträge	\$ 77.955	\$ 25.374	\$ 15.353
ausgegeben und umlaufende Anteile	7.624	2.440	1.468
NIW je Anteil	\$ 10,22	\$ 10,40	\$ 10,46
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 622	CHF 89	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	60	9	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,42	CHF 10,41	k. A.
Erträge	CHF 276	CHF 31	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	27	3	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,10	CHF 10,33	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 57.069	€ 20.246	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	5.453	1.938	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,47	€ 10,45	k. A.
Erträge	€ 7.448	€ 1.020	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	737	99	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,11	€ 10,32	k. A.
Class E HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 39.637	HKD 2.458	HKD 2.041
ausgegeben und umlaufende Anteile	3.916	239	197
NIW je Anteil	HKD 10,12	HKD 10,28	HKD 10,38
Class E SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 24.772	SGD 12.464	SGD 5.908
ausgegeben und umlaufende Anteile	2.447	1.211	568
NIW je Anteil	SGD 10,12	SGD 10,29	SGD 10,41
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 129	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	13	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,10	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 7.731	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	777	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,95	k. A.	k. A.
M Retail:			
ausschüttend II	\$ 14.396	\$ 12.308	\$ 4.931
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.461	1.219	478
NIW je Anteil	\$ 9,85	\$ 10,10	\$ 10,32
M Retail HKD (Unhedged):			
ausschüttend II	HKD 3.769	HKD 1.567	HKD 85
ausgegeben und umlaufende Anteile	386	157	8
NIW je Anteil	HKD 9,76	HKD 9,98	HKD 10,24
M Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 12.406	SGD 7.080	SGD 3.242
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.272	708	316
NIW je Anteil	SGD 9,76	SGD 10,00	SGD 10,27
Class Z:			
thesaurierend	\$ 336.789	\$ 339.431	\$ 150.164
ausgegeben und umlaufende Anteile	28.428	29.046	13.605
NIW je Anteil	\$ 11,85	\$ 11,69	\$ 11,04
Asia Strategic Interest Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 309.642	\$ 167.716	\$ 38.513
Institutional:			
Erträge	\$ 17.565	\$ 3.652	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.763	362	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,96	\$ 10,10	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
Erträge	€ 95.875	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	9.619	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,97	k. A.	k. A.
Institutional SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 5.703	SGD 4.213	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	566	412	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,08	SGD 10,22	k. A.

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)			
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 504.649	€ 465.125	€ 539.104
ausgegebene und umlaufende Anteile	36.735	34.965	41.792
NIW je Anteil	€ 13,74	€ 13,30	€ 12,90
Erträge	€ 63.554	€ 62.905	€ 93.156
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.078	6.146	9.139
NIW je Anteil	€ 10,46	€ 10,23	€ 10,19
M Retail:			
ausschüttend II	\$ 264.799	\$ 218.504	\$ 265.793
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.755	20.788	25.482
NIW je Anteil	\$ 10,70	\$ 10,51	\$ 10,43
M Retail HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 23.865	HKD 23.223	HKD 33.662
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.148	2.148	3.176
NIW je Anteil	HKD 11,11	HKD 10,81	HKD 10,60
M Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 114.896	SGD 67.688	SGD 45.242
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.894	6.533	4.363
NIW je Anteil	SGD 10,55	SGD 10,36	SGD 10,37
Class R:			
Erträge	\$ 5.636	\$ 5.913	\$ 12.788
ausgegebene und umlaufende Anteile	477	514	1.138
NIW je Anteil	\$ 11,81	\$ 11,51	\$ 11,23
Class R EUR (Hedged):			
Erträge	€ 11.803	€ 9.666	€ 19.311
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.159	970	1.945
NIW je Anteil	€ 10,18	€ 9,97	€ 9,93
Class R GBP (Hedged):			
Erträge	£ 6.097	£ 6.265	£ 5.847
ausgegebene und umlaufende Anteile	572	603	564
NIW je Anteil	£ 10,65	£ 10,39	£ 10,37
Class T:			
Erträge	\$ 11.486	\$ 10.970	\$ 9.323
ausgegebene und umlaufende Anteile	953	933	813
NIW je Anteil	\$ 12,06	\$ 11,75	\$ 11,47
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 78.350	€ 68.823	€ 84.433
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.266	5.673	7.148
NIW je Anteil	€ 12,50	€ 12,13	€ 11,81
Class Z:			
Erträge	\$ 94.249	\$ 71.902	\$ 108.140
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.294	5.708	8.798
NIW je Anteil	\$ 12,92	\$ 12,60	\$ 12,29
Class Z AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 135.865	AUD 125.272	AUD 119.450
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.838	11.181	10.683
NIW je Anteil	AUD 11,48	AUD 11,20	AUD 11,18
PIMCO Climate Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 260.205	\$ 101.869	k. A.
Institutional:			
thesaurierend	\$ 10.044	\$ 4.565	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	990	449	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,15	\$ 10,17	k. A.
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 1.015	CHF 231	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	102	23	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,00	CHF 10,06	k. A.

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)			
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 81.838	€ 16.688	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.119	1.646	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,08	€ 10,14	k. A.
Erträge	€ 95.079	€ 60.190	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.542	5.992	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,96	€ 10,05	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 15.218	£ 1.717	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.502	169	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,13	£ 10,15	k. A.
Erträge	£ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,07	k. A.	k. A.
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 2.045	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	202	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,11	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,05	k. A.	k. A.
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,02	k. A.	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 14.060	€ 507	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.405	50	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,01	€ 10,11	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	\$ 10	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,19	\$ 10,18	k. A.
Commodity Real Return Fund			
Nettovermögen	\$ 1.143.670	\$ 325.109	\$ 564.401
Institutional:			
thesaurierend	\$ 484.559	\$ 162.906	\$ 433.520
ausgegebene und umlaufende Anteile	59.379	24.677	67.027
NIW je Anteil	\$ 8,16	\$ 6,60	\$ 6,47
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 127.779	€ 31.294	€ 1.232
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.690	4.723	185
NIW je Anteil	€ 8,14	€ 6,63	€ 6,65
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 33.844	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.333	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,16	k. A.	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 18.229	£ 14.663	£ 14.684
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.613	1.597	1.589
NIW je Anteil	£ 11,30	£ 9,18	£ 9,24
Investor:			
thesaurierend	\$ 53.585	\$ 10.609	\$ 12.224
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.574	1.851	2.170
NIW je Anteil	\$ 7,07	\$ 5,73	\$ 5,63
Class E:			
thesaurierend	\$ 202.064	\$ 66.707	\$ 70.711
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.544	12.411	13.311
NIW je Anteil	\$ 6,62	\$ 5,37	\$ 5,31

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Commodity Real Return Fund (Forts.)			
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 1.785
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	483
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 3,69
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 157.357	€ 21.703	€ 22.498
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.907	4.204	4.302
NIW je Anteil	€ 6,32	€ 5,16	€ 5,23
G Institutional EUR (Hedged): Erträge	k. A.	k. A.	€ 63
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	7
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,23
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 145.676	\$ 144.512	\$ 149.347
Institutional:			
thesaurierend	\$ 46.912	\$ 46.003	\$ 47.768
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.307	3.308	3.546
NIW je Anteil	\$ 14,19	\$ 13,91	\$ 13,47
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 22.790	CHF 22.715	CHF 22.653
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.060	2.084	2.107
NIW je Anteil	CHF 11,06	CHF 10,90	CHF 10,75
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 41.661	€ 41.292	€ 32.570
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.296	3.320	2.662
NIW je Anteil	€ 12,64	€ 12,44	€ 12,23
ausschüttend II	k. A.	k. A.	€ 651
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	78
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 8,32
Class E:			
thesaurierend	\$ 9.773	\$ 8.496	\$ 14.637
ausgegebene und umlaufende Anteile	823	726	1.281
NIW je Anteil	\$ 11,88	\$ 11,70	\$ 11,43
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 12.590	€ 11.273	€ 22.358
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.187	1.075	2.150
NIW je Anteil	€ 10,60	€ 10,48	€ 10,40
Class T EUR (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 1.034
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	103
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 10,05
Diversified Income Fund			
Nettovermögen	\$ 18.658.818	\$ 18.641.861	\$ 12.274.587
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.275.830	\$ 1.066.263	\$ 851.517
ausgegebene und umlaufende Anteile	45.228	37.907	32.654
NIW je Anteil	\$ 28,21	\$ 28,13	\$ 26,08
Erträge	\$ 774.445	\$ 830.361	\$ 427.605
ausgegebene und umlaufende Anteile	48.437	51.315	27.576
NIW je Anteil	\$ 15,99	\$ 16,18	\$ 15,51

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Diversified Income Fund (Forts.)			
Institutional CAD (Hedged): thesaurierend	CAD 472.599	CAD 423.593	CAD 60.544
ausgegebene und umlaufende Anteile	40.245	36.151	5.531
NIW je Anteil	CAD 11,74	CAD 11,72	CAD 10,95
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 21.085	CHF 19.775	CHF 18.520
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.413	1.322	1.306
NIW je Anteil	CHF 14,93	CHF 14,96	CHF 14,18
Erträge	CHF 14.751	CHF 19.392	CHF 6.867
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.560	2.014	728
NIW je Anteil	CHF 9,46	CHF 9,63	CHF 9,43
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 1.610.592	€ 1.697.782	€ 1.036.450
ausgegebene und umlaufende Anteile	85.279	89.784	57.956
NIW je Anteil	€ 18,89	€ 18,91	€ 17,88
Erträge	€ 968.877	€ 933.208	€ 977.714
ausgegebene und umlaufende Anteile	95.823	90.802	97.353
NIW je Anteil	€ 10,11	€ 10,28	€ 10,04
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 1.564.978	£ 1.623.041	£ 1.006.549
ausgegebene und umlaufende Anteile	101.407	105.382	69.297
NIW je Anteil	£ 15,43	£ 15,40	£ 14,53
Erträge	£ 1.157.367	£ 1.020.119	£ 734.099
ausgegebene und umlaufende Anteile	153.690	133.743	98.669
NIW je Anteil	£ 7,53	£ 7,63	£ 7,44
Institutional MXN (Hedged): thesaurierend	MXN 5.513	MXN 5.392	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	53	53	k. A.
NIW je Anteil	MXN 103,39	MXN 101,13	k. A.
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 261.823	SEK 258.455	SEK 244.650
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.342	1.325	1.326
NIW je Anteil	SEK 195,11	SEK 195,03	SEK 184,53
Institutional SGD (Hedged): Erträge	SGD 75.168	SGD 30.850	SGD 8.671
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.265	2.946	858
NIW je Anteil	SGD 10,35	SGD 10,47	SGD 10,11
Investor:			
thesaurierend	\$ 86.296	\$ 63.761	\$ 38.078
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.003	4.440	2.850
NIW je Anteil	\$ 14,38	\$ 14,36	\$ 13,36
Erträge	\$ 68.664	\$ 43.507	\$ 18.863
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.366	3.986	1.803
NIW je Anteil	\$ 10,79	\$ 10,92	\$ 10,46
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 32.286	€ 29.190	€ 19.960
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.795	1.618	1.166
NIW je Anteil	€ 17,98	€ 18,04	€ 17,12

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Diversified Income Fund (Forts.)		
Erträge	€ 12.229	€ 8.787	€ 4.207
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.281	905	444
NIW je Anteil	€ 9,55	€ 9,70	€ 9,48
Administrative:			
Erträge	\$ 143.865	\$ 144.682	\$ 69.700
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.198	12.123	6.094
NIW je Anteil	\$ 11,79	\$ 11,94	\$ 11,44
Administrative AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 3.719	AUD 4.404	AUD 25
ausgegebene und umlaufende Anteile	354	413	2
NIW je Anteil	AUD 10,51	AUD 10,65	AUD 10,37
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 10.968	€ 12.496	€ 7.653
ausgegebene und umlaufende Anteile	623	707	456
NIW je Anteil	€ 17,61	€ 17,67	€ 16,80
Administrative GBP (Hedged):			
Erträge	£ 12.213	£ 11.699	£ 3.930
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.108	1.048	361
NIW je Anteil	£ 11,02	£ 11,17	£ 10,89
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 85	SEK 85	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	SEK 99,84	SEK 100,08	k. A.
Administrative SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 112.234	SGD 136.614	SGD 41.088
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.551	12.691	3.956
NIW je Anteil	SGD 10,64	SGD 10,76	SGD 10,39
Class E:			
thesaurierend	\$ 1.268.743	\$ 1.457.105	\$ 797.573
ausgegebene und umlaufende Anteile	51.516	59.069	34.563
NIW je Anteil	\$ 24,63	\$ 24,67	\$ 23,08
Erträge	\$ 731.214	\$ 808.596	\$ 625.102
ausgegebene und umlaufende Anteile	51.232	55.978	45.166
NIW je Anteil	\$ 14,27	\$ 14,44	\$ 13,84
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 9.777	CHF 7.607	CHF 1.794
ausgegebene und umlaufende Anteile	933	721	178
NIW je Anteil	CHF 10,48	CHF 10,55	CHF 10,09
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.947.168	€ 1.798.793	€ 1.261.962
ausgegebene und umlaufende Anteile	116.113	106.656	78.408
NIW je Anteil	€ 16,77	€ 16,87	€ 16,09
Erträge	€ 1.537.728	€ 1.638.721	€ 1.450.954
ausgegebene und umlaufende Anteile	133.452	139.927	126.777
NIW je Anteil	€ 11,52	€ 11,71	€ 11,44
Class E SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 75.468	SGD 83.189	SGD 10.279
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.323	7.977	1.022
NIW je Anteil	SGD 10,31	SGD 10,43	SGD 10,06

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Diversified Income Fund (Forts.)		
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.389.998	\$ 1.307.826	\$ 985.251
ausgegebene und umlaufende Anteile	65.148	61.420	49.824
NIW je Anteil	\$ 21,34	\$ 21,29	\$ 19,77
Erträge	\$ 27	\$ 27	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2	2	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,91	\$ 11,04	k. A.
M Retail:			
Erträge	\$ 295.621	\$ 348.905	\$ 341.328
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.224	28.250	28.851
NIW je Anteil	\$ 12,20	\$ 12,35	\$ 11,83
ausschüttend II	\$ 386.442	\$ 452.614	\$ 168.224
ausgegebene und umlaufende Anteile	38.504	44.209	16.884
NIW je Anteil	\$ 10,04	\$ 10,24	\$ 9,96
M Retail AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 108.934	AUD 148.786	AUD 65.064
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.537	12.851	5.776
NIW je Anteil	AUD 11,42	AUD 11,58	AUD 11,27
M Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 14	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,08	k. A.	k. A.
N Retail:			
ausschüttend II	\$ 10	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,46	\$ 10,48	k. A.
Class T:			
thesaurierend	\$ 43.677	\$ 31.960	\$ 17.487
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.267	2.382	1.388
NIW je Anteil	\$ 13,37	\$ 13,42	\$ 12,60
Erträge	\$ 9.352	\$ 9.265	\$ 3.687
ausgegebene und umlaufende Anteile	834	817	339
NIW je Anteil	\$ 11,21	\$ 11,34	\$ 10,87
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 57.240	€ 56.537	€ 41.256
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.848	4.752	3.619
NIW je Anteil	€ 11,81	€ 11,90	€ 11,40
Erträge	€ 31.350	€ 35.099	€ 35.250
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.177	3.500	3.597
NIW je Anteil	€ 9,87	€ 10,03	€ 9,80
Class W:			
thesaurierend	\$ 121.419	\$ 46.301	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.634	4.453	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,44	\$ 10,40	k. A.
Erträge	\$ 121.933	\$ 36.531	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.011	3.555	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,15	\$ 10,28	k. A.

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019		
	Diversified Income Fund (Forts.)					
Class W CAD (Hedged):						
thesaurierend	CAD	14	CAD	14	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1	k. A.	
NIW je Anteil	CAD	10,42	CAD	10,39	k. A.	
Class W CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	15.042	CHF	12.711	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.456		1.229	k. A.	
NIW je Anteil	CHF	10,33	CHF	10,35	k. A.	
Erträge	CHF	10	CHF	10	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1	k. A.	
NIW je Anteil	CHF	10,05	CHF	10,23	k. A.	
Class W EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	15.582	€	10.643	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.506		1.028	k. A.	
NIW je Anteil	€	10,35	€	10,35	k. A.	
Erträge	€	8.353	€	7.733	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		830		756	k. A.	
NIW je Anteil	€	10,07	€	10,23	k. A.	
Class W GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	3.355	£	420	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		322		40	k. A.	
NIW je Anteil	£	10,41	£	10,38	k. A.	
Erträge	£	3.541	£	767	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		350		75	k. A.	
NIW je Anteil	£	10,13	£	10,26	k. A.	
Class W SGD (Hedged):						
Erträge	SGD	6.440	SGD	3.397	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		634		330	k. A.	
NIW je Anteil	SGD	10,16	SGD	10,28	k. A.	
	Diversified Income Duration Hedged Fund					
Nettovermögen	\$	1.661.708	\$	1.486.931	\$	1.269.937
Institutional:						
thesaurierend	\$	73.333	\$	30.325	\$	85.231
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.893		2.073		5.857
NIW je Anteil	\$	14,99	\$	14,63	\$	14,55
Erträge	\$	2.214	\$	2.258	\$	3.004
ausgegebene und umlaufende Anteile		206		212		274
NIW je Anteil	\$	10,77	\$	10,65	\$	10,95
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	158.408	€	96.172	€	90.249
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.650		7.219		6.677
NIW je Anteil	€	13,60	€	13,32	€	13,52
ausschüttend II	€	39.858	€	41.836	€	55.604
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.792		5.045		6.356
NIW je Anteil	€	8,32	€	8,29	€	8,75
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	467.709	£	443.936	£	423.773
ausgegebene und umlaufende Anteile		31.960		31.048		29.261
NIW je Anteil	£	14,63	£	14,30	£	14,48

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019		
	Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)					
Erträge	£	240.118	£	238.667	£	52.230
ausgegebene und umlaufende Anteile		26.581		26.610		5.562
NIW je Anteil	£	9,03	£	8,97	£	9,39
Investor:						
thesaurierend	\$	16.585	\$	10.807	\$	6.972
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.321		880		569
NIW je Anteil	\$	12,56	\$	12,28	\$	12,25
Erträge		k. A.		k. A.		\$ 247
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		25
NIW je Anteil		k. A.		k. A.		\$ 9,98
Class E:						
thesaurierend	\$	47.411	\$	38.133	\$	32.527
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.833		3.145		2.672
NIW je Anteil	\$	12,37	\$	12,13	\$	12,17
Erträge	\$	21.167	\$	28.229	\$	38.998
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.066		2.785		3.744
NIW je Anteil	\$	10,24	\$	10,13	\$	10,41
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	208.646	€	185.348	€	216.296
ausgegebene und umlaufende Anteile		16.549		14.936		17.026
NIW je Anteil	€	12,61	€	12,41	€	12,70
Erträge	€	34.247	€	39.600	€	56.500
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.020		4.678		6.371
NIW je Anteil	€	8,52	€	8,46	€	8,87
Class T:						
thesaurierend		k. A.		k. A.	\$	2.440
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		207
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	\$	11,78
	Dynamic Bond Fund					
Nettovermögen	\$	3.780.805	\$	3.204.860	\$	3.888.271
Institutional:						
thesaurierend	\$	597.240	\$	533.694	\$	965.957
ausgegebene und umlaufende Anteile		40.169		36.253		69.318
NIW je Anteil	\$	14,87	\$	14,72	\$	13,94
Erträge	\$	110.782	\$	50.835	\$	66.545
ausgegebene und umlaufende Anteile		9.649		4.429		5.978
NIW je Anteil	\$	11,48	\$	11,48	\$	11,13
Institutional CAD (Hedged):						
thesaurierend	CAD	17.076	CAD	17.931	CAD	19.688
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.543		1.635		1.890
NIW je Anteil	CAD	11,07	CAD	10,96	CAD	10,42
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	83.272	CHF	71.980	CHF	70.591
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.423		6.448		6.567
NIW je Anteil	CHF	11,22	CHF	11,16	CHF	10,75
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	574.268	€	467.029	€	714.856
ausgegebene und umlaufende Anteile		43.114		35.268		56.192
NIW je Anteil	€	13,32	€	13,24	€	12,72

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Dynamic Bond Fund (Forts.)		
Erträge	€ 12.486	€ 10.018	€ 20.627
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.219	974	2.038
NIW je Anteil	€ 10,25	€ 10,29	€ 10,12
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 978.879	£ 827.076	£ 815.222
ausgegebene und umlaufende Anteile	73.463	62.634	64.656
NIW je Anteil	£ 13,32	£ 13,20	£ 12,61
Erträge	£ 235.826	£ 242.182	£ 225.002
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.877	24.507	23.216
NIW je Anteil	£ 9,88	£ 9,88	£ 9,69
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend	NOK 138.340	NOK 137.483	NOK 130.919
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.394	10.428	10.391
NIW je Anteil	NOK 13,31	NOK 13,18	NOK 12,60
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 518.312	SEK 502.097	SEK 501.616
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.876	4.761	4.963
NIW je Anteil	SEK 106,30	SEK 105,47	SEK 101,07
Investor: thesaurierend	\$ 55.759	\$ 52.628	\$ 68.930
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.413	4.199	5.790
NIW je Anteil	\$ 12,64	\$ 12,53	\$ 11,90
Erträge	\$ 4.882	\$ 2.996	\$ 4.308
ausgegebene und umlaufende Anteile	475	292	433
NIW je Anteil	\$ 10,27	\$ 10,27	\$ 9,96
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 7.579	€ 3.373	€ 1.412
ausgegebene und umlaufende Anteile	666	298	129
NIW je Anteil	€ 11,39	€ 11,34	€ 10,93
Administrative: thesaurierend	\$ 33.553	\$ 31.246	\$ 28.795
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.390	2.242	2.172
NIW je Anteil	\$ 14,04	\$ 13,93	\$ 13,26
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend	€ 5.219	€ 4.758	€ 10.558
ausgegebene und umlaufende Anteile	415	379	872
NIW je Anteil	€ 12,58	€ 12,54	€ 12,11
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 90.598	SEK 96.229	SEK 108.853
ausgegebene und umlaufende Anteile	785	838	985
NIW je Anteil	SEK 115,39	SEK 114,77	SEK 110,53
Class E: thesaurierend	\$ 86.207	\$ 74.125	\$ 93.374
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.047	6.092	8.035
NIW je Anteil	\$ 12,23	\$ 12,17	\$ 11,62
Erträge	\$ 21.872	\$ 19.575	\$ 27.944
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.084	1.866	2.747
NIW je Anteil	\$ 10,49	\$ 10,49	\$ 10,17
Class E CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 10.952	CHF 11.815	CHF 14.082
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.078	1.164	1.427
NIW je Anteil	CHF 10,16	CHF 10,15	CHF 9,87
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 174.188	€ 104.878	€ 142.298
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.508	8.748	12.244
NIW je Anteil	€ 12,01	€ 11,99	€ 11,62
Class E GBP (Hedged): thesaurierend	£ 4.141	£ 3.947	£ 3.304
ausgegebene und umlaufende Anteile	351	336	292
NIW je Anteil	£ 11,81	£ 11,76	£ 11,33

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Dynamic Bond Fund (Forts.)		
G Retail EUR (Hedged): Erträge	€ 10.158	€ 10.799	€ 25.618
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.102	1.174	2.834
NIW je Anteil	€ 9,21	€ 9,20	€ 9,04
H Institutional: thesaurierend	\$ 18.934	\$ 4.868	\$ 1.225
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.695	440	117
NIW je Anteil	\$ 11,17	\$ 11,07	\$ 10,49
Erträge	\$ 11	\$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,32	\$ 10,32	k. A.
Class R: thesaurierend	\$ 8.160	\$ 8.296	\$ 8.944
ausgegebene und umlaufende Anteile	672	689	784
NIW je Anteil	\$ 12,15	\$ 12,03	\$ 11,40
Class Z AUD (Hedged): Erträge	AUD 35.967	AUD 34.486	AUD 42.104
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.420	3.276	4.094
NIW je Anteil	AUD 10,52	AUD 10,53	AUD 10,29
	Dynamic Multi-Asset Fund		
Nettvermögen	€ 7.433.280	€ 5.128.926	€ 1.604.773
Institutional: thesaurierend	€ 2.693.651	€ 2.129.409	€ 540.866
ausgegebene und umlaufende Anteile	190.664	153.874	46.023
NIW je Anteil	€ 14,13	€ 13,84	€ 11,75
ausschüttend II	€ 257.207	€ 251.480	€ 33.517
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.161	18.963	2.922
NIW je Anteil	€ 13,42	€ 13,26	€ 11,47
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 6.092	CHF 4.488	CHF 1.538
ausgegebene und umlaufende Anteile	496	373	150
NIW je Anteil	CHF 12,28	CHF 12,04	CHF 10,26
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 295.011	£ 216.239	£ 174.768
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.042	15.034	14.320
NIW je Anteil	£ 14,72	£ 14,38	£ 12,20
Erträge	£ 812	£ 610	£ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	63	48	1
NIW je Anteil	£ 12,98	£ 12,68	£ 10,78
Institutional USD (Hedged): thesaurierend	\$ 326.507	\$ 175.228	\$ 35.734
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.712	11.398	2.777
NIW je Anteil	\$ 15,76	\$ 15,37	\$ 12,87
ausschüttend II	\$ 5.185	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	506	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,25	k. A.	k. A.
Investor: thesaurierend	€ 9.695	€ 6.410	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	874	589	k. A.
NIW je Anteil	€ 11,09	€ 10,88	k. A.

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2019	
	Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)					
Investor USD (Hedged):						
thesaurierend	\$ 10		k. A.			k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,36			k. A.		k. A.
Class E:						
thesaurierend	€ 3.168.429	€ 1.985.483	€ 724.815			
ausgegebene und umlaufende Anteile		237.060		150.907		64.231
NIW je Anteil	€ 13,37	€ 13,16	€ 11,28			
Erträge		k. A.		k. A.		€ 1.372
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		137
NIW je Anteil		k. A.		k. A.		€ 10,01
Erträge	€ 5.826	€ 1.063				k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		524		97		k. A.
NIW je Anteil	€ 11,11	€ 10,94				k. A.
Class E USD (Hedged):						
thesaurierend	\$ 285.933	\$ 129.718	\$ 2.457			
ausgegebene und umlaufende Anteile		21.162		9.795		219
NIW je Anteil	\$ 13,51	\$ 13,24	\$ 11,20			
Erträge	\$ 10			k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,35			k. A.		k. A.
H Institutional USD (Hedged):						
thesaurierend	\$ 13.379	\$ 70.265				k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.208		6.498		k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,07	\$ 10,81				k. A.
M Retail AUD (Hedged):						
ausschüttend II	AUD 338			k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		33		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	AUD 10,23			k. A.		k. A.
M Retail SGD (Hedged):						
ausschüttend II	SGD 1.729	SGD 346				k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		168		34		k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,26	SGD 10,16				k. A.
M Retail USD (Hedged):						
ausschüttend II	\$ 166.916	\$ 84.157				k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		14.766		7.457		k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,30	\$ 11,29				k. A.
Class T:						
thesaurierend	€ 120.580	€ 56.375	€ 9.854			
ausgegebene und umlaufende Anteile		9.716		4.605		935
NIW je Anteil	€ 12,41	€ 12,24	€ 10,54			
Class Z:						
thesaurierend	€ 153.578	€ 76.639	€ 52.645			
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.224		6.254		5.101
NIW je Anteil	€ 12,56	€ 12,25	€ 10,32			
	Emerging Local Bond Fund					
Nettovermögen	\$ 2.768.335	\$ 2.849.284	\$ 2.772.000			
Institutional:						
thesaurierend	\$ 1.937.527	\$ 1.942.594	\$ 1.342.180			
ausgegebene und umlaufende Anteile		136.801		132.226		94.430
NIW je Anteil	\$ 14,16	\$ 14,69	\$ 14,21			

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2019	
	Emerging Local Bond Fund (Forts.)					
Erträge	\$ 89.202	\$ 94.610	\$ 89.420			
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.121		12.100		11.198
NIW je Anteil	\$ 7,36	\$ 7,82	\$ 7,99			
Institutional CHF (Unhedged):						
thesaurierend	CHF 422	CHF 491	CHF 560			
ausgegebene und umlaufende Anteile		44		51		55
NIW je Anteil	CHF 9,64	CHF 9,56	CHF 10,14			
Institutional EUR (Unhedged):						
thesaurierend	€ 150.958	€ 165.027	€ 138.760			
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.458		12.458		9.934
NIW je Anteil	€ 13,18	€ 13,25	€ 13,97			
Erträge	€ 267.429	€ 288.525	€ 722.464			
ausgegebene und umlaufende Anteile		37.390		39.179		88.124
NIW je Anteil	€ 7,15	€ 7,36	€ 8,20			
Institutional GBP (Unhedged):						
thesaurierend	£ 2.630	£ 2.910	£ 82.731			
ausgegebene und umlaufende Anteile		130		137		3.904
NIW je Anteil	£ 20,25	£ 21,23	£ 21,19			
Investor:						
thesaurierend	\$ 30.510	\$ 24.099	\$ 20.968			
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.842		2.159		1.936
NIW je Anteil	\$ 10,74	\$ 11,16	\$ 10,83			
Investor CHF (Unhedged):						
thesaurierend		k. A.		k. A.		CHF 1.340
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		121
NIW je Anteil		k. A.		k. A.		CHF 11,04
Investor EUR (Unhedged):						
thesaurierend		k. A.		k. A.		€ 4.266
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		328
NIW je Anteil		k. A.		k. A.		€ 13,01
thesaurierend	€ 3.072	€ 3.074	€ 633			
ausgegebene und umlaufende Anteile		327		325		63
NIW je Anteil	€ 9,40	€ 9,47	€ 10,02			
Class E:						
thesaurierend	\$ 45.855	\$ 53.089	\$ 53.381			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.666		4.070		4.189
NIW je Anteil	\$ 12,51	\$ 13,04	\$ 12,74			
Erträge	\$ 19.194	\$ 22.053	\$ 23.295			
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.785		3.012		3.116
NIW je Anteil	\$ 6,89	\$ 7,32	\$ 7,48			
Class E EUR (Unhedged):						
thesaurierend	€ 91.497	€ 102.405	€ 120.481			
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.296		6.974		7.704
NIW je Anteil	€ 14,53	€ 14,68	€ 15,64			
Erträge	€ 1.867	€ 2.018	€ 2.493			
ausgegebene und umlaufende Anteile		192		202		224
NIW je Anteil	€ 9,71	€ 10,00	€ 11,12			
H Institutional:						
thesaurierend	\$ 10			k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,99			k. A.		k. A.

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021		31. Dez. 2020		31. Dez. 2019	
Emerging Local Bond Fund (Forts.)						
Class Z:						
Erträge	\$	31.417	\$	21.833	\$	20.934
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.564		2.331		2.188
NIW je Anteil	\$	8,82	\$	9,37	\$	9,57
Emerging Markets Bond Fund						
Nettovermögen	\$	5.166.510	\$	5.263.015	\$	4.001.722
Institutional:						
thesaurierend	\$	1.718.850	\$	1.855.635	\$	799.018
ausgegebene und umlaufende Anteile		31.053		33.297		15.372
NIW je Anteil	\$	55,35	\$	55,73	\$	51,98
Erträge	\$	80.342	\$	79.496	\$	58.672
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.140		3.984		3.023
NIW je Anteil	\$	19,41	\$	19,95	\$	19,41
Institutional CHF (Hedged):						
Erträge	CHF	100.199	CHF	101.703	CHF	81.805
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.116		5.020		4.052
NIW je Anteil	CHF	19,58	CHF	20,26	CHF	20,19
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	708.516	€	727.017	€	686.888
ausgegebene und umlaufende Anteile		15.864		16.095		15.946
NIW je Anteil	€	44,66	€	45,17	€	43,07
Erträge	€	870.224	€	768.610	€	1.189.920
ausgegebene und umlaufende Anteile		94.033		80.394		125.183
NIW je Anteil	€	9,25	€	9,56	€	9,51
Institutional EUR (Unhedged):						
thesaurierend	€	166.485	€	156.149	€	159.929
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.418		12.896		12.993
NIW je Anteil	€	12,41	€	12,11	€	12,31
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	17.374	£	13.006	£	23.908
ausgegebene und umlaufende Anteile		595		442		855
NIW je Anteil	£	29,20	£	29,43	£	27,98
Erträge	£	62.661	£	67.185	£	86.646
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.424		13.988		18.185
NIW je Anteil	£	4,67	£	4,80	£	4,76
Institutional PLN (Hedged):						
Erträge	PLN	915		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		92		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	PLN	10,00		k. A.		k. A.
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	23.905	SGD	16.392	SGD	5.948
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.968		1.340		517
NIW je Anteil	SGD	12,15	SGD	12,23	SGD	11,49
Investor:						
thesaurierend	\$	6.978	\$	7.681	\$	6.869
ausgegebene und umlaufende Anteile		135		147		141
NIW je Anteil	\$	51,78	\$	52,22	\$	48,87
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	k. A.		k. A.	€		3.750
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		93
NIW je Anteil	k. A.		k. A.	€		40,35

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021		31. Dez. 2020		31. Dez. 2019	
Emerging Markets Bond Fund (Forts.)						
thesaurierend	€	4.108	€	4.086	€	459
ausgegebene und umlaufende Anteile		397		390		46
NIW je Anteil	€	10,35	€	10,48	€	10,03
Administrative:						
thesaurierend	\$	37.202	\$	34.306	\$	29.152
ausgegebene und umlaufende Anteile		733		670		607
NIW je Anteil	\$	50,72	\$	51,20	\$	47,99
Class E:						
thesaurierend	\$	177.811	\$	185.616	\$	115.216
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.675		3.793		2.502
NIW je Anteil	\$	48,38	\$	48,93	\$	46,05
Erträge	\$	117.499	\$	151.156	\$	105.165
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.046		12.574		8.997
NIW je Anteil	\$	11,70	\$	12,02	\$	11,69
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	205.519	€	195.834	€	192.285
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.274		4.947		5.048
NIW je Anteil	€	38,97	€	39,59	€	38,09
Class E SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	12.492	SGD	12.729	SGD	10.302
ausgegebene und umlaufende Anteile		181		183		156
NIW je Anteil	SGD	68,84	SGD	69,62	SGD	66,03
H Institutional:						
thesaurierend	\$	425.550	\$	401.692	\$	111.856
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.869		7.371		2.197
NIW je Anteil	\$	54,08	\$	54,50	\$	50,92
Erträge	\$	211	\$	10		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		21		1		k. A.
NIW je Anteil	\$	9,95	\$	10,22		k. A.
M Retail:						
Erträge	\$	15.681	\$	14.913	\$	13.690
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.490		1.379		1.301
NIW je Anteil	\$	10,52	\$	10,82	\$	10,52
ausschüttend II	\$	13.391	\$	6.538	\$	2.201
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.471		693		236
NIW je Anteil	\$	9,10	\$	9,44	\$	9,34
M Retail AUD (Hedged):						
Erträge	AUD	2.706	AUD	9.306	AUD	5.835
ausgegebene und umlaufende Anteile		280		936		592
NIW je Anteil	AUD	9,65	AUD	9,94	AUD	9,85
Class Z:						
Erträge	\$	6.424	\$	6.442	\$	5.961
ausgegebene und umlaufende Anteile		498		486		462
NIW je Anteil	\$	12,90	\$	13,26	\$	12,90
Emerging Markets Bond ESG Fund						
Nettovermögen	\$	2.380.166	\$	1.441.457	\$	724.120
Institutional:						
thesaurierend	\$	616.309	\$	482.367	\$	265.091
ausgegebene und umlaufende Anteile		34.215		26.644		15.738
NIW je Anteil	\$	18,01	\$	18,10	\$	16,84

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Emerging Markets Bond ESG Fund (Fortsetzung)			
Erträge	\$ 289.064	\$ 18.961	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.220	1.806	1
NIW je Anteil	\$ 10,24	\$ 10,50	\$ 10,14
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 52.229	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.065	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,31	k. A.	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 834.651	€ 566.203	€ 234.194
ausgegebene und umlaufende Anteile	65.344	43.901	19.078
NIW je Anteil	€ 12,77	€ 12,90	€ 12,28
Erträge	€ 270.283	€ 111.597	€ 163.877
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.005	11.631	17.297
NIW je Anteil	€ 9,32	€ 9,59	€ 9,47
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	£ 32.466	£ 3.499	£ 197
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.245	341	19
NIW je Anteil	£ 10,00	£ 10,26	£ 10,13
Institutional GBP (Unhedged):			
Erträge	£ 2.893	£ 7	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	307	1	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,42	£ 9,76	k. A.
Investor NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 6.792	NOK 7.902	NOK 8.594
ausgegebene und umlaufende Anteile	50	58	66
NIW je Anteil	NOK 135,21	NOK 136,26	NOK 130,41
Investor SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 10.317	SEK 12.623	SEK 12.347
ausgegebene und umlaufende Anteile	83	100	103
NIW je Anteil	SEK 124,67	SEK 125,92	SEK 120,27
Administrative:			
thesaurierend	\$ 346	\$ 1.121	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	32	102	1
NIW je Anteil	\$ 10,95	\$ 11,04	\$ 10,32
Erträge	\$ 1.048	\$ 293	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	102	28	1
NIW je Anteil	\$ 10,25	\$ 10,50	\$ 10,14
Class E:			
thesaurierend	\$ 845	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	85	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,96	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 657	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	67	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,83	k. A.	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 45.711	€ 83.479	€ 8.559
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.050	7.294	779
NIW je Anteil	€ 11,29	€ 11,45	€ 10,99
Emerging Markets Corporate Bond Fund			
Nettvermögen	\$ 242.782	\$ 261.236	\$ 224.432
Institutional:			
thesaurierend	\$ 17.438	\$ 20.306	\$ 41.584
ausgegebene und umlaufende Anteile	958	1.128	2.425
NIW je Anteil	\$ 18,20	\$ 18,01	\$ 17,15
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 119.832	€ 126.871	€ 88.091
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.659	8.166	5.854
NIW je Anteil	€ 15,65	€ 15,54	€ 15,05

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)			
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	£ 56
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	6
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 9,48
Class E:			
thesaurierend	\$ 24.403	\$ 22.272	\$ 20.512
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.749	1.607	1.540
NIW je Anteil	\$ 13,95	\$ 13,86	\$ 13,32
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 15.634	CHF 16.710	CHF 18.123
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.317	1.410	1.559
NIW je Anteil	CHF 11,87	CHF 11,85	CHF 11,62
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 35.348	€ 36.387	€ 39.790
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.541	2.622	2.931
NIW je Anteil	€ 13,91	€ 13,88	€ 13,58
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund			
Nettvermögen	\$ 333.311	\$ 220.309	\$ 155.506
Institutional:			
thesaurierend	\$ 30.875	\$ 13.910	\$ 5.914
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.710	1.214	557
NIW je Anteil	\$ 11,39	\$ 11,47	\$ 10,62
Institutional EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 255.026	€ 168.688	€ 133.268
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.177	15.309	12.634
NIW je Anteil	€ 11,00	€ 11,02	€ 10,55
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund			
Nettvermögen	\$ 30.842	\$ 32.571	\$ 74.289
Institutional:			
thesaurierend	\$ 138	\$ 139	\$ 12.043
ausgegebene und umlaufende Anteile	10	10	851
NIW je Anteil	\$ 14,30	\$ 14,44	\$ 14,14
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 9.091	€ 7.119	€ 30.518
ausgegebene und umlaufende Anteile	674	538	2.163
NIW je Anteil	€ 13,49	€ 13,21	€ 14,11
Class E:			
thesaurierend	\$ 5.669	\$ 6.144	\$ 6.953
ausgegebene und umlaufende Anteile	444	474	543
NIW je Anteil	\$ 12,78	\$ 12,97	\$ 12,81
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 2.728
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	271
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,08
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 12.020	€ 14.366	€ 16.311
ausgegebene und umlaufende Anteile	926	1.126	1.187
NIW je Anteil	€ 12,97	€ 12,76	€ 13,75
PIMCO ESG Income Fund			
Nettvermögen	\$ 6.164	k. A.	k. A.
Institutional:			
thesaurierend	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,07	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 3.745	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	371	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,05	k. A.	k. A.

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
PIMCO ESG Income Fund (Forts.)			
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 560	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	56	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,05	k. A.	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 202	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,06	k. A.	k. A.
Erträge	€ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,03	k. A.	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	£ 181	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	18	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,03	k. A.	k. A.
Institutional SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 337	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	34	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,06	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,05	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,05	k. A.	k. A.
Class E CHF (Hedged):			
Erträge	CHF 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,04	k. A.	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,00	k. A.	k. A.
Erträge	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,04	k. A.	k. A.
Class R AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 1.336	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	133	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD 10,06	k. A.	k. A.
Euro Bond Fund			
Nettovermögen	€ 2.795.701	€ 3.243.455	€ 3.013.450
Institutional:			
thesaurierend	€ 2.051.536	€ 2.235.581	€ 2.054.158
ausgegebene und umlaufende Anteile	77.509	82.583	79.555
NIW je Anteil	€ 26,47	€ 27,07	€ 25,82
Erträge	€ 171.320	€ 378.659	€ 372.497
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.935	21.418	21.977
NIW je Anteil	€ 17,24	€ 17,68	€ 16,95
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 335.940	CHF 307.434	CHF 314.038
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.225	8.243	8.797
NIW je Anteil	CHF 36,42	CHF 37,30	CHF 35,70
Investor:			
thesaurierend	€ 26.179	€ 38.680	€ 30.988
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.057	1.524	1.276
NIW je Anteil	€ 24,77	€ 25,38	€ 24,29
Erträge	€ 558	€ 679	€ 784
ausgegebene und umlaufende Anteile	34	40	48
NIW je Anteil	€ 16,55	€ 16,97	€ 16,27

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Euro Bond Fund (Fortsetzung)			
Administrative:			
thesaurierend	€ 2.955	€ 5.248	€ 5.004
ausgegebene und umlaufende Anteile	124	215	213
NIW je Anteil	€ 23,85	€ 24,45	€ 23,44
Class E:			
thesaurierend	€ 189.191	€ 241.554	€ 203.722
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.207	10.200	8.938
NIW je Anteil	€ 23,05	€ 23,68	€ 22,79
Erträge	€ 47.499	€ 58.802	€ 57.386
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.814	4.596	4.660
NIW je Anteil	€ 12,45	€ 12,79	€ 12,31
Euro Credit Fund			
Nettovermögen	€ 1.031.852	€ 1.150.058	€ 961.445
Institutional:			
thesaurierend	€ 694.908	€ 854.429	€ 567.529
ausgegebene und umlaufende Anteile	40.539	49.448	33.565
NIW je Anteil	€ 17,14	€ 17,28	€ 16,91
ausschüttend II	€ 143.954	€ 110.981	€ 26.476
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.928	9.831	2.365
NIW je Anteil	€ 11,13	€ 11,29	€ 11,20
Class E:			
thesaurierend	€ 21.077	€ 24.907	€ 102.646
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.544	1.802	7.518
NIW je Anteil	€ 13,65	€ 13,82	€ 13,65
H Institutional:			
thesaurierend	€ 169.445	€ 156.377	€ 182.334
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.418	15.036	17.926
NIW je Anteil	€ 10,32	€ 10,40	€ 10,17
ausschüttend II	€ 2.468	€ 3.364	€ 82.460
ausgegebene und umlaufende Anteile	246	331	8.183
NIW je Anteil	€ 10,03	€ 10,16	€ 10,08
Euro Income Bond Fund			
Nettovermögen	€ 2.700.884	€ 3.182.867	€ 3.165.112
Institutional:			
thesaurierend	€ 710.437	€ 882.179	€ 767.421
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.891	55.950	49.782
NIW je Anteil	€ 15,83	€ 15,77	€ 15,42
Erträge	€ 245.968	€ 215.485	€ 252.961
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.367	19.471	22.900
NIW je Anteil	€ 11,00	€ 11,07	€ 11,05
Investor:			
thesaurierend	€ 10.953	€ 6.268	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.072	615	1
NIW je Anteil	€ 10,22	€ 10,20	€ 10,00
Erträge	€ 16.170	€ 19.825	€ 22.460
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.501	1.826	2.065
NIW je Anteil	€ 10,77	€ 10,86	€ 10,88
Class E:			
thesaurierend	€ 1.045.465	€ 1.263.972	€ 1.214.532
ausgegebene und umlaufende Anteile	72.506	87.596	85.319
NIW je Anteil	€ 14,42	€ 14,43	€ 14,24
Erträge	€ 614.905	€ 731.652	€ 851.868
ausgegebene und umlaufende Anteile	61.731	72.655	83.986
NIW je Anteil	€ 9,96	€ 10,07	€ 10,14
Ausschüttend Q	€ 4.598	€ 4.485	€ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	473	455	1
NIW je Anteil	€ 9,73	€ 9,86	€ 9,98
Class T:			
thesaurierend	€ 37.102	€ 41.015	€ 39.540
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.322	3.663	3.565
NIW je Anteil	€ 11,17	€ 11,20	€ 11,09

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Euro Income Bond Fund (Forts.)			
Erträge	€ 15.286	€ 17.986	€ 16.311
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.720	1.998	1.792
NIW je Anteil	€ 8,89	€ 9,00	€ 9,10
Euro Long Average Duration Fund			
Nettovermögen	€ 191.992	€ 182.461	€ 162.478
Institutional:			
thesaurierend	€ 191.992	€ 182.461	€ 162.478
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.519	5.656	5.636
NIW je Anteil	€ 29,45	€ 32,26	€ 28,83
Euro Short-Term Fund			
Nettovermögen	€ 699.528	€ 807.538	€ 710.026
Institutional:			
thesaurierend	€ 684.180	€ 789.499	€ 401.800
ausgegebene und umlaufende Anteile	57.021	65.792	33.324
NIW je Anteil	€ 12,00	€ 12,00	€ 12,06
Class E:			
thesaurierend	€ 15.348	€ 18.039	€ 308.226
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.434	1.679	28.342
NIW je Anteil	€ 10,70	€ 10,74	€ 10,88
PIMCO European High Yield Bond Fund			
Nettovermögen	€ 166.170	€ 162.061	k. A.
Institutional:			
thesaurierend	€ 9.348	€ 9.610	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	871	918	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,74	€ 10,46	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	€ 156.822	€ 152.451	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.500	14.501	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,81	€ 10,51	k. A.
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund			
Nettovermögen	€ 410.246	€ 350.749	€ 353.235
Institutional:			
thesaurierend	€ 264.766	€ 259.542	€ 332.406
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.074	22.487	29.004
NIW je Anteil	€ 11,47	€ 11,54	€ 11,46
Class E:			
thesaurierend	€ 4.900	€ 6.217	€ 20.829
ausgegebene und umlaufende Anteile	495	623	2.089
NIW je Anteil	€ 9,90	€ 9,99	€ 9,97
H Institutional:			
thesaurierend	€ 140.580	€ 84.990	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.081	8.456	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,98	€ 10,05	k. A.
Global Advantage Fund			
Nettovermögen	\$ 515.665	\$ 524.284	\$ 467.498
Institutional:			
thesaurierend	\$ 25.319	\$ 32.718	\$ 32.601
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.633	2.070	2.260
NIW je Anteil	\$ 15,51	\$ 15,81	\$ 14,43
Institutional CHF (Partially Hedged):			
Erträge	CHF 134.877	CHF 136.133	CHF 132.762
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.823	12.809	12.662
NIW je Anteil	CHF 10,52	CHF 10,63	CHF 10,49

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Global Advantage Fund (Forts.)			
Institutional EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 230.089	€ 215.680	€ 203.177
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.293	15.249	14.910
NIW je Anteil	€ 14,12	€ 14,14	€ 13,63
Institutional GBP (Partially Hedged):			
thesaurierend	£ 181	£ 162	£ 159
ausgegebene und umlaufende Anteile	14	12	12
NIW je Anteil	£ 13,33	£ 13,45	£ 12,74
Institutional NOK (Partially Hedged):			
thesaurierend	NOK 524.441	NOK 526.754	NOK 477.185
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.464	3.462	3.318
NIW je Anteil	NOK 151,38	NOK 152,16	NOK 143,81
Class E:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 3.009
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	264
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 11,39
Class E EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 8.747	€ 9.744	€ 10.874
ausgegebene und umlaufende Anteile	691	764	876
NIW je Anteil	€ 12,66	€ 12,75	€ 12,41
Global Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 14.699.233	\$ 16.302.309	\$ 15.000.575
Institutional:			
thesaurierend	\$ 4.076.548	\$ 4.781.849	\$ 4.042.955
ausgegebene und umlaufende Anteile	113.858	131.859	120.012
NIW je Anteil	\$ 35,80	\$ 36,26	\$ 33,69
Erträge	\$ 193.507	\$ 241.431	\$ 192.479
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.564	11.685	9.861
NIW je Anteil	\$ 20,23	\$ 20,66	\$ 19,52
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 377.248	\$ 413.925	\$ 396.595
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.718	11.412	12.164
NIW je Anteil	\$ 35,20	\$ 36,27	\$ 32,60
Erträge	\$ 27.810	\$ 44.078	\$ 35.054
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.211	1.848	1.608
NIW je Anteil	\$ 22,96	\$ 23,86	\$ 21,81
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 77.519	CAD 83.688	CAD 82.247
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.771	7.213	7.610
NIW je Anteil	CAD 11,45	CAD 11,60	CAD 10,81
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 499.483	CHF 464.413	CHF 474.485
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.293	13.054	14.098
NIW je Anteil	CHF 34,95	CHF 35,58	CHF 33,66
Erträge	CHF 226.185	CHF 213.078	CHF 208.245
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.845	9.953	10.113
NIW je Anteil	CHF 20,86	CHF 21,41	CHF 20,59

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Global Bond Fund (Forts.)			
Institutional EUR (Currency Exposure):			
thesaurierend	€ 118.952	€ 163.042	€ 157.567
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.471	11.624	11.466
NIW je Anteil	€ 14,04	€ 14,03	€ 13,74
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.397.811	€ 2.491.097	€ 2.747.931
ausgegebene und umlaufende Anteile	82.023	83.802	97.996
NIW je Anteil	€ 29,23	€ 29,73	€ 28,04
Erträge	€ 710.507	€ 766.678	€ 678.567
ausgegebene und umlaufende Anteile	37.637	39.612	36.554
NIW je Anteil	€ 18,88	€ 19,35	€ 18,56
ausschüttend II	k. A.	k. A.	€ 466
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	€ 48
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,80
Institutional GBP (Currency Exposure):			
thesaurierend	£ 3.779	£ 4.429	£ 4.807
ausgegebene und umlaufende Anteile	335	377	441
NIW je Anteil	£ 11,28	£ 11,75	£ 10,90
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 200.953	£ 160.075	£ 163.030
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.530	6.703	7.285
NIW je Anteil	£ 23,56	£ 23,88	£ 22,38
Erträge	£ 254.310	£ 254.507	£ 517.631
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.812	17.444	37.228
NIW je Anteil	£ 14,28	£ 14,59	£ 13,90
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	ILS 305	ILS 331	ILS 474
ausgegebene und umlaufende Anteile	18	19	30
NIW je Anteil	ILS 16,83	ILS 17,09	ILS 15,99
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 3.600.902	NOK 3.542.383	NOK 4.375.870
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.396	14.946	19.729
NIW je Anteil	NOK 233,88	NOK 237,01	NOK 221,80
Institutional NZD (Hedged):			
Erträge	NZD 304.506	NZD 250.817	NZD 220.766
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.484	5.230	4.853
NIW je Anteil	NZD 46,96	NZD 47,96	NZD 45,49
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 1.110.301	SEK 1.176.107	SEK 1.604.480
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.915	5.129	7.441
NIW je Anteil	SEK 225,89	SEK 229,29	SEK 215,61
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 141.451	SGD 176.007	SGD 98.535
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.292	8.960	5.382
NIW je Anteil	SGD 19,40	SGD 19,64	SGD 18,31
Investor:			
thesaurierend	\$ 163.693	\$ 195.058	\$ 181.048
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.940	5.801	5.776
NIW je Anteil	\$ 33,14	\$ 33,62	\$ 31,34

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Global Bond Fund (Forts.)			
Erträge	\$ 7.439	\$ 9.885	\$ 17.154
ausgegebene und umlaufende Anteile	438	570	1.046
NIW je Anteil	\$ 16,99	\$ 17,35	\$ 16,39
Investor (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 2.926	\$ 5.415	\$ 6.008
ausgegebene und umlaufende Anteile	88	158	194
NIW je Anteil	\$ 33,24	\$ 34,32	\$ 30,96
Investor CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 196.031	CHF 283.165	CHF 295.384
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.504	20.545	22.576
NIW je Anteil	CHF 13,52	CHF 13,78	CHF 13,08
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 88.627	€ 83.112	€ 51.144
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.213	2.958	1.923
NIW je Anteil	€ 27,58	€ 28,10	€ 26,60
Investor GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 6.044	£ 6.089	£ 4.964
ausgegebene und umlaufende Anteile	271	269	233
NIW je Anteil	£ 22,28	£ 22,62	£ 21,27
Investor NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 29.327	NOK 32.011	NOK 47.640
ausgegebene und umlaufende Anteile	132	142	225
NIW je Anteil	NOK 221,87	NOK 225,22	NOK 211,51
Administrative:			
thesaurierend	\$ 14.302	\$ 23.302	\$ 10.597
ausgegebene und umlaufende Anteile	443	710	346
NIW je Anteil	\$ 32,30	\$ 32,80	\$ 30,62
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 93
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	€ 9
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 10,57
Class E:			
thesaurierend	\$ 482.518	\$ 550.753	\$ 456.775
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.485	17.372	15.371
NIW je Anteil	\$ 31,16	\$ 31,70	\$ 29,72
Erträge	\$ 164.602	\$ 201.589	\$ 226.763
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.264	13.511	16.087
NIW je Anteil	\$ 14,61	\$ 14,92	\$ 14,10
Class E (Currency Exposure)			
thesaurierend	\$ 74.368	\$ 84.089	\$ 63.626
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.217	5.699	4.754
NIW je Anteil	\$ 14,26	\$ 14,76	\$ 13,38
Erträge	\$ 16.891	\$ 19.720	\$ 13.687
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.375	1.545	1.173
NIW je Anteil	\$ 12,28	\$ 12,76	\$ 11,67
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 2.361	CHF 2.635	CHF 1.695
ausgegebene und umlaufende Anteile	224	244	165
NIW je Anteil	CHF 10,54	CHF 10,78	CHF 10,29
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.095.864	€ 1.168.524	€ 988.122
ausgegebene und umlaufende Anteile	43.061	44.954	39.935
NIW je Anteil	€ 25,45	€ 25,99	€ 24,74
Erträge	€ 50.706	€ 61.288	€ 46.925
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.895	5.769	4.606
NIW je Anteil	€ 10,36	€ 10,62	€ 10,19
Class E GBP (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	£ 2.435
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	£ 173
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 14,08
Class E NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 85	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	NOK 100,29	k. A.	k. A.

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Global Bond Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
G Retail EUR (Hedged):			
Erträge	€ 132.369	€ 140.905	€ 145.941
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.634	13.167	14.226
NIW je Anteil	€ 10,48	€ 10,70	€ 10,26
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 867.143	\$ 954.525	\$ 970.919
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.985	27.130	29.656
NIW je Anteil	\$ 34,71	\$ 35,18	\$ 32,74
Erträge	\$ 2.988	\$ 3.905	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	293	375	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,21	\$ 10,42	k. A.
H Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 771	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	78	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,94	k. A.	k. A.
M Retail:			
ausschüttend II	\$ 1.806	\$ 2.809	\$ 12.445
ausgegebene und umlaufende Anteile	172	260	1.203
NIW je Anteil	\$ 10,51	\$ 10,80	\$ 10,35
M Retail HKD (Unhedged):			
ausschüttend II	HKD 8.427	HKD 11.626	HKD 25.429
ausgegebene und umlaufende Anteile	804	1.081	2.456
NIW je Anteil	HKD 10,48	HKD 10,76	HKD 10,36
M Retail SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 90	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SEK 100,46	k. A.	k. A.
Class R:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 1.257
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	96
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 13,05
Class R EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 6.650	€ 5.196	€ 9.532
ausgegebene und umlaufende Anteile	541	415	806
NIW je Anteil	€ 12,28	€ 12,51	€ 11,83
Class R GBP (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	£ 4.654
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	426
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 10,93
Class R SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 99	SEK 100	SEK 94
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	SEK 109,51	SEK 111,31	SEK 104,96
Class T:			
thesaurierend	\$ 34.293	\$ 42.315	\$ 33.211
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.804	3.396	2.835
NIW je Anteil	\$ 12,23	\$ 12,46	\$ 11,72
Erträge	\$ 4.297	\$ 5.274	\$ 5.202
ausgegebene und umlaufende Anteile	369	443	463
NIW je Anteil	\$ 11,65	\$ 11,89	\$ 11,23
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 23.131	€ 25.635	€ 15.650
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.109	2.285	1.461
NIW je Anteil	€ 10,97	€ 11,22	€ 10,71
Class W:			
thesaurierend	\$ 40.279	\$ 21.207	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.979	2.070	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,12	\$ 10,25	k. A.
Erträge	\$ 11.091	\$ 13.683	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.113	1.345	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,96	\$ 10,17	k. A.

	Global Bond Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Class W (Currency Exposure)			
thesaurierend	\$ 10	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,18	\$ 10,48	k. A.
Erträge	\$ 10	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,02	\$ 10,41	k. A.
Class W CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 35.301	CHF 35.760	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.523	3.508	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,02	CHF 10,20	k. A.
Erträge	CHF 712	CHF 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	72	1	k. A.
NIW je Anteil	CHF 9,87	CHF 10,12	k. A.
Class W EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 16.206	€ 14.731	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.614	1.444	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,04	€ 10,20	k. A.
Erträge	€ 1.932	€ 1.740	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	195	172	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,89	€ 10,14	k. A.
Class W GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 701	£ 139	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	69	14	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,10	£ 10,23	k. A.
Erträge	£ 9.252	£ 8.773	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	930	863	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,95	£ 10,16	k. A.
Class W NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 3.783	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	38	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	NOK 100,51	k. A.	k. A.
Class W SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 89	SEK 91	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	SEK 100,73	SEK 102,20	k. A.
Nettvermögen	\$ 1.647.091	\$ 1.509.594	\$ 762.434
Institutional:			
thesaurierend	\$ 197.407	\$ 153.820	\$ 63.955
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.429	12.640	5.649
NIW je Anteil	\$ 12,02	\$ 12,17	\$ 11,32
Erträge	\$ 23.110	\$ 19.510	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.204	1.826	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,49	\$ 10,68	k. A.
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 21.070	CHF 16.793	CHF 4.460
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.960	1.534	430
NIW je Anteil	CHF 10,75	CHF 10,94	CHF 10,37

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2019	31. Dez. 2019
	Global Bond ESG Fund (Forts.)					
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	288.071	€	276.328	€	144.191
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		26.340		24.851		13.727
NIW je Anteil	€	10,94	€	11,12	€	10,50
Erträge	€	101.084	€	165.370	€	147.875
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		9.885		15.815		14.759
NIW je Anteil	€	10,23	€	10,46	€	10,02
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	14.363	£	13.241		k. A.
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		1.389		1.264		k. A.
NIW je Anteil	£	10,34	£	10,48		k. A.
Erträge	£	51.871	£	43.778	£	26.518
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		4.875		4.037		2.564
NIW je Anteil	£	10,64	£	10,84	£	10,34
Institutional GBP (Unhedged):						
Erträge	£	21.193	£	7		k. A.
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		2.249		1		k. A.
NIW je Anteil	£	9,42	£	9,70		k. A.
Institutional NOK (Hedged):						
thesaurierend	NOK	4.417.750	NOK	4.228.645	NOK	2.170.649
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		382.050		360.891		197.730
NIW je Anteil	NOK	11,56	NOK	11,72	NOK	10,98
Institutional NZD (Hedged):						
Erträge	NZD	67.776	NZD	68.677	NZD	50.068
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		6.110		6.078		4.676
NIW je Anteil	NZD	11,09	NZD	11,30	NZD	10,71
Institutional SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK	546.202		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		5.430		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	SEK	100,59		k. A.		k. A.
Investor:						
thesaurierend	\$	12.906	\$	18.700	\$	859
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		1.120		1.600		79
NIW je Anteil	\$	11,52	\$	11,69	\$	10,91
Administrative:						
thesaurierend	\$	2.392	\$	11	\$	11
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		214		1		1
NIW je Anteil	\$	11,16	\$	11,34	\$	10,60
Erträge	\$	11	\$	11	\$	11
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	\$	10,89	\$	11,09	\$	10,46
Class E:						
Erträge	\$	2.271	\$	6.261	\$	405
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		209		565		39
NIW je Anteil	\$	10,88	\$	11,08	\$	10,46
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	55.186	€	44.524	€	18.930
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		5.240		4.140		1.846
NIW je Anteil	€	10,53	€	10,76	€	10,25

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2019	31. Dez. 2019
	Global Bond ESG Fund (Forts.)					
Class Z AUD (Hedged):						
Erträge	AUD	151.676	AUD	98.588	AUD	39.214
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		13.676		8.716		3.651
NIW je Anteil	AUD	11,09	AUD	11,31	AUD	10,74
Nettvermögen	\$	1.014.062	\$	929.980	\$	1.092.298
Institutional:						
thesaurierend	\$	515.123	\$	493.644	\$	509.983
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		20.683		19.620		21.424
NIW je Anteil	\$	24,91	\$	25,16	\$	23,80
Erträge	\$	47.170	\$	46.004	\$	47.694
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		2.771		2.652		2.856
NIW je Anteil	\$	17,02	\$	17,35	\$	16,70
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	83.069	€	35.120	€	119.058
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		4.552		1.898		6.706
NIW je Anteil	€	18,25	€	18,50	€	17,76
Institutional GBP (Hedged):						
Erträge	£	207	£	210	£	200
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		20		20		20
NIW je Anteil	£	10,31	£	10,54	£	10,23
Investor:						
thesaurierend	\$	17.933	\$	21.037	\$	16.917
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		760		881		746
NIW je Anteil	\$	23,59	\$	23,88	\$	22,67
Administrative:						
thesaurierend	\$	11.936	\$	10.624	\$	10.066
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		521		458		456
NIW je Anteil	\$	22,90	\$	23,19	\$	22,05
Class E:						
Erträge	\$	35.269	\$	46.592	\$	149.150
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		2.134		2.766		9.199
NIW je Anteil	\$	16,52	\$	16,84	\$	16,21
Class E (Currency Exposure)						
Erträge	\$	86.694	\$	56.847	\$	57.203
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		8.341		5.213		5.768
NIW je Anteil	\$	10,39	\$	10,91	\$	9,92
H Institutional:						
thesaurierend	\$	63.241	\$	73.013	\$	16.973
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		5.629		6.428		1.577
NIW je Anteil	\$	11,23	\$	11,36	\$	10,76
Class Z:						
thesaurierend	\$	137.899	\$	138.962	\$	150.405
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		13.050		13.049		15.001
NIW je Anteil	\$	10,57	\$	10,65	\$	10,03
Nettvermögen	\$	797.683	\$	702.430	\$	814.354
Institutional:						
thesaurierend	\$	46.719	\$	45.298	\$	223.748
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		2.038		2.116		11.959
NIW je Anteil	\$	22,93	\$	21,41	\$	18,71
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	192.804	€	123.732	€	88.022
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		9.382		6.469		5.109
NIW je Anteil	€	20,55	€	19,13	€	17,23
Erträge		k. A.		k. A.		€ 941
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		k. A.		k. A.		€ 92
NIW je Anteil		k. A.		k. A.		€ 10,20

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	30. Jun. 2021	31. Dez. 2019
	PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Fortsetzung)					
Institutional GBP (Hedged):						
Erträge	£ 4.220	£ 4.026	£ 4.220	£ 4.026	£ 3.936	
ausgegebene und umlaufende Anteile	346	349	346	349	363	
NIW je Anteil	£ 12,19	£ 11,55	£ 12,19	£ 11,55	£ 10,84	
Investor:						
thesaurierend	\$ 9.790	\$ 9.158	\$ 9.790	\$ 9.158	\$ 8.276	
ausgegebene und umlaufende Anteile	573	573	573	573	591	
NIW je Anteil	\$ 17,08	\$ 15,98	\$ 17,08	\$ 15,98	\$ 14,01	
Class E:						
thesaurierend	\$ 35.686	\$ 33.696	\$ 35.686	\$ 33.696	\$ 36.200	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.797	1.806	1.797	1.806	2.193	
NIW je Anteil	\$ 19,86	\$ 18,66	\$ 19,86	\$ 18,66	\$ 16,50	
Erträge	\$ 10.012	\$ 8.100	\$ 10.012	\$ 8.100	\$ 7.630	
ausgegebene und umlaufende Anteile	887	749	887	749	767	
NIW je Anteil	\$ 11,28	\$ 10,81	\$ 11,28	\$ 10,81	\$ 9,95	
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 212.181	€ 205.357	€ 212.181	€ 205.357	€ 210.021	
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.922	12.325	11.922	12.325	13.825	
NIW je Anteil	€ 17,90	€ 16,66	€ 17,90	€ 16,66	€ 15,19	
Erträge	€ 48.075	€ 42.548	€ 48.075	€ 42.548	€ 44.096	
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.685	4.342	4.685	4.342	4.744	
NIW je Anteil	€ 10,26	€ 9,80	€ 10,26	€ 9,80	€ 9,30	
Class Z:						
thesaurierend	\$ 152.361	\$ 145.959	\$ 152.361	\$ 145.959	\$ 148.177	
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.042	9.320	9.042	9.320	10.928	
NIW je Anteil	\$ 16,85	\$ 15,66	\$ 16,85	\$ 15,66	\$ 13,56	
	Global High Yield Bond Fund					
Nettovermögen	\$ 5.421.647	\$ 5.403.543	\$ 5.421.647	\$ 5.403.543	\$ 4.341.308	
Institutional:						
thesaurierend	\$ 965.963	\$ 1.065.384	\$ 965.963	\$ 1.065.384	\$ 785.615	
ausgegebene und umlaufende Anteile	33.829	38.174	33.829	38.174	29.474	
NIW je Anteil	\$ 28,55	\$ 27,91	\$ 28,55	\$ 27,91	\$ 26,66	
Erträge	\$ 456.978	\$ 349.849	\$ 456.978	\$ 349.849	\$ 305.771	
ausgegebene und umlaufende Anteile	39.740	30.507	39.740	30.507	26.737	
NIW je Anteil	\$ 11,50	\$ 11,47	\$ 11,50	\$ 11,47	\$ 11,44	
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 37.529	CHF 40.299	CHF 37.529	CHF 40.299	CHF 39.337	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.072	2.265	2.072	2.265	2.263	
NIW je Anteil	CHF 18,11	CHF 17,79	CHF 18,11	CHF 17,79	CHF 17,38	
Erträge	CHF 16.933	CHF 18.324	CHF 16.933	CHF 18.324	CHF 18.347	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.871	2.019	1.871	2.019	1.982	
NIW je Anteil	CHF 9,05	CHF 9,08	CHF 9,05	CHF 9,08	CHF 9,26	
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 1.220.256	€ 1.149.182	€ 1.220.256	€ 1.149.182	€ 815.073	
ausgegebene und umlaufende Anteile	48.530	46.572	48.530	46.572	33.883	
NIW je Anteil	€ 25,14	€ 24,68	€ 25,14	€ 24,68	€ 24,06	
Erträge	€ 152.784	€ 109.781	€ 152.784	€ 109.781	€ 206.563	
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.899	9.253	12.899	9.253	17.111	
NIW je Anteil	€ 11,84	€ 11,86	€ 11,84	€ 11,86	€ 12,07	
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 223.980	£ 96.397	£ 223.980	£ 96.397	£ 11.655	
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.658	6.007	13.658	6.007	746	
NIW je Anteil	£ 16,40	£ 16,05	£ 16,40	£ 16,05	£ 15,63	
Erträge	£ 541.712	£ 642.574	£ 541.712	£ 642.574	£ 562.546	
ausgegebene und umlaufende Anteile	92.113	109.465	92.113	109.465	94.145	
NIW je Anteil	£ 5,88	£ 5,87	£ 5,88	£ 5,87	£ 5,98	
Investor:						
thesaurierend	\$ 9.135	\$ 12.417	\$ 9.135	\$ 12.417	\$ 13.535	
ausgegebene und umlaufende Anteile	677	940	677	940	1.069	
NIW je Anteil	\$ 13,50	\$ 13,21	\$ 13,50	\$ 13,21	\$ 12,66	

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	30. Jun. 2021	31. Dez. 2019
	Global High Yield Bond Fund (Forts.)					
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 4.170	€ 3.311	€ 4.170	€ 3.311	€ 1.899	
ausgegebene und umlaufende Anteile	172	139	172	139	81	
NIW je Anteil	€ 24,24	€ 23,83	€ 24,24	€ 23,83	€ 23,31	
Administrative:						
thesaurierend	\$ 52.683	\$ 47.282	\$ 52.683	\$ 47.282	\$ 56.290	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.967	1.802	1.967	1.802	2.234	
NIW je Anteil	\$ 26,78	\$ 26,24	\$ 26,78	\$ 26,24	\$ 25,19	
Erträge	\$ 31.375	\$ 29.675	\$ 31.375	\$ 29.675	\$ 18.547	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.788	2.644	2.788	2.644	1.658	
NIW je Anteil	\$ 11,25	\$ 11,22	\$ 11,25	\$ 11,22	\$ 11,19	
Administrative EUR (Hedged):						
Erträge	€ 2.121	€ 2.201	€ 2.121	€ 2.201	€ 2.110	
ausgegebene und umlaufende Anteile	216	223	216	223	210	
NIW je Anteil	€ 9,84	€ 9,85	€ 9,84	€ 9,85	€ 10,03	
Administrative GBP (Hedged):						
Erträge	£ 973	£ 1.475	£ 973	£ 1.475	£ 1.582	
ausgegebene und umlaufende Anteile	92	140	92	140	148	
NIW je Anteil	£ 10,55	£ 10,53	£ 10,55	£ 10,53	£ 10,72	
Class E:						
thesaurierend	\$ 195.010	\$ 210.078	\$ 195.010	\$ 210.078	\$ 207.395	
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.800	8.558	7.800	8.558	8.767	
NIW je Anteil	\$ 25,00	\$ 24,55	\$ 25,00	\$ 24,55	\$ 23,66	
Erträge	\$ 186.646	\$ 224.794	\$ 186.646	\$ 224.794	\$ 213.262	
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.491	19.913	16.491	19.913	18.948	
NIW je Anteil	\$ 11,32	\$ 11,29	\$ 11,32	\$ 11,29	\$ 11,26	
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 299.959	€ 288.006	€ 299.959	€ 288.006	€ 285.099	
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.129	11.814	12.129	11.814	11.888	
NIW je Anteil	€ 24,73	€ 24,38	€ 24,73	€ 24,38	€ 23,98	
Erträge	€ 40.856	€ 43.265	€ 40.856	€ 43.265	€ 53.008	
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.219	4.460	4.219	4.460	5.371	
NIW je Anteil	€ 9,68	€ 9,70	€ 9,68	€ 9,70	€ 9,87	
Class E GBP (Hedged):						
Erträge	£ 8.676	£ 7.198	£ 8.676	£ 7.198	£ 10.588	
ausgegebene und umlaufende Anteile	701	583	701	583	842	
NIW je Anteil	£ 12,38	£ 12,36	£ 12,38	£ 12,36	£ 12,57	
Class E SGD (Hedged):						
Erträge	SGD 11.006	SGD 9.093	SGD 11.006	SGD 9.093	SGD 6.227	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.038	860	1.038	860	586	
NIW je Anteil	SGD 10,60	SGD 10,57	SGD 10,60	SGD 10,57	SGD 10,62	
H Institutional:						
thesaurierend	\$ 114.455	\$ 240.370	\$ 114.455	\$ 240.370	\$ 223.606	
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.161	8.934	4.161	8.934	8.686	
NIW je Anteil	\$ 27,50	\$ 26,91	\$ 27,50	\$ 26,91	\$ 25,74	
Erträge	\$ 12.458	\$ 9.847	\$ 12.458	\$ 9.847	\$ 24.582	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.221	968	1.221	968	2.423	
NIW je Anteil	\$ 10,20	\$ 10,17	\$ 10,20	\$ 10,17	\$ 10,14	
M Retail:						
Erträge	\$ 31.532	\$ 30.491	\$ 31.532	\$ 30.491	\$ 35.412	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.822	2.736	2.822	2.736	3.190	
NIW je Anteil	\$ 11,17	\$ 11,14	\$ 11,17	\$ 11,14	\$ 11,10	
ausschüttend II	\$ 102.725	\$ 49.638	\$ 102.725	\$ 49.638	\$ 60.748	
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.143	5.358	11.143	5.358	6.487	
NIW je Anteil	\$ 9,22	\$ 9,26	\$ 9,22	\$ 9,26	\$ 9,36	
Class R:						
thesaurierend	\$ 72.566	\$ 73.682	\$ 72.566	\$ 73.682	\$ 10.517	
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.606	4.779	4.606	4.779	713	
NIW je Anteil	\$ 15,75	\$ 15,42	\$ 15,75	\$ 15,42	\$ 14,76	

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Global High Yield Bond Fund (Fort)			
Class R GBP (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	£ 1.335
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	135
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 9,87
Class T:			
thesaurierend	\$ 7.335	\$ 7.892	\$ 8.392
ausgegebene und umlaufende Anteile	548	599	658
NIW je Anteil	\$ 13,39	\$ 13,18	\$ 12,75
Erträge	\$ 2.706	\$ 2.703	\$ 3.277
ausgegebene und umlaufende Anteile	257	257	312
NIW je Anteil	\$ 10,55	\$ 10,52	\$ 10,49
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.650	€ 1.448	€ 698
ausgegebene und umlaufende Anteile	148	132	64
NIW je Anteil	€ 11,13	€ 11,00	€ 10,86
Global Investment Grade Credit Fund			
Nettovermögen	\$ 21.358.661	\$ 28.178.170	\$ 21.938.396
Institutional:			
thesaurierend	\$ 4.281.540	\$ 5.463.978	\$ 5.013.005
ausgegebene und umlaufende Anteile	192.902	244.589	237.707
NIW je Anteil	\$ 22,20	\$ 22,34	\$ 21,09
Erträge	\$ 987.250	\$ 1.176.158	\$ 805.411
ausgegebene und umlaufende Anteile	73.783	86.159	60.729
NIW je Anteil	\$ 13,38	\$ 13,65	\$ 13,26
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 124.615	\$ 135.818	\$ 110.232
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.365	7.905	6.934
NIW je Anteil	\$ 16,92	\$ 17,18	\$ 15,90
Erträge	\$ 48.933	\$ 46.397	\$ 21.223
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.732	4.359	2.094
NIW je Anteil	\$ 10,34	\$ 10,64	\$ 10,13
Institutional AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 79.899	AUD 193.406	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.389	17.513	k. A.
NIW je Anteil	AUD 10,81	AUD 11,04	k. A.
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 984.662	CHF 1.033.114	CHF 928.941
ausgegebene und umlaufende Anteile	54.016	56.019	52.257
NIW je Anteil	CHF 18,23	CHF 18,44	CHF 17,78
Erträge	CHF 56.320	CHF 64.939	CHF 54.079
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.105	6.862	5.763
NIW je Anteil	CHF 9,23	CHF 9,46	CHF 9,38
Institutional CZK (Hedged):			
Erträge	CZK 2.184.661	CZK 2.321.368	CZK 2.153.609
ausgegebene und umlaufende Anteile	222.939	232.003	218.737
NIW je Anteil	CZK 9,80	CZK 10,01	CZK 9,85
Institutional EUR (Currency Exposure):			
thesaurierend	€ 28.818	€ 19.426	€ 16.347
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.020	1.383	1.155
NIW je Anteil	€ 14,27	€ 14,04	€ 14,16

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Global Investment Grade Credit Fund (Fort.)			
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.471.654	€ 3.901.877	€ 2.881.106
ausgegebene und umlaufende Anteile	120.000	187.485	144.023
NIW je Anteil	€ 20,60	€ 20,81	€ 20,00
Erträge	€ 711.293	€ 740.139	€ 797.263
ausgegebene und umlaufende Anteile	58.845	59.770	65.110
NIW je Anteil	€ 12,09	€ 12,38	€ 12,24
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 375.256	£ 443.999	£ 592.954
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.634	19.545	27.284
NIW je Anteil	£ 22,56	£ 22,72	£ 21,73
Erträge	£ 2.683.317	£ 3.908.795	£ 2.759.051
ausgegebene und umlaufende Anteile	192.269	274.389	196.632
NIW je Anteil	£ 13,96	£ 14,25	£ 14,03
Institutional HUF (Hedged):			
Erträge	HUF 9.901.777	HUF 9.940.031	HUF 9.489.650
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.010.049	995.298	964.706
NIW je Anteil	HUF 9,80	HUF 9,99	HUF 9,84
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	ILS 186.799	ILS 231.711	ILS 256.506
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.900	13.394	15.563
NIW je Anteil	ILS 17,14	ILS 17,30	ILS 16,48
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 451.914	NOK 452.970	NOK 404.151
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.806	2.793	2.602
NIW je Anteil	NOK 161,06	NOK 162,17	NOK 155,30
Institutional PLN (Hedged):			
Erträge	PLN 125.000	PLN 24.867	PLN 30.068
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.594	2.257	2.779
NIW je Anteil	PLN 10,78	PLN 11,02	PLN 10,82
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 3.854.913	SEK 4.033.636	SEK 3.319.651
ausgegebene und umlaufende Anteile	220.721	228.950	196.270
NIW je Anteil	SEK 17,47	SEK 17,62	SEK 16,91
Institutional SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 9.121	SGD 53.885	SGD 28.812
ausgegebene und umlaufende Anteile	834	4.827	2.642
NIW je Anteil	SGD 10,94	SGD 11,16	SGD 10,91
Investor:			
thesaurierend	\$ 1.362.362	\$ 1.715.463	\$ 1.568.296
ausgegebene und umlaufende Anteile	56.033	69.981	67.538
NIW je Anteil	\$ 24,31	\$ 24,51	\$ 23,22
Erträge	\$ 123.654	\$ 272.490	\$ 164.568
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.688	18.766	11.666
NIW je Anteil	\$ 14,23	\$ 14,52	\$ 14,11
Investor AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 6.231	AUD 8.681	AUD 6.026
ausgegebene und umlaufende Anteile	588	802	566
NIW je Anteil	AUD 10,60	AUD 10,83	AUD 10,64

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)				Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)			
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Investor CAD (Hedged):								
Erträge	CAD	2.157	CAD	3.272	CAD			760
ausgegebene und umlaufende Anteile		202		300				71
NIW je Anteil	CAD	10,67	CAD	10,89	CAD			10,64
Investor CHF (Hedged):								
thesaurierend	CHF	8.173	CHF	8.313	CHF			31.452
ausgegebene und umlaufende Anteile		609		611				2.390
NIW je Anteil	CHF	13,42	CHF	13,60	CHF			13,16
Erträge	CHF	8.878	CHF	10.171	CHF			15.578
ausgegebene und umlaufende Anteile		747		834				1.289
NIW je Anteil	CHF	11,88	CHF	12,19	CHF			12,09
Investor EUR (Hedged):								
thesaurierend	€	57.535	€	71.993	€			62.076
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.947		3.643				3.256
NIW je Anteil	€	19,53	€	19,76	€			19,06
Erträge	€	17.363	€	16.947	€			22.383
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.370		1.306				1.743
NIW je Anteil	€	12,67	€	12,98	€			12,84
Investor GBP (Hedged):								
Erträge	£	6.159	£	8.458	£			5.761
ausgegebene und umlaufende Anteile		455		612				423
NIW je Anteil	£	13,54	£	13,82	£			13,61
Investor RMB (Hedged):								
Erträge	CNH	2.355	CNH	7.674	CNH			2.832
ausgegebene und umlaufende Anteile		21		67				26
NIW je Anteil	CNH	112,78	CNH	113,76	CNH			108,96
Investor SGD (Hedged):								
Erträge	SGD	12.559	SGD	20.558	SGD			12.164
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.177		1.889				1.144
NIW je Anteil	SGD	10,67	SGD	10,89	SGD			10,63
Administrative:								
thesaurierend	\$	219.176	\$	241.443	\$			115.951
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.504		11.468				5.805
NIW je Anteil	\$	20,87	\$	21,05	\$			19,98
Erträge	\$	158.616	\$	290.320	\$			174.183
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.526		20.679				12.771
NIW je Anteil	\$	13,76	\$	14,04	\$			13,64
Administrative CHF (Hedged):								
thesaurierend	CHF	987	CHF	1.583	CHF			1.406
ausgegebene und umlaufende Anteile		83		132				121
NIW je Anteil	CHF	11,84	CHF	12,01	CHF			11,63
Administrative EUR (Hedged):								
thesaurierend	€	12.698	€	21.800	€			18.194
ausgegebene und umlaufende Anteile		687		1.165				1.006
NIW je Anteil	€	18,48	€	18,72	€			18,08
Erträge	€	11.233	€	13.726	€			20.359
ausgegebene und umlaufende Anteile		918		1.095				1.643
NIW je Anteil	€	12,23	€	12,53	€			12,39
Administrative GBP (Hedged):								
Erträge	£	8.112	£	9.572	£			14.539
ausgegebene und umlaufende Anteile		602		696				1.073
NIW je Anteil	£	13,47	£	13,75	£			13,54
Administrative HKD (Unhedged):								
Erträge	HKD	38.372	HKD	40.974	HKD			55.036
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.662		3.837				5.278
NIW je Anteil	HKD	10,48	HKD	10,68	HKD			10,43
Administrative SEK (Hedged):								
thesaurierend	SEK	1.125.219	SEK	1.214.895	SEK			811.148
ausgegebene und umlaufende Anteile		90.423		96.543				66.805
NIW je Anteil	SEK	12,44	SEK	12,58	SEK			12,14
Administrative SGD (Hedged):								
Erträge	SGD	5.429	SGD	48.256	SGD			26.014
ausgegebene und umlaufende Anteile		528		4.597				2.537
NIW je Anteil	SGD	10,29	SGD	10,50	SGD			10,25
Class E:								
thesaurierend	\$	1.010.282	\$	1.314.292	\$			941.578
ausgegebene und umlaufende Anteile		50.923		65.526				49.282
NIW je Anteil	\$	19,84	\$	20,06	\$			19,11
Erträge	\$	478.172	\$	615.957	\$			637.033
ausgegebene und umlaufende Anteile		32.937		41.586				44.274
NIW je Anteil	\$	14,52	\$	14,81	\$			14,39
Class E CHF (Hedged):								
thesaurierend	CHF	79.867	CHF	87.585	CHF			80.411
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.493		7.007				6.614
NIW je Anteil	CHF	12,30	CHF	12,50	CHF			12,16
Class E EUR (Currency Exposure):								
Erträge	€	3.251	€	4.671	€			3.274
ausgegebene und umlaufende Anteile		307		441				298
NIW je Anteil	€	10,60	€	10,58	€			10,98
Class E EUR (Hedged):								
thesaurierend	€	665.380	€	767.585	€			557.675
ausgegebene und umlaufende Anteile		37.066		42.129				31.558
NIW je Anteil	€	17,95	€	18,22	€			17,67
Erträge	€	305.642	€	354.267	€			338.331
ausgegebene und umlaufende Anteile		29.324		33.181				32.043
NIW je Anteil	€	10,42	€	10,68	€			10,56
Class E GBP (Hedged):								
Erträge	£	39.070	£	44.366	£			35.812
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.778		3.090				2.533
NIW je Anteil	£	14,07	£	14,36	£			14,14
Class E SGD (Hedged):								
Erträge	SGD	50.403	SGD	84.734	SGD			60.535
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.601		7.583				5.546
NIW je Anteil	SGD	10,95	SGD	11,17	SGD			10,91
H Institutional:								
thesaurierend	\$	189.669	\$	358.146	\$			250.517
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.193		15.358				11.360
NIW je Anteil	\$	23,15	\$	23,32	\$			22,05
Erträge	\$	12.278	\$	12.263	\$			13.253
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.136		1.113				1.237
NIW je Anteil	\$	10,80	\$	11,02	\$			10,72
H Institutional (Currency Exposure):								
thesaurierend	\$	3.030		k. A.				k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		301		k. A.				k. A.
NIW je Anteil	\$	10,08		k. A.				k. A.

	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)			Global Investment Grade Credit ESG Fund		
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
M Retail:						
Erträge	\$ 57.226	\$ 120.020	\$ 47.465			
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.208	10.705	4.359			
NIW je Anteil	\$ 10,99	\$ 11,21	\$ 10,89			
ausschüttend II	\$ 135.680	\$ 189.177	\$ 179.652			
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.359	18.129	17.488			
NIW je Anteil	\$ 10,16	\$ 10,43	\$ 10,27			
M Retail HKD (Unhedged):						
Erträge	HKD 15.628	HKD 56.230	HKD 39.119			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.490	5.264	3.752			
NIW je Anteil	HKD 10,49	HKD 10,68	HKD 10,43			
Class R:						
thesaurierend	\$ 33.031	\$ 38.196	\$ 21.767			
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.335	2.679	1.613			
NIW je Anteil	\$ 14,15	\$ 14,26	\$ 13,49			
Erträge	\$ 8.791	\$ 8.289	\$ 6.147			
ausgegebene und umlaufende Anteile	807	746	569			
NIW je Anteil	\$ 10,89	\$ 11,11	\$ 10,80			
Class R EUR (Hedged):						
Erträge	€ 8.207	€ 9.645	€ 14.283			
ausgegebene und umlaufende Anteile	844	968	1.449			
NIW je Anteil	€ 9,73	€ 9,97	€ 9,86			
Class R GBP (Hedged):						
Erträge	£ 16.921	£ 26.041	£ 26.341			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.648	2.485	2.552			
NIW je Anteil	£ 10,27	£ 10,48	£ 10,32			
Class T:						
thesaurierend	\$ 54.710	\$ 61.567	\$ 42.758			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.384	4.870	3.536			
NIW je Anteil	\$ 12,48	\$ 12,64	\$ 12,09			
Class T EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 6.062	€ 7.585	€ 6.704			
ausgegebene und umlaufende Anteile	544	669	607			
NIW je Anteil	€ 11,15	€ 11,34	€ 11,04			
Class W:						
thesaurierend	\$ 87.742	\$ 70.586	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.557	6.843	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 10,25	\$ 10,32	k. A.			
Erträge	\$ 42.454	\$ 30.591	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.242	2.996	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 10,01	\$ 10,21	k. A.			
Class W CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 35.935	CHF 36.879	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.539	3.592	k. A.			
NIW je Anteil	CHF 10,15	CHF 10,27	k. A.			
Class W EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 187.355	€ 14.050	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.413	1.367	k. A.			
NIW je Anteil	€ 10,17	€ 10,28	k. A.			
Erträge	€ 4.187	€ 4.089	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	422	402	k. A.			
NIW je Anteil	€ 9,93	€ 10,17	k. A.			
Class W GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 519	£ 8	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	51	1	k. A.			
NIW je Anteil	£ 10,23	£ 10,30	k. A.			
Erträge	£ 20.202	£ 15.521	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.021	1.521	k. A.			
NIW je Anteil	£ 9,99	£ 10,20	k. A.			
Class W SGD (Hedged):						
Erträge	SGD 827	SGD 14	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	83	1	k. A.			
NIW je Anteil	SGD 10,00	SGD 10,20	k. A.			
Nettovermögen	\$ 602.297	\$ 332.010	\$ 83.800			
Institutional:						
thesaurierend	\$ 39.083	\$ 42.254	\$ 13.910			
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.201	3.426	1.229			
NIW je Anteil	\$ 12,21	\$ 12,33	\$ 11,32			
Erträge	\$ 28.956	\$ 29.531	\$ 15.584			
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.699	2.706	1.527			
NIW je Anteil	\$ 10,73	\$ 10,91	\$ 10,21			
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 50.734	CHF 54.442	CHF 38.205			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.453	4.707	3.526			
NIW je Anteil	CHF 11,39	CHF 11,57	CHF 10,84			
Erträge	CHF 749	CHF 200	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	75	19	k. A.			
NIW je Anteil	CHF 10,01	CHF 10,24	k. A.			
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 117.038	€ 49.683	€ 2.069			
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.166	4.257	190			
NIW je Anteil	€ 11,51	€ 11,67	€ 10,90			
Erträge	€ 92.129	€ 23.021	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.166	2.243	k. A.			
NIW je Anteil	€ 10,05	€ 10,26	k. A.			
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 20.224	£ 15.049	£ 4.681			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.717	1.264	423			
NIW je Anteil	£ 11,78	£ 11,90	£ 11,06			
Erträge	£ 60.098	£ 10.023	£ 8			
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.582	915	1			
NIW je Anteil	£ 10,77	£ 10,96	£ 10,37			
Investor:						
thesaurierend	\$ 10	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 10,11	k. A.	k. A.			
Administrative SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK 791.960	SEK 349.070	SEK 2.498			
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.539	3.274	25			
NIW je Anteil	SEK 105,06	SEK 106,61	SEK 99,92			
Class E:						
thesaurierend	\$ 4.440	\$ 10.591	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	430	1.011	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 10,32	\$ 10,47	k. A.			
Erträge	\$ 1.309	\$ 3.531	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	128	339	k. A.			
NIW je Anteil	\$ 10,23	\$ 10,40	k. A.			
Class E CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 2.090	CHF 1.953	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	207	189	k. A.			
NIW je Anteil	CHF 10,11	CHF 10,31	k. A.			
Erträge	CHF 30	CHF 31	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	3	3	k. A.			
NIW je Anteil	CHF 10,01	CHF 10,23	k. A.			
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 8.723	€ 6.631	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	860	642	k. A.			
NIW je Anteil	€ 10,14	€ 10,33	k. A.			
Erträge	€ 874	€ 561	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	87	55	k. A.			
NIW je Anteil	€ 10,04	€ 10,25	k. A.			
Class E GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 563	£ 532	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	55	51	k. A.			
NIW je Anteil	£ 10,21	£ 10,37	k. A.			

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	
Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)				
Erträge	£ 112	£ 114		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	11	11		k. A.
NIW je Anteil	£ 10,11	£ 10,29		k. A.
Class Z:				
thesaurierend	\$ 6.578	\$ 6.627	\$ 6.050	
ausgegebene und umlaufende Anteile	580	580	580	
NIW je Anteil	\$ 11,34	\$ 11,43	\$ 10,43	
Nettovermögen	\$ 3.217.616	\$ 2.644.601	\$ 2.011.215	
Institutional:				
thesaurierend	\$ 118.411	\$ 96.148	\$ 128.959	
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.937	8.110	11.272	
NIW je Anteil	\$ 11,92	\$ 11,86	\$ 11,44	
Erträge	\$ 41.933	\$ 8.606	\$ 19.181	
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.044	830	1.887	
NIW je Anteil	\$ 10,37	\$ 10,37	\$ 10,16	
Institutional EUR (Hedged):				
thesaurierend	€ 65.145	€ 54.549	€ 60.186	
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.093	5.108	5.756	
NIW je Anteil	€ 10,69	€ 10,68	€ 10,46	
Erträge	€ 12.271	€ 27.239	€ 34.069	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.265	2.796	3.519	
NIW je Anteil	€ 9,70	€ 9,74	€ 9,68	
Institutional GBP (Hedged):				
thesaurierend	£ 1.603.315	£ 1.417.923	£ 1.017.469	
ausgegebene und umlaufende Anteile	142.596	126.639	93.369	
NIW je Anteil	£ 11,24	£ 11,20	£ 10,90	
Erträge	£ 528.999	£ 352.374	£ 292.330	
ausgegebene und umlaufende Anteile	52.206	34.734	29.090	
NIW je Anteil	£ 10,13	£ 10,14	£ 10,05	
Investor EUR (Hedged):				
thesaurierend	€ 11.524	€ 10.572	€ 13.093	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.130	1.036	1.306	
NIW je Anteil	€ 10,19	€ 10,20	€ 10,02	
Class E EUR (Hedged):				
thesaurierend	€ 5.155	€ 5.666	€ 6.610	
ausgegebene und umlaufende Anteile	516	566	669	
NIW je Anteil	€ 9,99	€ 10,01	€ 9,87	
Nettovermögen	\$ 1.054.078	\$ 787.871	\$ 997.469	
Global Low Duration Real Return Fund				
Institutional:				
thesaurierend	\$ 144.150	\$ 121.782	\$ 116.913	
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.314	10.630	10.727	
NIW je Anteil	\$ 11,71	\$ 11,46	\$ 10,90	
Institutional CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF 31.898	CHF 10.894	CHF 8.710	
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.159	1.097	905	
NIW je Anteil	CHF 10,10	CHF 9,93	CHF 9,62	
Institutional EUR (Hedged):				
thesaurierend	€ 460.056	€ 360.889	€ 448.568	
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.112	35.221	45.314	
NIW je Anteil	€ 10,43	€ 10,25	€ 9,90	
Erträge	€ 49.853	€ 39.196	€ 36.978	
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.076	4.002	3.887	
NIW je Anteil	€ 9,82	€ 9,79	€ 9,51	
ausschüttend II	k. A.	k. A.	€ 2.476	
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	270	
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,19	

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	
Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)				
Institutional GBP (Hedged):				
thesaurierend	£ 58.386	£ 32.234	£ 26.840	
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.367	3.025	2.623	
NIW je Anteil	£ 10,88	£ 10,66	£ 10,23	
Erträge	£ 46.902	£ 31.115	£ 139.626	
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.628	3.085	14.245	
NIW je Anteil	£ 10,13	£ 10,09	£ 9,80	
Investor:				
thesaurierend	\$ 4.381	\$ 3.787	\$ 4.758	
ausgegebene und umlaufende Anteile	384	339	446	
NIW je Anteil	\$ 11,39	\$ 11,17	\$ 10,66	
Class E:				
thesaurierend	\$ 19.188	\$ 15.858	\$ 20.685	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.751	1.472	2.001	
NIW je Anteil	\$ 10,96	\$ 10,77	\$ 10,34	
Class E EUR (Hedged):				
thesaurierend	€ 85.757	€ 47.404	€ 69.298	
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.789	4.923	7.383	
NIW je Anteil	€ 9,76	€ 9,63	€ 9,39	
Nettovermögen	\$ 3.225.770	\$ 2.578.062	\$ 1.831.308	
Global Real Return Fund				
Institutional:				
thesaurierend	\$ 353.361	\$ 220.950	\$ 331.343	
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.388	9.004	15.014	
NIW je Anteil	\$ 24,56	\$ 24,54	\$ 22,07	
Erträge	\$ 23.136	\$ 26.256	\$ 19.087	
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.202	1.349	1.090	
NIW je Anteil	\$ 19,25	\$ 19,47	\$ 17,51	
Institutional (Currency Exposure):				
thesaurierend	\$ 88.372	\$ 84.232	\$ 95.348	
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.383	7.004	9.013	
NIW je Anteil	\$ 11,97	\$ 12,03	\$ 10,58	
Institutional CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF 59.015	CHF 52.289	CHF 42.699	
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.816	3.366	2.992	
NIW je Anteil	CHF 15,47	CHF 15,53	CHF 14,27	
Erträge	CHF 38.230	CHF 36.335	CHF 33.787	
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.452	3.228	3.267	
NIW je Anteil	CHF 11,07	CHF 11,26	CHF 10,34	
Institutional EUR (Hedged):				
thesaurierend	€ 898.757	€ 796.538	€ 383.637	
ausgegebene und umlaufende Anteile	42.493	37.555	19.745	
NIW je Anteil	€ 21,15	€ 21,21	€ 19,43	
Erträge	€ 153.606	€ 152.140	€ 104.389	
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.422	9.195	6.885	
NIW je Anteil	€ 16,30	€ 16,55	€ 15,16	
Institutional GBP (Hedged):				
thesaurierend	£ 40.115	£ 33.719	£ 5.031	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.954	2.484	406	
NIW je Anteil	£ 13,58	£ 13,57	£ 12,38	
Erträge	£ 267.370	£ 83.894	£ 82.056	
ausgegebene und umlaufende Anteile	26.204	8.128	8.716	
NIW je Anteil	£ 10,20	£ 10,32	£ 9,41	
Institutional SGD (Hedged):				
thesaurierend	SGD 293.079	SGD 157.065	SGD 142.723	
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.276	8.732	8.778	
NIW je Anteil	SGD 18,01	SGD 17,99	SGD 16,26	
Investor:				
thesaurierend	\$ 69.107	\$ 70.699	\$ 40.511	
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.995	3.062	1.944	
NIW je Anteil	\$ 23,07	\$ 23,09	\$ 20,84	

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Global Real Return Fund (Fortsetzung)			
Erträge	\$ 18.743	\$ 21.532	\$ 4.727
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.117	1.269	309
NIW je Anteil	\$ 16,79	\$ 16,97	\$ 15,32
Investor CHF (Hedged):			
Erträge	CHF 3.969	CHF 4.219	CHF 3.529
ausgegebene und umlaufende Anteile	285	298	270
NIW je Anteil	CHF 13,94	CHF 14,17	CHF 13,06
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 31.732	€ 15.265	€ 7.172
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.593	763	390
NIW je Anteil	€ 19,93	€ 20,02	€ 18,40
Erträge	k. A.	k. A.	€ 3.662
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	264
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 13,89
Administrative:			
thesaurierend	\$ 60.460	\$ 61.037	\$ 61.985
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.673	2.694	3.028
NIW je Anteil	\$ 22,62	\$ 22,65	\$ 20,47
Class E:			
thesaurierend	\$ 171.901	\$ 157.612	\$ 114.663
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.047	7.352	5.894
NIW je Anteil	\$ 21,36	\$ 21,44	\$ 19,45
Erträge	\$ 30.491	\$ 31.022	\$ 22.565
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.886	1.898	1.521
NIW je Anteil	\$ 16,17	\$ 16,35	\$ 14,83
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 247.389	€ 217.762	€ 180.930
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.433	11.740	10.552
NIW je Anteil	€ 18,42	€ 18,55	€ 17,15
Class E GBP (Hedged):			
Erträge	£ 2.947	£ 2.597	£ 2.708
ausgegebene und umlaufende Anteile	196	171	194
NIW je Anteil	£ 15,01	£ 15,19	£ 13,98
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 50.476	\$ 49.942	\$ 47.466
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.114	2.092	2.207
NIW je Anteil	\$ 23,87	\$ 23,87	\$ 21,50
Class R:			
thesaurierend	\$ 5.132	\$ 1.921	\$ 3.385
ausgegebene und umlaufende Anteile	379	142	277
NIW je Anteil	\$ 13,54	\$ 13,54	\$ 12,22
Class R EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 439
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	40
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 11,04
Class R GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 13.903	£ 13.745	£ 14.298
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.082	1.069	1.216
NIW je Anteil	£ 12,84	£ 12,86	£ 11,75

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Income Fund			
Nettovermögen	\$ 71.882.534	\$ 71.275.311	\$ 81.080.459
Institutional:			
thesaurierend	\$ 10.823.919	\$ 10.051.322	\$ 10.274.248
ausgegebene und umlaufende Anteile	637.527	603.562	657.349
NIW je Anteil	\$ 16,98	\$ 16,65	\$ 15,63
Erträge	\$ 5.151.408	\$ 4.407.646	\$ 4.154.310
ausgegebene und umlaufende Anteile	423.794	362.996	350.902
NIW je Anteil	\$ 12,16	\$ 12,14	\$ 11,84
Institutional AUD (Hedged):			
thesaurierend	AUD 89.521	AUD 88.881	AUD 86.932
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.753	7.836	8.043
NIW je Anteil	AUD 11,55	AUD 11,34	AUD 10,81
Institutional BRL (Hedged):			
thesaurierend	\$ 638.037	\$ 601.491	\$ 650.135
ausgegebene und umlaufende Anteile	46.189	46.272	41.616
NIW je Anteil	\$ 13,81	\$ 13,00	\$ 15,62
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 116.035	CAD 111.995	CAD 202.736
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.776	8.629	16.527
NIW je Anteil	CAD 13,22	CAD 12,98	CAD 12,27
Erträge	CAD 137.814	CAD 127.606	CAD 27.082
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.072	12.097	2.611
NIW je Anteil	CAD 10,54	CAD 10,55	CAD 10,37
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 300.700	CHF 273.775	CHF 247.807
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.428	22.558	21.298
NIW je Anteil	CHF 12,31	CHF 12,14	CHF 11,64
Erträge	CHF 167.872	CHF 183.521	CHF 186.768
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.797	19.319	19.631
NIW je Anteil	CHF 9,43	CHF 9,50	CHF 9,51
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 5.739.022	€ 6.723.610	€ 11.208.799
ausgegebene und umlaufende Anteile	381.614	453.932	791.100
NIW je Anteil	€ 15,04	€ 14,81	€ 14,17
Erträge	€ 1.123.903	€ 963.725	€ 1.328.901
ausgegebene und umlaufende Anteile	106.211	90.563	125.057
NIW je Anteil	€ 10,58	€ 10,64	€ 10,63
ausschüttend II	€ 28.819	€ 58.118	€ 50.579
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.835	5.750	5.128
NIW je Anteil	€ 10,17	€ 10,11	€ 9,86
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 149.600	£ 13.809	£ 14.412
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.313	1.252	1.371
NIW je Anteil	£ 11,24	£ 11,03	£ 10,51
Erträge	£ 448.290	£ 426.938	£ 450.893
ausgegebene und umlaufende Anteile	42.452	40.380	42.958
NIW je Anteil	£ 10,56	£ 10,57	£ 10,50
Institutional HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 766.273	HKD 796.572	HKD 2.433.757
ausgegebene und umlaufende Anteile	69.350	72.285	225.353
NIW je Anteil	HKD 11,05	HKD 11,02	HKD 10,80

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Income Fund (Forts.)			Income Fund (Forts.)		
	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Institutional JPY (Hedged):						
thesaurierend	¥ 178.785	¥ 198.303	¥ 2.345.707			
ausgegebene und umlaufende Anteile	161	181	2.251			
NIW je Anteil	¥ 1.113,00	¥ 1.093,00	¥ 1.042,00			
Institutional NOK (Hedged):						
thesaurierend	NOK 2.146.472	NOK 2.157.697	NOK 1.414.575			
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.239	18.680	12.812			
NIW je Anteil	NOK 117,68	NOK 115,51	NOK 110,41			
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD 20.456	SGD 2.335	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.870	218	k. A.			
NIW je Anteil	SGD 10,94	SGD 10,73	k. A.			
Erträge	SGD 304.693	SGD 271.784	SGD 272.041			
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.781	24.806	25.298			
NIW je Anteil	SGD 10,97	SGD 10,96	SGD 10,75			
Investor:						
thesaurierend	\$ 2.515.149	\$ 2.037.337	\$ 2.178.061			
ausgegebene und umlaufende Anteile	181.318	149.476	169.670			
NIW je Anteil	\$ 13,87	\$ 13,63	\$ 12,84			
Erträge	\$ 1.522.757	\$ 1.314.008	\$ 1.361.908			
ausgegebene und umlaufende Anteile	141.119	121.625	128.692			
NIW je Anteil	\$ 10,79	\$ 10,80	\$ 10,58			
Investor AUD (Hedged):						
Erträge	AUD 49.060	AUD 52.351	AUD 34.618			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.808	5.112	3.394			
NIW je Anteil	AUD 10,20	AUD 10,24	AUD 10,20			
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 1.012.786	€ 1.450.102	€ 2.476.697			
ausgegebene und umlaufende Anteile	84.404	122.489	217.946			
NIW je Anteil	€ 12,00	€ 11,84	€ 11,36			
Erträge	€ 109.736	€ 60.870	€ 56.952			
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.807	6.496	6.055			
NIW je Anteil	€ 9,29	€ 9,37	€ 9,41			
ausschüttend A	€ 39.835	€ 40.130	€ 43.870			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.071	4.156	4.534			
NIW je Anteil	€ 9,79	€ 9,66	€ 9,68			
Investor GBP (Hedged):						
Erträge	£ 5.054	£ 3.920	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	504	390	k. A.			
NIW je Anteil	£ 10,02	£ 10,04	k. A.			
Investor RMB (Hedged):						
thesaurierend	CNH 276.263	CNH 252.069	CNH 172.423			
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.252	2.117	1.558			
NIW je Anteil	CNH 122,65	CNH 119,09	CNH 110,67			
Investor SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD 353	SGD 127	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	33	12	k. A.			
NIW je Anteil	SGD 10,65	SGD 10,47	k. A.			
Erträge	SGD 63.820	SGD 37.559	SGD 44.534			
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.179	3.630	4.362			
NIW je Anteil	SGD 10,33	SGD 10,35	SGD 10,21			
Administrative:						
thesaurierend	\$ 747.557	\$ 631.493	\$ 604.794			
ausgegebene und umlaufende Anteile	60.694	52.139	52.938			
NIW je Anteil	\$ 12,32	\$ 12,11	\$ 11,42			
Erträge	\$ 3.457.105	\$ 3.418.694	\$ 3.727.673			
ausgegebene und umlaufende Anteile	299.085	295.096	327.828			
NIW je Anteil	\$ 11,56	\$ 11,59	\$ 11,37			
Administrative AUD (Hedged):						
Erträge	AUD 331.037	AUD 355.413	AUD 422.890			
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.580	33.782	40.349			
NIW je Anteil	AUD 10,48	AUD 10,52	AUD 10,48			
Administrative EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 183.128	€ 242.607	€ 264.971			
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.318	20.554	23.357			
NIW je Anteil	€ 11,95	€ 11,80	€ 11,34			
Erträge	€ 294.871	€ 331.791	€ 648.757			
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.227	34.844	67.857			
NIW je Anteil	€ 9,44	€ 9,52	€ 9,56			
Administrative GBP (Hedged):						
Erträge	£ 144.212	£ 139.212	£ 184.255			
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.802	14.220	18.829			
NIW je Anteil	£ 9,74	£ 9,79	£ 9,79			
Administrative HKD (Unhedged):						
Erträge	HKD 3.545.760	HKD 3.245.289	HKD 9.032.134			
ausgegebene und umlaufende Anteile	346.763	316.993	893.555			
NIW je Anteil	HKD 10,23	HKD 10,24	HKD 10,11			
Administrative SGD (Hedged):						
Erträge	SGD 1.066.990	SGD 1.038.592	SGD 1.241.938			
ausgegebene und umlaufende Anteile	93.457	90.748	109.801			
NIW je Anteil	SGD 11,42	SGD 11,44	SGD 11,31			
Class E:						
thesaurierend	\$ 5.992.527	\$ 5.774.107	\$ 6.190.628			
ausgegebene und umlaufende Anteile	381.005	372.607	421.830			
NIW je Anteil	\$ 15,73	\$ 15,50	\$ 14,68			
Erträge	\$ 8.223.362	\$ 7.968.268	\$ 8.505.996			
ausgegebene und umlaufende Anteile	740.656	714.149	772.583			
NIW je Anteil	\$ 11,10	\$ 11,16	\$ 11,01			
Ausschüttend Q	\$ 1.738	\$ 1.841	\$ 10			
ausgegebene und umlaufende Anteile	171	180	1			
NIW je Anteil	\$ 10,19	\$ 10,24	\$ 10,11			
Class E AUD (Hedged):						
Erträge	AUD 677.141	AUD 688.828	AUD 758.955			
ausgegebene und umlaufende Anteile	68.243	68.955	75.801			
NIW je Anteil	AUD 9,92	AUD 9,99	AUD 10,01			
Class E CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 100.671	CHF 98.769	CHF 98.300			
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.402	8.323	8.564			
NIW je Anteil	CHF 11,98	CHF 11,87	CHF 11,48			
Erträge	CHF 129.016	CHF 141.703	CHF 141.403			
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.714	15.949	15.701			
NIW je Anteil	CHF 8,77	CHF 8,88	CHF 9,01			

	Zum		Zum		Zum		
	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Income Fund (Forts.)							
Class E EUR (Hedged):							
thesaurierend	€	4.888.503	€	4.783.315	€	5.255.899	
ausgegebene und umlaufende Anteile		351.216		347.362		395.456	
NIW je Anteil	€	13,92	€	13,77	€	13,29	
Erträge	€	4.618.690	€	4.900.988	€	6.301.943	
ausgegebene und umlaufende Anteile		477.638		500.834		637.026	
NIW je Anteil	€	9,67	€	9,79	€	9,89	
ausschüttend II	€	127.767	€	128.995	€	123.289	
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.344		12.476		12.107	
NIW je Anteil	€	10,35	€	10,34	€	10,18	
Ausschüttend II Q	€	46.697	€	35.195	€	10	
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.555		3.436		1	
NIW je Anteil	€	10,25	€	10,24	€	10,09	
Class E GBP (Hedged):							
Erträge	£	243.665	£	254.166	£	286.589	
ausgegebene und umlaufende Anteile		25.726		26.639		29.898	
NIW je Anteil	£	9,47	£	9,54	£	9,59	
Class E HKD (Unhedged):							
Erträge	HKD	4.790.513	HKD	5.569.457	HKD	10.267.660	
ausgegebene und umlaufende Anteile		460.904		534.050		992.891	
NIW je Anteil	HKD	10,39	HKD	10,43	HKD	10,34	
Class E JPY (Hedged):							
thesaurierend	¥	846.721	¥	2.647.085	¥	1.145.115	
ausgegebene und umlaufende Anteile		788		2.495		1.123	
NIW je Anteil	¥	1.075,00	¥	1.061,00	¥	1.020,00	
Class E RMB (Hedged):							
Erträge	CNH	634.346	CNH	593.183	CNH	481.871	
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.095		4.815		4.045	
NIW je Anteil	CNH	124,51	CNH	123,20	CNH	119,14	
Class E SGD (Hedged):							
Erträge	SGD	2.686.994	SGD	2.701.956	SGD	3.073.114	
ausgegebene und umlaufende Anteile		263.806		263.912		302.107	
NIW je Anteil	SGD	10,19	SGD	10,24	SGD	10,17	
G Retail EUR (Hedged):							
Erträge	€	31.856	€	35.845	€	38.008	
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.342		3.801		4.009	
NIW je Anteil	€	9,53	€	9,43	€	9,48	
G Retail EUR (Unhedged):							
Erträge	€	120	€	275	€	214	
ausgegebene und umlaufende Anteile		12		29		21	
NIW je Anteil	€	10,00	€	9,55	€	10,19	
H Institutional:							
thesaurierend	\$	682.724	\$	562.857	\$	365.987	
ausgegebene und umlaufende Anteile		57.303		48.123		33.279	
NIW je Anteil	\$	11,91	\$	11,70	\$	11,00	
Erträge	\$	338.810	\$	299.508	\$	102.256	
ausgegebene und umlaufende Anteile		32.114		28.375		9.904	
NIW je Anteil	\$	10,55	\$	10,56	\$	10,33	
H Institutional EUR (Hedged):							
thesaurierend	€	7.985	€	2.672	€	6.121	
ausgegebene und umlaufende Anteile		723		245		587	
NIW je Anteil	€	11,05	€	10,89	€	10,43	
Class R:							
thesaurierend	\$	41.938	\$	31.223	\$	460	
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.815		2.892		45	
NIW je Anteil	\$	10,99	\$	10,80	\$	10,16	
Erträge	\$	72.008	\$	70.869	\$	79.288	
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.758		6.645		7.596	
NIW je Anteil	\$	10,66	\$	10,66	\$	10,44	
Class R EUR (Hedged):							
Erträge	€	15.001	€	14.929	€	12.104	
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.531		1.514		1.228	
NIW je Anteil	€	9,80	€	9,86	€	9,86	
Class R GBP (Hedged):							
Erträge	£	29.406	£	31.954	£	47.760	
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.656		2.878		4.319	
NIW je Anteil	£	11,07	£	11,10	£	11,06	
Class T:							
thesaurierend	\$	369.527	\$	359.667	\$	320.094	
ausgegebene und umlaufende Anteile		28.450		28.049		26.253	
NIW je Anteil	\$	12,99	\$	12,82	\$	12,19	
Erträge	\$	126.924	\$	131.492	\$	123.053	
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.879		13.244		12.498	
NIW je Anteil	\$	9,85	\$	9,93	\$	9,85	
Class T EUR (Hedged):							
thesaurierend	€	270.425	€	280.339	€	337.746	
ausgegebene und umlaufende Anteile		23.387		24.457		30.407	
NIW je Anteil	€	11,56	€	11,46	€	11,11	
Erträge	€	234.242	€	252.475	€	288.304	
ausgegebene und umlaufende Anteile		27.144		28.837		32.410	
NIW je Anteil	€	8,63	€	8,76	€	8,90	
Class Z:							
thesaurierend	\$	108.829	\$	110.891	\$	191.604	
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.121		6.376		11.803	
NIW je Anteil	\$	17,78	\$	17,39	\$	16,23	
Class Z AUD (Hedged):							
ausschüttend II	AUD	1.225.459	AUD	1.115.008	AUD	1.007.912	
ausgegebene und umlaufende Anteile		107.851		98.412		90.457	
NIW je Anteil	AUD	11,36	AUD	11,33	AUD	11,14	
Income Fund II							
Nettovermögen	\$	25.319	k. A.		k. A.		
Institutional:							
thesaurierend	\$	24.301	k. A.		k. A.		
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.397	k. A.		k. A.		
NIW je Anteil	\$	10,14	k. A.		k. A.		
Erträge	\$	10	k. A.		k. A.		
ausgegebene und umlaufende Anteile		1	k. A.		k. A.		
NIW je Anteil	\$	10,06	k. A.		k. A.		
Class E:							
Erträge	\$	10	k. A.		k. A.		
ausgegebene und umlaufende Anteile		1	k. A.		k. A.		
NIW je Anteil	\$	10,05	k. A.		k. A.		

	Zum 30. Jun. 2021		Zum 31. Dez. 2020		Zum 31. Dez. 2019	
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)						
Erträge	€	838		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		84		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	€	9,99		k. A.		k. A.
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£	23.089	£	20.287	£	11.603
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.987		1.754		1.030
NIW je Anteil	£	11,62	£	11,57	£	11,27
Erträge	£	16.195		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.621		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	£	9,99		k. A.		k. A.
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend	NOK	420.271	NOK	416.606	NOK	534.600
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.877		3.864		5.092
NIW je Anteil	NOK	108,39	NOK	107,82	NOK	105,00
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€	24.352	€	20.641	€	14.939
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.380		2.011		1.469
NIW je Anteil	€	10,23	€	10,26	€	10,17
Low Duration Income Fund						
Nettovermögen	\$	1.075.514	\$	960.639	\$	478.805
Institutional:						
thesaurierend	\$	54.686	\$	6.730	\$	12.220
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.852		607		1.137
NIW je Anteil	\$	11,27	\$	11,08	\$	10,74
Erträge	\$	7.864	\$	2.025	\$	2.474
ausgegebene und umlaufende Anteile		759		196		242
NIW je Anteil	\$	10,35	\$	10,31	\$	10,24
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF	405	CHF	401	CHF	222
ausgegebene und umlaufende Anteile		39		39		22
NIW je Anteil	CHF	10,44	CHF	10,32	CHF	10,19
Erträge	CHF	10	CHF	10	CHF	10
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	CHF	9,58	CHF	9,58	CHF	9,71
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€	666.007	€	605.043	€	316.084
ausgegebene und umlaufende Anteile		63.126		58.084		30.811
NIW je Anteil	€	10,55	€	10,42	€	10,26
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£	2.395	£	150.468	£	78.399
ausgegebene und umlaufende Anteile		221		14.121		7.507
NIW je Anteil	£	10,83	£	10,66	£	10,44
Erträge	£	142.445	£	8	£	8
ausgegebene und umlaufende Anteile		14.407		1		1
NIW je Anteil	£	9,89	£	9,86	£	9,95
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend	SGD	12.729	SGD	589		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.214		57		k. A.
NIW je Anteil	SGD	10,48	SGD	10,30		k. A.
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€	9	€	9	€	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	€	10,43	€	10,32	€	10,20
Erträge	€	9	€	9	€	9
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	€	9,60	€	9,62	€	9,76
Class E: thesaurierend	\$	4.544	\$	1.386	\$	2.778
ausgegebene und umlaufende Anteile		414		128		262
NIW je Anteil	\$	10,99	\$	10,85	\$	10,61

	Zum 30. Jun. 2021		Zum 31. Dez. 2020		Zum 31. Dez. 2019	
Low Duration Income Fund (Forts.)						
Erträge	\$	4.111	\$	1.034	\$	11
ausgegebene und umlaufende Anteile		404		102		1
NIW je Anteil	\$	10,17	\$	10,17	\$	10,20
Class E CHF (Hedged): thesaurierend	CHF	10	CHF	10	CHF	10
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	CHF	10,18	CHF	10,10	CHF	10,06
Erträge	CHF	10	CHF	10	CHF	39
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		4
NIW je Anteil	CHF	9,41	CHF	9,46	CHF	9,68
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€	2.598	€	1.334	€	1.029
ausgegebene und umlaufende Anteile		253		131		102
NIW je Anteil	€	10,27	€	10,18	€	10,12
Erträge	€	680	€	265	€	651
ausgegebene und umlaufende Anteile		71		28		67
NIW je Anteil	€	9,51	€	9,55	€	9,74
Class E SGD (Hedged): Erträge	SGD	716	SGD	712	SGD	609
ausgegebene und umlaufende Anteile		71		71		60
NIW je Anteil	SGD	10,02	SGD	10,02	SGD	10,10
H Institutional: thesaurierend	\$	10	\$	10		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	\$	10,49	\$	10,33		k. A.
Class Z EUR (Hedged): thesaurierend	€	10	€	10		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	€	10,76	€	10,59		k. A.
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund						
Nettovermögen	\$	95.696	\$	77.631	\$	238.171
Institutional:						
thesaurierend	\$	20.196	\$	22.753	\$	59.992
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.488		4.069		7.854
NIW je Anteil	\$	8,12	\$	5,59	\$	7,64
Erträge	\$	34.871	\$	30.040	\$	98.963
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.499		7.885		17.085
NIW je Anteil	\$	5,37	\$	3,81	\$	5,79
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€	16.110	€	7.987	€	12.933
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.266		1.623		1.862
NIW je Anteil	€	7,11	€	4,92	€	6,95
Erträge	€	2.214	€	1.546	€	4.362
ausgegebene und umlaufende Anteile		471		461		828
NIW je Anteil	€	4,70	€	3,36	€	5,27
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£	1.414	£	961	£	18.221
ausgegebene und umlaufende Anteile		198		195		2.549
NIW je Anteil	£	7,13	£	4,93	£	7,15
Erträge	£	135	£	101	£	11.428
ausgegebene und umlaufende Anteile		29		30		2.113
NIW je Anteil	£	4,67	£	3,34	£	5,41
Investor: thesaurierend	\$	1.517	\$	1.179	\$	6.882
ausgegebene und umlaufende Anteile		149		168		717
NIW je Anteil	\$	10,15	\$	7,00	\$	9,60
Erträge	\$	10	\$	7	\$	10
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	\$	8,10	\$	5,76	\$	8,79

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Forts.)				Mortgage Opportunities Fund (Forts.)			
Investor EUR (Hedged):				Administrative:			
thesaurierend	€ 8	€ 24	€ 8	Erträge	\$ 544	\$ 544	\$ 832
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	4	1	ausgegebene und umlaufende Anteile	54	54	83
NIW je Anteil	€ 9,44	€ 6,55	€ 9,26	NIW je Anteil	\$ 10,05	\$ 10,06	\$ 9,97
Class E:				Class E:			
Erträge	\$ 6.939	\$ 4.830	\$ 6.631	thesaurierend	\$ 56.698	\$ 65.293	\$ 79.775
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.403	1.368	1.219	ausgegebene und umlaufende Anteile	5.065	5.878	7.409
NIW je Anteil	\$ 4,94	\$ 3,53	\$ 5,44	NIW je Anteil	\$ 11,19	\$ 11,11	\$ 10,77
ausschüttend II	k. A.	k. A.	\$ 19	Erträge	\$ 11.481	\$ 10.765	\$ 13.300
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	4	ausgegebene und umlaufende Anteile	1.142	1.070	1.333
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 5,43	NIW je Anteil	\$ 10,05	\$ 10,06	\$ 9,98
Class Z:				Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	\$ 8.283	\$ 5.677	\$ 6.975	Erträge	CHF 337	CHF 338	CHF 400
ausgegebene und umlaufende Anteile	818	818	743	ausgegebene und umlaufende Anteile	38	38	44
NIW je Anteil	\$ 10,13	\$ 6,94	\$ 9,39	NIW je Anteil	CHF 8,93	CHF 8,98	CHF 9,05
Mortgage Opportunities Fund				Class E EUR (Hedged):			
Nettovermögen	\$ 2.387.737	\$ 1.977.007	\$ 1.675.111	thesaurierend	€ 17.324	€ 18.176	€ 45.673
Institutional:				ausgegebene und umlaufende Anteile	1.698	1.788	4.571
thesaurierend	\$ 570.372	\$ 491.609	\$ 549.333	NIW je Anteil	€ 10,20	€ 10,16	€ 9,99
ausgegebene und umlaufende Anteile	49.006	42.776	49.738	Erträge	€ 140	€ 131	€ 417
NIW je Anteil	\$ 11,64	\$ 11,49	\$ 11,04	ausgegebene und umlaufende Anteile	15	14	45
Erträge	\$ 412.994	\$ 285.533	\$ 151.724	NIW je Anteil	€ 9,08	€ 9,13	€ 9,18
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.099	28.386	15.217	Class E SGD (Hedged):			
NIW je Anteil	\$ 10,05	\$ 10,06	\$ 9,97	thesaurierend	SGD 15	SGD 15	SGD 91
ausschüttend II	k. A.	k. A.	\$ 58	ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	9
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	6	NIW je Anteil	SGD 10,71	SGD 10,63	SGD 10,34
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 9,71	Erträge	SGD 1.797	SGD 2.135	SGD 6.455
Institutional BRL (Hedged):				ausgegebene und umlaufende Anteile	183	217	659
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 4.452	NIW je Anteil	SGD 9,84	SGD 9,85	SGD 9,80
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	475	H Institutional:			
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 9,39	thesaurierend	\$ 11	\$ 11	k. A.
Institutional CAD (Hedged):				ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
thesaurierend	CAD 25.450	k. A.	k. A.	NIW je Anteil	\$ 10,74	\$ 10,62	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.532	k. A.	k. A.	Class T EUR (Hedged):			
NIW je Anteil	CAD 10,05	k. A.	k. A.	thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 239
Institutional CHF (Hedged):				ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	25
thesaurierend	CHF 6.101	CHF 6.951	CHF 71.448	NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,64
ausgegebene und umlaufende Anteile	584	670	7.056	Class Z:			
NIW je Anteil	CHF 10,44	CHF 10,37	CHF 10,13	thesaurierend	\$ 89.533	\$ 74.635	\$ 107.101
Institutional EUR (Hedged):				ausgegebene und umlaufende Anteile	8.283	7.012	10.548,00
thesaurierend	€ 457.699	€ 330.507	€ 233.809	NIW je Anteil	\$ 10,81	\$ 10,64	\$ 10,15
ausgegebene und umlaufende Anteile	43.098	31.397	22.781	Class Z GBP (Hedged):			
NIW je Anteil	€ 10,62	€ 10,53	€ 10,26	thesaurierend	£ 379.944	£ 374.361	£ 236.415
Erträge	€ 12.591	€ 9.571	€ 9.443	ausgegebene und umlaufende Anteile	34.658	34.658	22.764
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.376	1.041	1.021	NIW je Anteil	£ 10,96	£ 10,80	£ 10,39
NIW je Anteil	€ 9,15	€ 9,20	€ 9,25	Nettovermögen	\$ 3.094.715	\$ 3.538.833	\$ 3.009.851
Institutional GBP (Hedged):				Institutional:			
thesaurierend	£ 21.137	£ 7.971	£ 9.428	thesaurierend	\$ 1.830.392	\$ 2.530.233	\$ 2.383.353
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.913	730	892	ausgegebene und umlaufende Anteile	33.881	53.956	60.249
NIW je Anteil	£ 11,05	£ 10,92	£ 10,58	NIW je Anteil	\$ 54,02	\$ 46,89	\$ 39,56
Erträge	£ 15.368	£ 11.380	£ 7.570	Erträge	\$ 37.066	\$ 45.032	\$ 40.271
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.612	1.192	793	ausgegebene und umlaufende Anteile	942	1.319	1.398
NIW je Anteil	£ 9,53	£ 9,55	£ 9,54	NIW je Anteil	\$ 39,33	\$ 34,14	\$ 28,80
Investor:				Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	\$ 49.330	\$ 49.987	\$ 20.774	thesaurierend	€ 617.838	€ 530.048	€ 173.309
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.394	4.499	1.939	ausgegebene und umlaufende Anteile	19.456	19.143	7.233
NIW je Anteil	\$ 11,23	\$ 11,11	\$ 10,71	NIW je Anteil	€ 31,76	€ 27,69	€ 23,96
Erträge	\$ 14.177	\$ 12.072	\$ 7.931	Erträge	€ 1.890	€ 1.636	€ 2.782
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.411	1.200	796	ausgegebene und umlaufende Anteile	68	68	133
NIW je Anteil	\$ 10,05	\$ 10,06	\$ 9,97	NIW je Anteil	€ 27,73	€ 24,18	€ 20,92

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
StocksPLUS™ Fund (Forts.)			
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 179	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	18	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,18	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 19.512	\$ 18.615	\$ 7.398
ausgegebene und umlaufende Anteile	390	428	201
NIW je Anteil	\$ 50,07	\$ 43,53	\$ 36,85
Class E:			
thesaurierend	\$ 125.567	\$ 91.242	\$ 107.429
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.652	2.210	3.057
NIW je Anteil	\$ 47,35	\$ 41,29	\$ 35,14
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 11.508	€ 9.527	€ 242.896
ausgegebene und umlaufende Anteile	707	668	19.514
NIW je Anteil	€ 16,28	€ 14,25	€ 12,45
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 330.947	\$ 189.133	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.468	16.101	k. A.
NIW je Anteil	\$ 13,53	\$ 11,75	k. A.
Class T:			
thesaurierend	\$ 2.401	\$ 2.380	\$ 1.087
ausgegebene und umlaufende Anteile	123	140	75
NIW je Anteil	\$ 19,49	\$ 17,03	\$ 14,55
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund			
Nettovermögen	\$ 10.485	\$ 8.417	\$ 5.977
Institutional:			
thesaurierend	\$ 9.796	\$ 8.021	\$ 5.965
ausgegebene und umlaufende Anteile	603	570	505
NIW je Anteil	\$ 16,23	\$ 14,09	\$ 11,82
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 358	€ 312	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	23	k. A.
NIW je Anteil	€ 15,50	€ 13,52	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 179	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	18	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,19	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 16	\$ 14	\$ 12
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 15,90	\$ 13,87	\$ 11,74
Strategic Income Fund			
Nettovermögen	\$ 775.477	\$ 974.664	\$ 1.169.920
Institutional:			
thesaurierend	\$ 35.085	\$ 35.112	\$ 37.366
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.943	3.118	3.465
NIW je Anteil	\$ 11,92	\$ 11,26	\$ 10,78
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 318.171	€ 453.622	€ 582.709
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.994	34.652	45.284
NIW je Anteil	€ 13,84	€ 13,09	€ 12,87
Class E:			
thesaurierend	\$ 34.686	\$ 33.128	\$ 40.379
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.425	2.441	3.080
NIW je Anteil	\$ 14,30	\$ 13,57	\$ 13,11
ausschüttend II	\$ 18.629	\$ 18.919	\$ 23.018
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.763	1.848	2.243
NIW je Anteil	\$ 10,57	\$ 10,24	\$ 10,26

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
Strategic Income Fund (Forts.)			
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 140.437	€ 143.937	€ 203.833
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.877	11.731	16.749
NIW je Anteil	€ 12,91	€ 12,27	€ 12,17
ausschüttend II	€ 96.477	€ 102.667	€ 131.846
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.115	11.093	13.850
NIW je Anteil	€ 9,54	€ 9,25	€ 9,52
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 16.453	€ 17.321	€ 24.620
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.419	1.569	2.240
NIW je Anteil	€ 11,59	€ 11,04	€ 10,99
Erträge	€ 7.834	€ 7.803	€ 9.472
ausgegebene und umlaufende Anteile	772	800	961
NIW je Anteil	€ 10,14	€ 9,76	€ 9,86
Total Return Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 5.394.969	\$ 6.424.053	\$ 5.139.388
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.633.337	\$ 1.930.542	\$ 1.630.580
ausgegebene und umlaufende Anteile	47.885	55.944	51.581
NIW je Anteil	\$ 34,11	\$ 34,51	\$ 31,61
Erträge	\$ 178.326	\$ 187.163	\$ 158.594
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.942	10.216	9.247
NIW je Anteil	\$ 17,94	\$ 18,32	\$ 17,15
Institutional CAD (Hedged):			
Erträge	CAD 30.406	CAD 26.735	CAD 25.530
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.903	2.497	2.540
NIW je Anteil	CAD 10,47	CAD 10,70	CAD 10,05
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 13.861	CHF 16.880	CHF 11.585
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.159	1.388	1.020
NIW je Anteil	CHF 11,96	CHF 12,16	CHF 11,35
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 404.398	€ 495.828	€ 333.231
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.208	20.771	15.002
NIW je Anteil	€ 23,50	€ 23,87	€ 22,21
Erträge	€ 217.536	€ 216.306	€ 183.599
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.772	14.322	12.786
NIW je Anteil	€ 14,73	€ 15,10	€ 14,36
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 16.290	€ 33.888	€ 17.973
ausgegebene und umlaufende Anteile	567	1.202	638
NIW je Anteil	€ 28,76	€ 28,20	€ 28,15
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 6.100	£ 9.730	£ 14.352
ausgegebene und umlaufende Anteile	417	658	1.049
NIW je Anteil	£ 14,62	£ 14,80	£ 13,68
Erträge	£ 37.813	£ 39.302	£ 36.454
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.719	3.783	3.713
NIW je Anteil	£ 10,17	£ 10,39	£ 9,82

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021		31. Dez. 2020		31. Dez. 2019	
Total Return Bond Fund (Forts.)						
Institutional ILS (Hedged):						
thesaurierend	ILS	185	ILS	578	ILS	2.518
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		13		39		186
NIW je Anteil	ILS	14,46	ILS	14,67	ILS	13,57
Institutional JPY (Hedged):						
thesaurierend		k. A.		k. A.	¥	310
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		k. A.		k. A.		0*
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	¥	1.079,00
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	19.646	SGD	19.222	SGD	16.668
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		1.364		1.320		1.245
NIW je Anteil	SGD	14,40	SGD	14,57	SGD	13,39
Investor:						
thesaurierend	\$	443.941	\$	573.009	\$	469.771
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		14.099		17.957		16.014
NIW je Anteil	\$	31,49	\$	31,91	\$	29,33
Erträge	\$	79.357	\$	129.625	\$	57.950
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		4.362		6.977		3.332
NIW je Anteil	\$	18,19	\$	18,58	\$	17,39
Investor CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	5.168	CHF	6.265	CHF	6.274
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		447		532		569
NIW je Anteil	CHF	11,56	CHF	11,77	CHF	11,02
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	22.570	€	27.120	€	28.221
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		1.017		1.201		1.339
NIW je Anteil	€	22,19	€	22,58	€	21,08
Investor GBP (Hedged):						
thesaurierend		k. A.		k. A.	£	1.430
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		k. A.		k. A.		117
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	£	12,26
Administrative:						
thesaurierend	\$	176.349	\$	188.750	\$	196.846
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		5.660		5.973		6.766
NIW je Anteil	\$	31,16	\$	31,60	\$	29,09
Administrative EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	2.481	€	3.742	€	2.224
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		187		277		177
NIW je Anteil	€	13,26	€	13,51	€	12,63
Class E:						
thesaurierend	\$	537.524	\$	676.175	\$	568.315
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		18.080		22.380		20.350
NIW je Anteil	\$	29,73	\$	30,21	\$	27,93
Erträge	\$	225.633	\$	243.049	\$	211.320
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		16.532		17.436		16.192
NIW je Anteil	\$	13,65	\$	13,94	\$	13,05
Class E CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	5.797	CHF	6.592	CHF	4.734
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		561		625		477
NIW je Anteil	CHF	10,33	CHF	10,55	CHF	9,93
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	709.708	€	833.038	€	784.034
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		34.621		39.827		39.922
NIW je Anteil	€	20,50	€	20,92	€	19,64
Erträge	€	62.276	€	74.430	€	77.397
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		6.343		7.393		8.085
NIW je Anteil	€	9,82	€	10,07	€	9,57
Class E EUR (Unhedged):						
thesaurierend	€	789		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		77		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	€	10,27		k. A.		k. A.

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021		31. Dez. 2020		31. Dez. 2019	
Total Return Bond Fund (Forts.)						
Class E HKD (Unhedged):						
thesaurierend	HKD	2.605	HKD	2.773	HKD	3.078
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		216		226		270
NIW je Anteil	HKD	12,08	HKD	12,26	HKD	11,39
Class E SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	41.309	SGD	42.772	SGD	37.932
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		950		968		925
NIW je Anteil	SGD	43,51	SGD	44,20	SGD	41,00
Erträge		k. A.		k. A.		SGD 1.169
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		k. A.		k. A.		114
NIW je Anteil		k. A.		k. A.		SGD 10,24
H Institutional:						
thesaurierend	\$	203.204	\$	205.400	\$	43.706
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		6.134		6.124		1.420
NIW je Anteil	\$	33,13	\$	33,54	\$	30,78
Erträge	\$	21.667	\$	15.468	\$	3.942
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		1.970		1.377		375
NIW je Anteil	\$	11,00	\$	11,23	\$	10,51
M Retail HKD (Unhedged):						
Erträge	HKD	91.827	HKD	96.768	HKD	98.502
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		8.552		8.838		9.562
NIW je Anteil	HKD	10,74	HKD	10,95	HKD	10,30
Class R:						
thesaurierend		k. A.		k. A.	\$	3.043
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		k. A.		k. A.		258
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	\$	11,78
Erträge		k. A.		k. A.	\$	2.922
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		k. A.		k. A.		286
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	\$	10,21
Class R EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	4.962	€	5.521	€	13.359
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		442		483		1.253
NIW je Anteil	€	11,24	€	11,43	€	10,66
Class T:						
thesaurierend	\$	11.175	\$	18.261	\$	5.837
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		950		1.525		526
NIW je Anteil	\$	11,77	\$	11,97	\$	11,10
Class T EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	4.993	€	6.041	€	2.369
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		473		560		233
NIW je Anteil	€	10,55	€	10,79	€	10,16
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund						
Nettovermögen	\$	75.453	\$	47.221	\$	25.717
Institutional:						
thesaurierend	\$	56.550	\$	24.193	\$	3.392
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		4.948		2.142		316
NIW je Anteil	\$	11,43	\$	11,30	\$	10,75
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend		k. A.		k. A.	CHF	90
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		k. A.		k. A.		9
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	CHF	9,58
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	12.679	€	12.591	€	6.134
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		1.236		1.236		625
NIW je Anteil	€	10,26	€	10,19	€	9,82
Erträge		k. A.		k. A.	€	1
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		k. A.		k. A.		0*
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	€	9,29
Institutional GBP (Hedged):						
Erträge		k. A.		k. A.	£	281
ausgegebene und umlaufende						
Anteile		k. A.		k. A.		29
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	£	9,78

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	31. Dez. 2020	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2019
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)						
Investor:						
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$		222	
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.			21	
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$		10,58	
Class E:						
thesaurierend	\$	2.579	\$	6.232	\$	4.907
ausgegebene und umlaufende Anteile		241		586		479
NIW je Anteil	\$	10,70	\$	10,63	\$	10,23
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	1.087	€	1.136	€	8.769
ausgegebene und umlaufende Anteile		113		118		938
NIW je Anteil	€	9,61	€	9,60	€	9,35
UK Corporate Bond Fund						
Nettvermögen	£	586.151	£	764.359	£	557.068
Institutional:						
thesaurierend	£	51.298	£	139.232	£	130.226
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.262		6.000		5.948
NIW je Anteil	£	22,68	£	23,20	£	21,89
Erträge	£	453.818	£	542.403	£	337.842
ausgegebene und umlaufende Anteile		42.294		49.002		31.617
NIW je Anteil	£	10,73	£	11,07	£	10,69
H Institutional:						
Erträge	£	9	£	9	£	8
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	£	9,97	£	10,28	£	9,90
Class R:						
thesaurierend	k. A.	k. A.	£		1.224	
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.			103	
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£		11,94	
Class Z:						
thesaurierend	£	81.026	£	82.715	£	87.768
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.715		7.715		8.715,00
NIW je Anteil	£	10,50	£	10,72	£	10,07
UK Long Term Corporate Bond Fund						
Nettvermögen	£	411.659	£	364.631	£	406.944
Institutional:						
thesaurierend	£	355.029	£	300.422	£	284.640
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.734		10.335		10.799
NIW je Anteil	£	27,88	£	29,07	£	26,36
Erträge	£	56.630	£	64.209	£	122.304
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.403		3.656		7.472
NIW je Anteil	£	16,64	£	17,56	£	16,37
US High Yield Bond Fund						
Nettvermögen	\$	4.248.280	\$	4.054.927	\$	2.798.116
Institutional:						
thesaurierend	\$	2.018.466	\$	2.254.396	\$	1.370.126
ausgegebene und umlaufende Anteile		50.025		57.680		36.947
NIW je Anteil	\$	40,35	\$	39,09	\$	37,08
Erträge	\$	398.913	\$	319.414	\$	230.319
ausgegebene und umlaufende Anteile		39.021		31.532		22.787
NIW je Anteil	\$	10,22	\$	10,13	\$	10,11
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	3.839	CHF	2.604	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		313		218		k. A.
NIW je Anteil	CHF	12,26	CHF	11,94	k. A.	

	Zum		Zum		Zum	
	30. Jun. 2021	31. Dez. 2020	31. Dez. 2020	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2019
US High Yield Bond Fund (Forts.)						
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	442.113	€	297.614	€	158.249
ausgegebene und umlaufende Anteile		14.006		9.695		5.321
NIW je Anteil	€	31,57	€	30,70	€	29,74
Erträge	€	136.230	€	126.166	€	223.796
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.363		10.575		18.418
NIW je Anteil	€	11,99	€	11,93	€	12,15
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	44.984	£	41.967	£	31.609
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.880		1.809		1.407
NIW je Anteil	£	23,93	£	23,20	£	22,46
Erträge	£	7.906	£	7.216	£	39.227
ausgegebene und umlaufende Anteile		795		731		3.903
NIW je Anteil	£	9,95	£	9,86	£	10,05
Investor:						
thesaurierend	\$	429.797	\$	307.813	\$	201.992
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.869		8.760		6.038
NIW je Anteil	\$	36,21	\$	35,14	\$	33,45
Erträge	\$	39.784	\$	31.926	\$	32.462
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.811		3.897		3.972
NIW je Anteil	\$	8,27	\$	8,19	\$	8,17
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	3.928	€	3.819	€	3.902
ausgegebene und umlaufende Anteile		137		137		144
NIW je Anteil	€	28,63	€	27,89	€	27,12
Class E:						
thesaurierend	\$	219.768	\$	203.678	\$	172.590
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.243		5.947		5.264
NIW je Anteil	\$	35,20	\$	34,25	\$	32,79
Erträge	\$	128.044	\$	103.491	\$	82.307
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.743		9.577		7.636
NIW je Anteil	\$	10,90	\$	10,81	\$	10,78
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	81.930	€	84.948	€	93.411
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.979		3.162		3.557
NIW je Anteil	€	27,50	€	26,86	€	26,26
H Institutional:						
thesaurierend	\$	127.321	\$	112.228	\$	58.696
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.253		2.958		1.628
NIW je Anteil	\$	39,13	\$	37,94	\$	36,05
Erträge	\$	3.373	\$	2.484	\$	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		334		248		k. A.
NIW je Anteil	\$	10,11	\$	10,01	\$	k. A.
M Retail:						
Erträge	\$	4.055	\$	8.103	\$	4.945
ausgegebene und umlaufende Anteile		367		740		453
NIW je Anteil	\$	11,04	\$	10,95	\$	10,91
Class R:						
thesaurierend	\$	4.334	\$	4.885	\$	4.074
ausgegebene und umlaufende Anteile		270		314		276
NIW je Anteil	\$	16,02	\$	15,54	\$	14,78
Class Z:						
thesaurierend	\$	9.532	\$	9.208	\$	8.688
ausgegebene und umlaufende Anteile		661		661		661
NIW je Anteil	\$	14,43	\$	13,93	\$	13,15
US Investment Grade Corporate Bond Fund						
Nettvermögen	\$	1.070.027	\$	1.180.148	\$	796.420
Institutional:						
thesaurierend	\$	155.769	\$	247.764	\$	175.590
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.211		19.215		14.658
NIW je Anteil	\$	12,76	\$	12,89	\$	11,98

	Zum 30. Jun. 2021	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)			
Erträge	\$ 89.814	\$ 93.048	\$ 70.304
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.269	8.352	6.597
NIW je Anteil	\$ 10,86	\$ 11,14	\$ 10,66
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 306.582	€ 276.920	€ 173.359
ausgegebene und umlaufende Anteile	26.726	23.784	15.722
NIW je Anteil	€ 11,47	€ 11,64	€ 11,03
Institutional GBP (Hedged): ausschüttend II	£ 307.812	£ 336.589	£ 268.019
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.048	33.002	26.906
NIW je Anteil	£ 9,91	£ 10,20	£ 9,96
Class E:			
thesaurierend	\$ 21.667	\$ 27.163	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.027	2.503	1
NIW je Anteil	\$ 10,69	\$ 10,85	\$ 10,17
Erträge	\$ 13.974	\$ 13.248	\$ 862
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.266	1.170	80
NIW je Anteil	\$ 11,04	\$ 11,32	\$ 10,82
US Short-Term Fund			
Nettovermögen	\$ 3.204.712	\$ 3.654.185	\$ 2.361.042
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.329.648	\$ 1.571.393	\$ 878.940
ausgegebene und umlaufende Anteile	116.699	138.207	79.029
NIW je Anteil	\$ 11,39	\$ 11,37	\$ 11,12
Erträge	\$ 95.240	\$ 197.384	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.386	19.443	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,15	\$ 10,15	k. A.
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 229.820	€ 255.291	€ 170.508
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.577	25.034	16.877
NIW je Anteil	€ 10,18	€ 10,20	€ 10,10
Investor:			
thesaurierend	\$ 21.477	\$ 21.612	\$ 43.210
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.932	1.945	3.961
NIW je Anteil	\$ 11,12	\$ 11,11	\$ 10,91
Class E:			
thesaurierend	\$ 516.079	\$ 558.194	\$ 490.262
ausgegebene und umlaufende Anteile	46.523	50.327	45.012
NIW je Anteil	\$ 11,09	\$ 11,09	\$ 10,89
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 11.363	€ 11.970	€ 5.963
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.151	1.208	605
NIW je Anteil	€ 9,87	€ 9,91	€ 9,85
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 27.062	\$ 14.591	\$ 2.772
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.582	1.394	270
NIW je Anteil	\$ 10,48	\$ 10,47	\$ 10,26
Class Z:			
Erträge	\$ 929.187	\$ 964.005	\$ 747.770
ausgegebene und umlaufende Anteile	91.115	94.476	74.061
NIW je Anteil	\$ 10,20	\$ 10,20	\$ 10,10

* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter fünfhundert liegt.

17. VERGÜTUNG

Die Verwaltungsgesellschaft verfolgt eine Vergütungspolitik, die den geltenden OGAW-Bestimmungen entspricht und im Verkaufsprospekt dargelegt ist.

Nähere Einzelheiten zur Vergütung der Gesellschaft sowie entsprechende finanzielle Angaben werden im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 bereitgestellt.

18. RECHTSSTREITIGKEITEN UND AUFSICHTSRECHTLICHE ANGELEGENHEITEN

Die Gesellschaft ist nicht als Beklagte an wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schiedsgerichtsverfahren beteiligt und ihr sind etwaige solche gegen sie bestehenden oder drohenden wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schadensersatzforderungen nicht bekannt.

Die vorangehenden Ausführungen gelten lediglich zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts.

19. KREDITFAZILITÄT

Der Global High Yield Bond Fund und der US High Yield Bond Fund (die „Teilfonds“ bzw. jeweils ein „Teilfonds“) haben am 29. September 2017 eine syndizierte geänderte und neu gefasste Kreditfazilität, geändert durch eine erste Änderungsvereinbarung vom 31. August 2018 mit Wirkung zum 24. August 2018 und weiter geändert durch eine zweite Änderungsvereinbarung vom 23. August 2019, eine dritte Änderungsvereinbarung vom 21. August 2020 und eine vierte Änderungsvereinbarung vom 11. September 2020 (die „Kreditvereinbarung“) zwischen u. a. den Teilfonds, bestimmten Kreditgebern, zu denen auch MUFG Bank Ltd. („MUFG“) (als „Kreditgeber“) zählt, und MUFG (als „Agent“ und „Lead Arranger“) abgeschlossen.

Jeder Fonds darf die Fazilität für temporäre Zwecke nutzen, um Rücknahmen durch Anteilinhaber zu finanzieren, sowie für andere kurzfristige Liquiditätszwecke, die gemäß seiner Anlagepolitik zulässig sind.

Der Gesamtbetrag, der für eine Nutzung durch die Teilfonds zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung auf USD 345.000.000. Die Teilfonds können zusammen mit den anderen Kreditnehmern (gemeinsam als die „Kreditnehmer“ bezeichnet) und vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung eine Erhöhung des insgesamt von den Kreditgebern gemäß der Kreditvereinbarung zugesagten Betrags um bis zu USD 200.000.000 beantragen. Dieser erhöhte zugesagte Betrag würde den Kreditnehmern zur Inanspruchnahme gemäß den Bestimmungen der Kreditvereinbarung zur Verfügung stehen.

Die Kreditvereinbarung sieht zwei verschiedene Zinssätze vor. Bei der Inanspruchnahme eines Kredits entscheidet jeder Teilfonds selbst, welcher Zinssatz für das jeweilige Darlehen gilt. Hierbei wird der geltende Zinssatz durch Bezugnahme auf (i) die Alternate Base Rate (alternativer Basiszinssatz) oder (ii) die Adjusted Offered Rate (angepasster Briefkurs) bestimmt. Die Alternate Base Rate liegt 1,375 % über der am jeweiligen Feststellungstag geltenden Federal Funds Rate (US-Leitzins) (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung). Der durch Bezugnahme auf die Adjusted Offered Rate bestimmte Zinssatz entspricht der Summe aus der geltenden Marge (diese beträgt 1,375 %) und der geltenden Adjusted Offered Rate.

Die für einen Zinszeitraum (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) geltende Adjusted Offered Rate ist ein jährlicher Zinssatz, der dem Quotienten entspricht, der sich ergibt, wenn (a) der LIBOR Offered Rate (LIBOR-Briefkurs) (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) durch (b) 1,00 abzüglich der Reserve Percentage (Reservesatz) (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) geteilt wird.

Ein Kredit, der auf Basis der Alternate Base Rate in Anspruch genommen wird, ist vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarungen innerhalb von 60 Tagen nach Inanspruchnahme zurückzuzahlen. Ein Kredit, der auf Basis der Adjusted Offered Rate in Anspruch genommen wird, ist vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarungen am letzten Tag eines maßgeblichen Zinszeitraums (dieser kann nach Wahl eines Teilfonds einem Zeitraum von einer Woche, einem Monat oder zwei Monaten entsprechen) zurückzuzahlen.

Sämtliche Kredite werden auf unbesicherter Basis gewährt, und der Rückgriff der Kreditgeber gegenüber einem Teilfonds ist auf die Vermögenswerte des betreffenden Teilfonds beschränkt.

Zum 30. Juni 2021 und zum 31. Dezember 2020 hatte keiner der Teilfonds im Rahmen der Kreditvereinbarung Kredite in Anspruch genommen.

20. VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die Richtlinie über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions Regulation, „SFTR“) führt Melde- und Offenlegungspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions, „SFTs“) und Total Return Swaps ein. SFTs sind gemäß Artikel 3(11) der SFTR folgendermaßen konkret definiert:

- Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Wertpapier- oder Rohstoffleihgeschäfte
- Buy-Sellback- oder Sale-Buyback-Geschäfte
- Lombardgeschäfte

(a) Globale Daten und Konzentration von SFT-Kontrahenten

Zum 30. Juni 2021 hielten die Teilfonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 30. Juni 2021 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	30. Jun. 2021	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Total Return Swaps		
DBL	\$ (42)	0,00
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(6.185)	(0,30)
MEI	(2.568)	(0,12)
Summe	(8.753)	(0,42)
Asia Strategic Interest Bond Fund		
Total Return Swaps		
DBL	\$ (15)	0,00
PIMCO Capital Securities Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (2.117)	(0,02)
Pensionsgeschäfte		
BPS	98.000	1,07
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(191.130)	(2,08)
BPS	(451.090)	(4,92)
BRC	(86.009)	(0,94)
IND	(185.971)	(2,03)
JML	(9.964)	(0,11)
Summe	(924.164)	(10,08)
Commodity Real Return Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 2.876	0,25
CBK	1.090	0,09
CIB	328	0,03
FBF	178	0,02
GST	2.816	0,25
JPM	4.019	0,35
MAC	223	0,02
MEI	586	0,05
SOG	8	0,00
Summe	12.124	1,06
Pensionsgeschäfte		
IND	60.400	5,28
Diversified Income Fund		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 150.000	0,80
FICC	32.917	0,18
MBC	459.500	2,46
Summe	642.417	3,44
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(21.975)	(0,13)
BRC	(29.328)	(0,15)
FBF	(2.313)	(0,01)
JML	(18.365)	(0,10)
MEI	(1.225)	(0,01)
NOM	(21.220)	(0,11)
Summe	(94.426)	(0,51)
Diversified Income Duration Hedged Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (1.982)	(0,12)

Fonds	30. Jun. 2021	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Dynamic Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
TDM	\$ 498.300	13,18
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(4.767)	(0,13)
Dynamic Multi-Asset Fund		
Total Return Swaps		
BRC	€ 3.966	0,05
HUS	1.321	0,02
Summe	5.287	0,07
Pensionsgeschäfte		
BRC	57.900	0,77
FICC	18.421	0,25
IND	35.500	0,48
Summe	111.821	1,50
Emerging Local Bond Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (390.861)	(14,11)
DBL	(9.894)	(0,36)
JML	(138.958)	(5,01)
MEI	(56.442)	(2,04)
SCX	(2.660)	(0,10)
Summe	(598.815)	(21,62)
Emerging Markets Bond Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (66.027)	(1,27)
JML	(26.763)	(0,52)
NOM	(19.929)	(0,39)
SCX	(29.201)	(0,57)
Summe	(141.920)	(2,75)
Emerging Markets Bond ESG Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 19.208	0,81
TDM	93.800	3,94
Summe	113.008	4,75
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(89.957)	(3,78)
BRC	(3.726)	(0,16)
JML	(7.795)	(0,33)
NOM	(789)	(0,03)
SCX	(140.607)	(5,91)
TDM	(14.561)	(0,61)
Summe	(257.435)	(10,82)
Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ (1.324)	(0,55)
GRE	(2.938)	(1,21)
Summe	(4.262)	(1,76)
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (2.505)	(0,75)
SCX	(5.164)	(1,55)
SGY	(2.127)	(0,64)
Summe	(9.796)	(2,94)
Euro Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
RYL	€ 14.100	0,50
Euro Credit Fund		
Pensionsgeschäfte		
RYL	€ 8.300	0,80
Euro Income Bond Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	€ (2.230)	(0,09)
SCX	(1.686)	(0,06)
Summe	(3.916)	(0,15)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	30. Jun. 2021		Fonds	30. Jun. 2021	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens		Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Euro Long Average Duration Fund Pensionsgeschäfte			Global Investment Grade Credit Fund Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
RYL	€ 1.900	0,99	BPS	\$ (12.489)	(0,06)
Euro Short-Term Fund Pensionsgeschäfte			BRC	(4.207)	(0,02)
RYL	€ 9.600	1,37	CFR	(11.242)	(0,05)
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund Pensionsgeschäfte			MEI	(500)	0,00
RYL	€ 5.800	1,41	TDM	(1.168)	(0,01)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Summe	(29.606)	(0,14)
BRC	(451)	(0,11)	Global Investment Grade Credit ESG Fund Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CFR	(1.016)	(0,25)	BOS	\$ (28.142)	(4,67)
Summe	(1.467)	(0,36)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
Global Advantage Fund Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BOS	(3.841)	(0,64)
BRC	\$ (502)	(0,10)	BPG	(1.935)	(0,32)
GRE	(31.256)	(6,06)	Summe	(5.776)	(0,96)
IND	(4.998)	(0,97)	Global Libor Plus Bond Fund Pensionsgeschäfte		
Summe	(36.756)	(7,13)	BPS	\$ 88.200	2,74
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			TDM	139.300	4,33
BOS	(559)	(0,11)	Summe	227.500	7,07
BPS	(8.297)	(1,61)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
TDM	(3.889)	(0,75)	BPS	(1.142)	(0,04)
Summe	(12.745)	(2,47)	Global Low Duration Real Return Fund Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
Global Bond Fund Total Return Swaps			BRC	\$ (178.774)	(16,96)
CIB	\$ 7.279	0,05	Global Real Return Fund Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BOS	\$ (39.082)	(1,21)
BRC	(12.650)	(0,09)	GRE	(42.725)	(1,33)
BSN	(109.127)	(0,74)	NOM	(689.464)	(21,37)
CIB	(119.634)	(0,81)	Summe	(771.271)	(23,91)
GRE	(752.047)	(5,11)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
IND	(39.063)	(0,27)	BOS	(5.319)	(0,17)
Summe	(1.032.521)	(7,02)	BRC	(33.539)	(1,04)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			TDM	(26.902)	(0,83)
TDM	(46.114)	(0,31)	Summe	(65.760)	(2,04)
Global Bond ESG Fund Pensionsgeschäfte			Income Fund Total Return Swaps		
BPS	\$ 22.400	1,36	BRC	\$ 560	0,00
Global Bond Ex-US Fund Total Return Swaps			Pensionsgeschäfte		
CIB	\$ 326	0,03	BOS	218.100	0,30
GST	(890)	(0,09)	BRC	345.363	0,48
Summe	(564)	(0,06)	FICC	74.020	0,10
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			MBC	1.203.900	1,68
BOS	(2.208)	(0,22)	SOG	377.804	0,53
BPS	(52.553)	(5,18)	Summe	2.219.187	3,09
BRC	(879)	(0,09)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(28.831)	(2,84)	BPS	(44.996)	(0,06)
Summe	(84.471)	(8,33)	BRC	(9.829)	(0,01)
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund Total Return Swaps			FBF	(3.768)	(0,01)
BPS	\$ (1.773)	(0,22)	JML	(4.372)	(0,01)
BRC	(1.312)	(0,17)	Summe	(62.965)	(0,09)
FBF	(433)	(0,06)	Inflation Strategy Fund Total Return Swaps		
JPM	(1.378)	(0,17)	BOA	\$ 22	0,02
SOG	(250)	(0,03)	BPS	26	0,03
Summe	(5.146)	(0,65)	CBK	126	0,14
Global High Yield Bond Fund Total Return Swaps			FAR	(7)	(0,01)
BPS	\$ 714	0,01	FBF	(5)	(0,01)
JPM	296	0,01	GST	9	0,01
MYC	49	0,00	JPM	65	0,07
Summe	1.059	0,02	MYI	(134)	(0,14)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			SOG	173	0,17
BRC	(17.326)	(0,32)	UAG	(225)	(0,23)
FBF	(2.313)	(0,04)	Summe	50	0,05
Summe	(19.639)	(0,36)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
			GRE	(4.212)	(4,24)

Fonds	30. Jun. 2021	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Low Average Duration Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 105.100	9,44
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 7.100	0,94
TDM	1.100	0,14
Summe	8.200	1,08
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(3.184)	(0,42)
Low Duration Income Fund		
Total Return Swaps		
BRC	\$ 8	0,00
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 64	0,06
CBK	428	0,45
MYI	(170)	(0,17)
Summe	322	0,34
Mortgage Opportunities Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ (74.597)	(3,12)
TDM	(11.154)	(0,47)
Summe	(85.751)	(3,59)
StocksPLUS™ Fund		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 5.285	0,17
BPS	8.766	0,28
BRC	3.873	0,13
CBK	34.213	1,11
FAR	29.980	0,97
GST	1.503	0,05
HUS	656	0,02
RBC	5.680	0,18
Summe	89.956	2,91
Pensionsgeschäfte		
BOS	200.000	6,46
BPS	225.000	7,27
DEU	130.000	4,20
GSC	191.500	6,19
MFK	250.000	8,08
Summe	996.500	32,20
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 78	0,75
BRC	180	1,71
GST	363	3,46
HUS	70	0,67
Summe	691	6,59
Pensionsgeschäfte		
BPS	2.900	27,66
Strategic Income Fund		
Total Return Swaps		
BRC	\$ 6	0,00
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(36.555)	(4,71)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(1.834)	(0,24)
Total Return Bond Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ (15.269)	(0,28)
BSN	(41.376)	(0,77)
GRE	(60.667)	(1,12)
IND	(45.742)	(0,85)
Summe	(163.054)	(3,02)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
CSN	(7.840)	(0,15)

Fonds	30. Jun. 2021	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Total Return Swaps		
GST	\$ (4)	0,00
MEI	(51)	(0,07)
Summe	(55)	(0,07)
UK Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
RYL	£ 3.400	0,58
SCX	8.300	1,42
Summe	11.700	2,00
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
MEI	(33.647)	(5,74)
UK Long Term Corporate Bond Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	£ (8.288)	(2,01)
MEI	(2.511)	(0,61)
Summe	(10.799)	(2,62)
US High Yield Bond Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 492	0,01
JPM	69	0,00
Summe	561	0,01
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(916)	(0,02)
RDR	(6.010)	(0,14)
Summe	(6.926)	(0,16)
US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ (1.155)	(0,11)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(30.307)	(2,83)
CSN	(12.013)	(1,13)
TDM	(30.290)	(2,83)
Summe	(72.610)	(6,79)

Zum 31. Dezember 2020 hielten die Teilfonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte
- Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 31. Dezember 2020 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	31. Dez. 2020	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Total Return Swaps		
DBL	\$ 103	0,01
Pensionsgeschäfte		
SSB	1.302	0,15
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(1.523)	(0,17)
Asia Strategic Interest Bond Fund		
Total Return Swaps		
DBL	\$ 36	0,02
Pensionsgeschäfte		
SSB	1.299	0,78
PIMCO Capital Securities Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (1.954)	(0,03)
Pensionsgeschäfte		
BOS	100.000	1,26
BPS	27.200	0,34

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2020		Fonds	31. Dez. 2020	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens		Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)			Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)		
FICC	\$ 12.244	0,15	Pensionsgeschäfte		
Summe	139.444	1,75	BPS	€ 264.100	5,15
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			FICC	7.299	0,14
BOS	(184.841)	(2,32)	Summe	271.399	5,29
BPS	(1.525.666)	(19,18)	Emerging Local Bond Fund		
BRC	(196.717)	(2,47)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CFR	(1.538)	(0,02)	BPS	\$ (236.452)	(8,30)
IND	(215.807)	(2,71)	JML	(197.657)	(6,93)
SOG	(5.903)	(0,07)	SCX	(36.358)	(1,28)
Summe	(2.130.472)	(26,77)	Summe	(470.467)	(16,51)
PIMCO Climate Bond Fund			Emerging Markets Bond Fund		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 12.100	11,88	FICC	\$ 3.386	0,06
Commodity Real Return Fund			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Total Return Swaps			BPS	(57.446)	(1,09)
BPS	\$ 760	0,23	BRC	(11.990)	(0,22)
CBK	2.707	0,83	CFR	(4.536)	(0,09)
CIB	772	0,24	JML	(40.238)	(0,76)
FBF	418	0,13	MEI	(3.578)	(0,07)
GST	2.294	0,70	SCX	(20.304)	(0,39)
JPM	2.294	0,70	Summe	(138.092)	(2,62)
MEI	715	0,22	Emerging Markets Bond ESG Fund		
SOG	19	0,01	Pensionsgeschäfte		
Summe	9.979	3,06	BPS	\$ 66.100	4,59
Pensionsgeschäfte			FICC	4.321	0,30
FICC	2.372	0,73	NOM	67.900	4,71
TDM	7.700	2,37	Summe	138.321	9,60
Summe	10.072	3,10	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BPS	(36.538)	(2,54)
GRE	(126.586)	(38,94)	CFR	(358)	(0,02)
IND	(15.777)	(4,85)	JML	(2.699)	(0,19)
SCX	(11.187)	(3,44)	SCX	(68.053)	(4,72)
Summe	(153.550)	(47,23)	TDM	(15.147)	(1,05)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund			Summe	(122.795)	(8,52)
Pensionsgeschäfte			Emerging Markets Corporate Bond Fund		
FICC	\$ 495	0,34	Pensionsgeschäfte		
Diversified Income Fund			FICC	\$ 921	0,35
Pensionsgeschäfte			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 46.261	0,25	BRC	(760)	(0,29)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			GRE	(3.767)	(1,44)
BPS	(8.779)	(0,05)	Summe	(4.527)	(1,73)
BRC	(16.651)	(0,10)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
CFR	(18.098)	(0,09)	BPG	(2.338)	(0,89)
JML	(25.308)	(0,13)	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
Summe	(68.836)	(0,37)	Pensionsgeschäfte		
Diversified Income Duration Hedged Fund			SSB	\$ 1.565	0,71
Pensionsgeschäfte			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 11.970	0,81	BPS	(3.770)	(1,71)
NOM	27.200	1,83	Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Summe	39.170	2,64	Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BPS	\$ 6.600	20,26
BPS	(989)	(0,07)	SSB	536	1,65
Dynamic Bond Fund			Summe	7.136	21,91
Pensionsgeschäfte			Euro Bond Fund		
FICC	\$ 20.613	0,64	Pensionsgeschäfte		
NOM	29.200	0,91	BPS	€ 143.300	4,42
Summe	49.813	1,55	FICC	4.355	0,13
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Summe	147.655	4,55
RCY	(205.836)	(6,42)	Euro Credit Fund		
Dynamic Multi-Asset Fund			Pensionsgeschäfte		
Total Return Swaps			FICC	€ 913	0,08
BPS	€ (16)	0,00	RYL	15.500	1,35
BRC	0	0,00	Summe	16.413	1,43
Summe	(16)	0,00			

Fonds	31. Dez. 2020		Fonds	31. Dez. 2020	
	Marktwert (000S)	% des Nettvermögens		Marktwert (000S)	% des Nettvermögens
Euro Income Bond Fund			Global Bond ESG Fund		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
FICC	€ 2.872	0,09	BPS	\$ 45.700	3,03
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			FICC	5.041	0,33
CFR	(2.600)	(0,08)	Summe	50.741	3,36
Euro Long Average Duration Fund			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			SCX	(25.562)	(1,69)
FICC	€ 168	0,09	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			TDM	(5.461)	(0,36)
BPS	(2.169)	(1,19)	Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		
Euro Short-Term Fund			TDM	5.468	0,36
Pensionsgeschäfte			Global Bond Ex-US Fund		
BPS	€ 7.600	0,94	Total Return Swaps		
RYL	55.300	6,85	BOA	\$ (109)	(0,01)
Summe	62.900	7,79	CIB	365	0,04
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			GST	(56)	(0,01)
BRC	(1.583)	(0,20)	JPM	(14)	0,00
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund			Summe	186	0,02
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
FICC	€ 267	0,08	FICC	1.069	0,11
RYL	6.500	1,85	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Summe	6.767	1,93	BPS	(66.331)	(7,13)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BRC	(5.073)	(0,55)
CFR	(1.020)	(0,29)	CEW	(9.124)	(0,98)
Global Advantage Fund			GRE	(30.025)	(3,23)
Total Return Swaps			IND	(8.455)	(0,91)
IND	\$ (69)	(0,01)	JML	(19.487)	(2,10)
Pensionsgeschäfte			RYL	(6.832)	(0,73)
FICC	1.298	0,25	Summe	(145.327)	(15,63)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPS	(5.341)	(1,02)	BPG	(3.643)	(0,39)
CEW	(1.833)	(0,35)	NOM	(3.867)	(0,42)
GRE	(23.827)	(4,54)	Summe	(7.510)	(0,81)
IND	(7.776)	(1,48)	PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		
JML	(8.692)	(1,66)	Total Return Swaps		
Summe	(47.469)	(9,05)	BRC	\$ 1	0,00
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			FBF	3	0,00
BPS	\$ (8.792)	(1,68)	JPM	199	0,03
TDM	(3.703)	(0,70)	Summe	203	0,03
Summe	(12.495)	(2,38)	Pensionsgeschäfte		
Global Bond Fund			FICC	\$ 981	0,14
Total Return Swaps			Global High Yield Bond Fund		
CIB	\$ 8.147	0,05	Total Return Swaps		
IND	(635)	0,00	BRC	\$ 1.238	0,02
Summe	7.512	0,05	GST	21.014	0,39
Pensionsgeschäfte			Summe	22.252	0,41
FICC	19.238	0,12	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BRC	(6.699)	(0,12)
BOM	(178.095)	(1,09)	JPS	(779)	(0,02)
BOS	(75.279)	(0,46)	Summe	(7.478)	(0,14)
BPS	(57.978)	(0,35)	Global Investment Grade Credit Fund		
BSN	(114.030)	(0,70)	Pensionsgeschäfte		
CIB	(264.492)	(1,62)	FICC	\$ 802	0,00
GRE	(29.317)	(0,18)	SAL	30.000	0,11
JML	(313.856)	(1,93)	Summe	30.802	0,11
RCY	(56.618)	(0,35)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SCX	(57.441)	(0,35)	BPS	(9.171)	(0,03)
SGY	(429.309)	(2,64)	BRC	(8.697)	(0,04)
Summe	(1.576.415)	(9,67)	CFR	(18.133)	(0,06)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			JPS	(32.246)	(0,12)
BCY	(65.327)	(0,40)	TDM	(1.162)	0,00
BPG	(16.900)	(0,10)	Summe	(69.409)	(0,25)
MSC	(5.884)	(0,04)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
Summe	(88.111)	(0,54)	BPG	(66.740)	(0,24)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2020		Fonds	31. Dez. 2020	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens		Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Global Investment Grade Credit ESG Fund			Low Average Duration Fund		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 111	0,03	FICC	\$ 2.675	0,23
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			RDR	5.600	0,47
BOS	(1.276)	(0,38)	Summe	8.275	0,70
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
BOS	(505)	(0,15)	Pensionsgeschäfte		
BPG	(2.568)	(0,78)	FICC	\$ 2.680	0,42
MSC	(15.585)	(4,69)	Summe	2.680	0,42
Summe	(18.658)	(5,62)	Low Duration Income Fund		
Global Libor Plus Bond Fund			Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			BOS	\$ 7.000	0,73
FICC	\$ 20.967	0,79	FICC	769	0,08
Global Low Duration Real Return Fund			MBC	19.800	2,06
Pensionsgeschäfte			Summe	27.569	2,87
FICC	\$ 1.551	0,20	PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			Total Return Swaps		
BPG	(66.936)	(8,49)	BOA	\$ (1.876)	(2,42)
TDM	(212.825)	(27,02)	CBK	(431)	(0,55)
Summe	(279.761)	(35,51)	GST	(25)	(0,03)
Global Real Return Fund			MYI	(987)	(1,27)
Pensionsgeschäfte			Summe	(3.319)	(4,27)
FICC	\$ 906	0,04	Mortgage Opportunities Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BOM	(235.237)	(9,12)	FICC	\$ 1.590	0,08
CIB	(96.470)	(3,74)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
GRE	(334.648)	(12,98)	TDM	(2.224)	(0,11)
IND	(48.308)	(1,88)	StocksPLUS™ Fund		
SCX	(54.705)	(2,12)	Total Return Swaps		
Summe	(769.368)	(29,84)	BOA	\$ 20.694	0,58
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			BPS	6.298	0,18
BPG	(1.770)	(0,07)	BRC	(36)	0,00
Pensionsgeschäfte			CBK	\$ 46.705	1,32
FICC	14.587	0,02	FAR	18.938	0,53
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			GST	(10)	0,00
BOM	(522.479)	(0,74)	HUS	24.537	0,70
BPS	(128.797)	(0,18)	Summe	117.126	3,31
BRC	(135.115)	(0,18)	Pensionsgeschäfte		
BSN	(627.356)	(0,88)	FICC	9.369	0,26
CIB	(1.090.836)	(1,53)	GSC	23.800	0,67
IND	(1.056.138)	(1,48)	MFK	447.000	12,64
NXN	(2.153.542)	(3,02)	RVM	448.000	12,66
RCY	(643.611)	(0,90)	Summe	928.169	26,23
SGY	(1.107.819)	(1,56)	PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
TDM	(715.908)	(1,01)	Total Return Swaps		
Summe	(8.181.601)	(11,48)	BRC	\$ 68	0,81
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			FAR	15	0,18
BPG	(44.153)	(0,06)	GST	6	0,07
Inflation Strategy Fund			Summe	89	1,06
Total Return Swaps			Pensionsgeschäfte		
BOA	\$ (257)	(0,36)	BPS	2.900	34,46
BPS	60	0,08	SSB	139	1,65
CBK	19	0,03	Summe	3.039	36,11
FAR	(13)	(0,02)	Strategic Income Fund		
FBF	0	0,00	Pensionsgeschäfte		
GST	28	0,04	FICC	\$ 528	0,05
JPM	102	0,14	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
MYI	(180)	(0,26)	GRE	(52.542)	(5,39)
SOG	219	0,31	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
UBS	47	0,07	BPG	(745)	(0,07)
Summe	25	0,03	MSC	(1.729)	(0,18)
Pensionsgeschäfte			TDM	(392)	(0,04)
SSB	571	0,82	Summe	(2.866)	(0,29)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Total Return Bond Fund		
GRE	(15.360)	(21,93)	Pensionsgeschäfte		
			BOS	\$ 114.400	1,78
			FICC	5.063	0,08

Fonds	31. Dez. 2020	
	Marktwert (000\$)	% des Nettvermögens
Total Return Bond Fund (Forts.)		
RDR	\$ 8.200	0,13
SAL	8.500	0,13
Summe	136.163	2,12
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Total Return Swaps		
GST	\$ 56	0,12
Pensionsgeschäfte		
BOS	6.900	14,61
BPS	6.200	13,14
SSB	545	1,15
Summe	13.645	28,90
UK Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 650	0,09
SCX	45.500	5,95
Summe	46.150	6,04
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(8.684)	(1,14)
CEW	(15.853)	(2,07)
JML	(4.287)	(0,56)
SCX	(21.644)	(2,83)
Summe	(50.468)	(6,60)
UK Long Term Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 660	0,18
RYL	4.600	1,26
Summe	5.260	1,44
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(7.010)	(1,93)
BRC	(302)	(0,08)
CEW	(14.729)	(4,04)
IND	(10.548)	(2,89)
SCX	(37.855)	(10,38)
Summe	(70.444)	(19,32)
US High Yield Bond Fund		
Total Return Swaps		
BRC	\$ 2.649	0,07
GST	3.240	0,08
MYC	816	0,02
Summe	6.705	0,17
Pensionsgeschäfte		
BOS	12.700	0,31
FICC	2.200	0,05
GSC	12.400	0,31
TDM	3.500	0,09
Summe	30.800	0,76
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(12.906)	(0,32)
JPS	(779)	(0,02)
RDR	(1.577)	(0,04)
Summe	(15.262)	(0,38)
US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.887	0,24
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BOS	(4.275)	(0,36)
BPG	(2.744)	(0,23)
NOM	(1.972)	(0,17)
TDM	(33.605)	(2,85)
Summe	(42.596)	(3,61)
US Short-Term Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 208.500	5,71
FICC	4.734	0,13
Summe	213.234	5,84

(b) Sicherheiten**(i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:**

Die zum 30. Juni 2021 und zum 31. Dezember 2020 erhaltenen Sicherheiten wurden im Depotbanknetz der State Street Bank and Trust als Beauftragte der Verwahrstelle gehalten.

(ii) Konzentrationsdaten:

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2021 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	Zum 30. Jun. 2021	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000\$)
PIMCO Capital Securities Fund	Nordea Bank Abp	\$ 685
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	100.356
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	61.708
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	661.988
Diversified Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	508.961
	BPCE S.A.	€ 5.004
Dynamic Bond Fund	Europäischer Stabilitätsmechanismus	2.438
	Regierung Frankreichs	47.484
Dynamic Multi-Asset Fund	Germany Government	10.050
	SNCF Reseau	1.600
Emerging Markets Bond Fund	Standard Chartered Bank	4.000
	Svenska Handelsbanken AB	2.004
Emerging Markets Bond ESG Fund	UNEDIC	21.095
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.790
Euro Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 269
	Regierung von Österreich	€ 8.525
Euro Credit Fund	Europäische Union	5.618
	Regierung von Österreich	6.620
Euro Long Average Duration Fund	Regierung Belgiens	1.911
	Regierung von Österreich	9.629
Euro Short-Term Fund	Regierung Belgiens	5.834
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 22.879
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	10
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	232.322
Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	389
	Regierung des Vereinigten Königreichs	731.550
Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.541.158
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	107.332
Global Labor Plus Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	8.396
	Fannie Mae	200.574
Global Real Return Fund	Ginnie Mae	231.888
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	595.841
Income Fund	Ginnie Mae	1.023
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.941
Low Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	998
	Regierung des Vereinigten Königreichs	£ 12.241
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 10
	Fannie Mae	
StocksPLUS™ Fund	Ginnie Mae	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Ginnie Mae	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung des Vereinigten Königreichs	
UK Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2020 wie folgt.

Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Zum 31. Dez. 2020		
Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 1.328
Asia Strategic Interest Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.325
PIMCO Capital Securities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	148.158
PIMCO Climate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	12.400
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	10.361
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	505
Diversified Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	47.684
Diversified Income Duration Hedged Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	40.077
Dynamic Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	51.365
Dynamic Multi-Asset Fund	Regierung Belgiens	€ 179.205
	Europäische Investitionsbank	36.820
	Landwirtschaftliche Rentenbank	53.152
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	7.445
Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 4.213
Emerging Markets Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	141.550
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	940
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.596
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Ginnie Mae	3.400
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.926
Euro Bond Fund	Regierung Belgiens	€ 143.374
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	4.442
Euro Credit Fund	Regierung der Niederlande	15.490
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	931
Euro Income Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.929
Euro Long Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	172
Euro Short-Term Fund	Regierung Belgiens	7.614
	Regierung der Niederlande	55.268
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Regierung der Niederlande	6.496
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	273
Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 1.324
Global Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	51.150
Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 51.867

Zum 31. Dez. 2020		
Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.090
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.001
Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	31.440
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	113
Global Libor Plus Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	21.386
Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.582
Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	7.666
Income Fund	UniCredit SpA	3.394
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	31.918
Inflation Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	582
Low Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	8.448
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.734
Low Duration Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	28.361
Mortgage Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.621
StocksPLUS™ Fund	Fannie Mae	24.845
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	925.029
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Ginnie Mae	1.443
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.678
Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	539
Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	139.230
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Ginnie Mae	3.194
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	10.770
UK Corporate Bond Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	£ 45.728
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	663
UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	4.609
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	673
US High Yield Bond Fund	Fannie Mae	\$ 12.944
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.782
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.945
US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	218.348

(iii) Aggregierte Transaktionsdaten:

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2021 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Land	
								Niederlassung des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Capital Securities Fund	Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	\$ 100.356	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Umgekehrte Pensions-geschäfte	Barsicherheiten	4.911	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensions-geschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	430	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Commodity Real Return Fund	Pensions-geschäfte	Nordea Bank Abp	Unternehmensanleihen	685	AA-	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	61.708	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Diversified Income Fund	Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	18.547	AAA	1-3 Monate	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	154.028	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	20.615	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	134.122	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	33.575	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	105.559	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Land Niederlassung des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing		
Diversified Income Fund	Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 156.753	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Floating Rate Note	Treasury	38.510	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral		
Dynamic Bond Fund	Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	279	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Floating Rate Note	Treasury	418.263	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral		
Dynamic Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	€ 410	k. A.	k. A.	EUR	USA	FED, Bilateral		
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	7.690	k. A.	k. A.	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral		
	Pensions-geschäfte	BPCE S.A.	Unternehmensanleihen	5.004	AAA	1-3 Monate	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral		
		Standard Chartered Bank	Unternehmensanleihen	4.000	AAA	Unter 1 Monat	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral		
		Svenska Handelsbanken AB	Unternehmensanleihen	2.004	AAA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral		
		European Stability Mechanism	Treasury	2.438	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		France Government International Bond	Treasury	47.484	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral		
		SNCF Reseau	Treasury	1.600	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	10.050	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		UNEDIC	Treasury	21.095	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	18.790	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral		
		Emerging Markets Bond Fund	Umgekehrte Pensions-geschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 1.630	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Emerging Markets Bond ESG Fund	Pensions-geschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	963	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
U.S. Treasury Bonds	Treasury			269	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral		
Euro Bond Fund	Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	19.592	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Notes	Treasury	96.277	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral		
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	580	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral		
Euro Credit Fund	Pensions-geschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.534	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral		
		Austria Government International Bond	Treasury	€ 8.525	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral		
Euro Long Average Duration Fund	Pensions-geschäfte	Europäische Union	Treasury	5.618	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral		
		Belgium Government International Bond	Treasury	1.709	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral		
Euro Short-Term Fund	Pensions-geschäfte	Austria Government International Bond	Treasury	6.620	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral		
		Belgium Government International Bond	Treasury	1.911	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral		
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensions-geschäfte	Austria Government International Bond	Treasury	9.629	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral		
Global Advantage Fund	Umgekehrte Pensions-geschäfte	Belgium Government International Bond	Treasury	5.834	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral		
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 210	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral		
Global Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	7.870	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral		
		Umgekehrte Pensions-geschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	533	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	10.058	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral		
Global Bond ESG Fund	Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	22.879	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral		
Global Bond Ex-US Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	550	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral		
		Umgekehrte Pensions-geschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	940	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Land Niederlassung des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing	
Global High Yield Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 17.750	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	440	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral	
Global Investment Grade Credit Fund	Umgekehrte Pensions-geschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	270	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.535	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
Global Libor Plus Bond Fund	Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	10	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	90.073	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
Global Real Return Fund	Umgekehrte Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	142.249	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.001	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral	
Income Fund	Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	298.979	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	189.604	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	67.811	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	883.203	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		United Kingdom Gilt	Treasury	383.599	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Frankreich	FED, Bilateral	
		United Kingdom Gilt	Treasury	347.951	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Floating Rate Note	Treasury	101.559	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Umgekehrte Pensions-geschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.214	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	2	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral	
		Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	260	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
		Low Average Duration Fund	Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	107.332	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	7.271	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.125	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral	
StocksPLUS™ Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	5.340	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.560	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	5.770	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	67.697	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral	
		Pensions-geschäfte	Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	200.574	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
			Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	231.888	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
U.S. Treasury Bonds	Treasury		134.809	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral		
U.S. Treasury Bonds	Treasury		205.371	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral		
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	440	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.941	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
Total Return Bond Fund	Umgekehrte Pensions-geschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	1.023	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	713	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.785	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	278	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral	
UK Corporate Bond Fund	Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	720	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral	
		United Kingdom Gilt	Treasury	£ 11.700	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	FED, Bilateral	
US High Yield Bond Fund	Umgekehrte Pensions-geschäfte	United Kingdom Gilt	Treasury	541	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 12	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Umgekehrte Pensions-geschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	10	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral	

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalleten sich zum 31. Dezember 2020 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Land Niederlassung des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 1.328	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Asia Strategic Interest Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.325	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
PIMCO Capital Securities Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	22.750	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	27.810	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	12.489	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	102.407	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	373	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	4.866	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	213	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	73.081	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	1.506	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
PIMCO Climate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	12.400	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Commodity Real Return Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	4.340	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	670	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	2.420	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.419	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	7.942	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	1.725	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	505	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Diversified Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	47.186	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	498	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	244	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Diversified Income Duration Hedged Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	27.868	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	12.209	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Dynamic Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	29.917	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	21.025	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	423	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	€ 5.310	k. A.	k. A.	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Belgium Government International Bond	Treasury	179.205	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Investitionsbank	Treasury	36.820	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Unternehmensanleihen	53.152	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	7.445	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Emerging Local Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	\$ 2.200	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	8.406	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	3.454	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	759	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	2.240	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	67.582	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	69.561	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	4.407	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	620	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	957	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	940	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.596	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	260	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Land Niederlassung des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	\$ 3.400	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	3.379	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	547	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Belgium Government International Bond	Treasury	€ 143.374	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	4.442	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	Netherlands Government International Bond	Treasury	15.490	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	931	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.929	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Zahlungsmit tel	666	k. A.	k. A.	USD	Schweiz	FED, Bilateral
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	172	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		Belgium Government International Bond	Treasury	7.614	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	Netherlands Government International Bond	Treasury	55.268	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
		Netherlands Government International Bond	Treasury	6.496	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	273	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	\$ 1.324	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	\$ 1.324	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	9.310	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	19.623	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	27.703	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.772	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	338	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	278	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	224	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.212	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	863	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	2.803	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	46.725	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	5.142	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.090	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	300	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	430	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	302	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	270	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	1.790	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Swap-Kontrakte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.001	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	1.001	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	22.004	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	310	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	818	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	30.612	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	10	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	1.570	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	113	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Global Libor Plus Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	21.386	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.582	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Land Niederlassung des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	\$ 924	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	4.868	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.874	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	5.841	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
Income Fund		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	308	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	14.879	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	1.488	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.665	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	7.977	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	3.289	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	2.303	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	53	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		UniCredit SpA	Unternehm ensanleihen	3.394	BBB-	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	264	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	1.790	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	4.865	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	10.234	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
Inflation Strategy Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	60	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	582	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	5.719	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	2.729	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.734	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Low Duration Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	20.435	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	784	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	7.142	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.621	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
StocksPLUS™ Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	10.220	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	5.477	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	156.298	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	458.089	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	24.845	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	457.384	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Cayman Inseln	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	9.556	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	507	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	1.443	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	1.536	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	142	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	539	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	5.164	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	117.015	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	17.051	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	3.194	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	3.174	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	556	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	7.040	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	United Kingdom Gilt	Treasury	£ 45.728	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	663	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	206	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	198	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	752	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
UK Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	United Kingdom Gilt	Treasury	4.609	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	673	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Land Niederlassung des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
US High Yield Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	£ 1.502	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	\$ 5.740	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	630	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	12.944	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	2.244	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
	U.S. Treasury Notes	Treasury	16.538	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral	
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmit tel	1.412	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.945	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
US Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	213.519	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	4.829	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral

Der Marktwert der Sicherheiten für Pensionsgeschäfte umfasst aufgelaufene Zinsen.

Rahmenverträge für Termingeschäfte decken eine Kombination aus Buy-Sellback-Geschäften, Sale-Buyback-Geschäften und sonstigen Finanzierungsgeschäften ab, die oben nicht enthalten sind. Der Gesamtbetrag der zum 30. Juni 2021 und zum 31. Dezember 2020 für alle Sicherheiten, die für gemäß diesen Vereinbarungen abgeschlossene Geschäfte erhalten wurden, ist oben enthalten. Es ist nicht möglich, die Sicherheiten für jedes einzelne Wertpapierfinanzierungsgeschäft separat 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) Rendite/Kosten

Die nachfolgenden Tabellen liefern detaillierte Angaben zur Rendite und den Kosten jeder Art von SFT und Total Return Swap für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2021 oder zum 30. Juni 2020. Die Beträge sind in der Basiswährung der Teilfonds ausgewiesen.

	30. Jun. 2021							
	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungs-geschäfte		Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte	
	Renditen	Kosten	Renditen	Kosten	Renditen	Kosten	Renditen	Kosten
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 1	\$ 0	\$ 27	\$ 35	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
PIMCO Capital Securities Fund	108	0	423	1.101	0	0	0	0
PIMCO Climate Bond Fund	2	0	0	0	0	0	0	0
Commodity Real Return Fund	2	0	0	36	0	0	1	0
Diversified Income Fund	97	27	658	0	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	8	0	7	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	13	0	31	55	0	0	12	0
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 0	€ 1.491	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Emerging Local Bond Fund	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 2.920	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Emerging Markets Bond Fund	0	0	53	183	0	0	0	0
Emerging Markets Bond ESG Fund	16	0	7	293	0	0	0	0
Emerging Markets Corporate Bond Fund	0	0	3	1	0	0	0	1
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	0	0	2	4	0	0	0	0
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	1	0	0	0	0	0	0	0
Euro Bond Fund	€ 0	€ 214	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	0	27	0	0	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	0	43	2	57	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	0	7	17	0	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	0	100	4	0	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	0	24	0	0	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	0	31	9	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	\$ 0	\$ 0	\$ 16	\$ 15	\$ 0	\$ 0	\$ 2	\$ 0
Global Bond Fund	0	0	251	416	0	0	0	6
Global Bond ESG Fund	3	0	0	4	0	0	0	2
Global Bond Ex-US Fund	0	0	160	29	0	0	0	1
Global High Yield Bond Fund	5	0	48	0	0	0	0	0
Global Investment Grade Credit Fund	24	0	206	85	2	0	85	0

30. Jun. 2021

	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen	Kosten	Renditen	Kosten	Renditen	Kosten	Renditen	Kosten
Global Investment Grade Credit ESG Fund	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 3	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 4
Global Libor Plus Bond Fund	7	0	2	0	0	0	1	0
Global Low Duration Real Return Fund	0	0	0	0	0	0	0	109
Global Real Return Fund	0	0	2	302	0	0	2	0
Income Fund	191	99	333	1.219	0	0	132	0
Inflation Strategy Fund	0	0	0	5	0	0	0	1
Low Average Duration Fund	5	0	0	0	0	0	0	0
Low Duration Income Fund	3	0	3	0	0	0	0	0
Mortgage Opportunities Fund	3	0	0	7	0	0	0	0
StocksPLUS [™] Fund	212	33	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	0	0	0	10	0	0	0	2
Total Return Bond Fund	19	0	0	4	0	0	0	0
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	1	0	0	0	0	0	0	0
UK Corporate Bond Fund	£ 11	£ 0	£ 0	£ 28	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	1	0	1	19	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	\$ 6	\$ 0	\$ 28	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
US Investment Grade Corporate Bond Fund	0	0	1	5	0	0	0	6
US Short-Term Fund	58	0	0	0	0	0	0	0

30. Jun. 2020

Fonds	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 5	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
PIMCO Capital Securities Fund	2.173	22	638	8.189	0	0	0	0
Commodity Real Return Fund	9	0	0	870	0	0	0	12
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	9	0	0	0	0	0	0	0
Diversified Income Fund	2.860	0	7.344	0	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	188	0	13	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	223	0	2	141	0	0	9	15
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 9	€ 46	€ 12	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Emerging Local Bond Fund	\$ 71	\$ 0	\$ 0	\$ 6.629	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Emerging Markets Bond Fund	32	0	72	1.602	0	0	0	1
Emerging Markets Bond ESG Fund	184	0	7	448	0	0	0	0
Emerging Markets Corporate Bond Fund	7	0	10	8	0	0	0	9
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	5	0	3	129	0	0	0	0
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	18	0	0	0	0	0	0	0
Euro Bond Fund	€ 3	€ 22	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	4	62	52	0	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	11	117	271	0	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	0	3	15	0	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	1	98	0	0	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	0	9	0	0	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	1	22	12	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	\$ 3	\$ 0	\$ 47	\$ 184	\$ 0	\$ 0	\$ 3	\$ 38
Global Advantage Real Return Fund	1	0	1	5	0	0	0	0
Global Bond Fund	486	0	472	3.020	0	2	0	30
Global Bond Ex-US Fund	7	0	165	2.865	0	0	0	19
Global Bond ESG Fund	128	0	22	68	0	0	0	0
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	11	0	0	53	0	0	47	0
Global High Yield Bond Fund	97	0	6	54	0	0	3	5
Global Investment Grade Credit Fund	306	6	198	9.079	0	0	129	563
Global Investment Grade Credit ESG Fund	2	0	0	1	0	0	3	5
Global Libor Plus Bond Fund	15	0	2	53	0	0	0	9
Global Low Duration Real Return Fund	3	0	45	192	0	99	0	1.096
Global Real Return Fund	8	0	143	2.578	0	1	2	5
Income Fund	511	0	939	58.144	0	72	0	1.605
Inflation Strategy Fund	1	0	0	86	0	0	0	6
Low Average Duration Fund	44	0	0	421	0	0	0	1
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	11	0	0	31	0	0	0	3
Low Duration Income Fund	149	0	0	0	0	0	0	0

30. Jun. 2020

Fonds	Pensions- geschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback- Finanzierungs- geschäfte		Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	\$ 4	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Mortgage Opportunities Fund	77	0	0	1.523	0	0	0	6
StocksPLUS [™] Fund	2.486	0	0	1	0	0	0	0
PIMCO StocksPLUS [™] AR Fund	6	0	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	4	0	0	4	0	0	0	1
Total Return Bond Fund	104	0	113	2.335	0	3	0	26
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	20	0	0	0	0	0	0	0
UK Corporate Bond Fund	£ 27	£ 0	£ 5	£ 96	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	11	0	7	408	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	\$ 131	\$ 0	\$ 21	\$ 60	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 3
US Investment Grade Corporate Bond Fund	9	0	0	62	0	0	18	28
US Short-Term Fund	36	0	0	1.019	0	0	1	169

Alle Renditen aus SFT-Derivatgeschäften laufen zugunsten des Fonds auf 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 Betriebsergebnisrechnung im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten sowie in der Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten enthalten.

21. WESENTLICHE EREIGNISSE

Seit Januar 2020 haben die globalen Finanzmärkte aufgrund der Ausbreitung des neuartigen Coronavirus namens COVID-19 erhebliche Volatilität verzeichnet 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 haben die Weltwirtschaft, die Wirtschaft einzelner Länder und Emittenten belastet und können dies auch weiterhin tun.

Am 7. Januar 2021 wurde von der Verwaltungsgesellschaft eine Zeichnung in Höhe von USD 6.500.000 im US Short-Term Fund durchgeführt.

Am 18. Januar 2021 genehmigte die Hong Kong Securities and Futures Commission die Ernennung von PIMCO Europe GmbH als Unter-Anlageberatungsgesellschaft für die folgenden Fonds: PIMCO Asia High Yield Bond Fund, Asia Strategic Interest Bond Fund, Commodity Real Return Fund, Diversified Income Fund, Emerging Local Bond Fund, Emerging Markets Bond Fund, Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund, Global Bond Fund, Global High Yield Bond Fund, Global Investment Grade Credit Fund, Global Real Return Fund, Income Fund, Low Average Duration Fund, Total Return Bond Fund und US High Yield Bond Fund. Am 01. April 2021 wurde PIMCO Europe GmbH als Unter-Anlageberatungsgesellschaft für die oben genannten Teilfonds sowie für den PIMCO Climate Bond Fund und den Income Fund II ernannt.

Am 29. Januar 2021 wurde der Income Fund II aufgelegt.

Am 9. März 2021 wurden der Verkaufsprospekt und die Ergänzungen für das Unternehmen gemäß der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR) aktualisiert und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen. Darüber hinaus wurden an diesem Tag die Anlageziele des Emerging Markets Bond ESG Fund, des Global Bond ESG Fund und des Global Investment Grade Credit ESG Fund dahingehend geändert, dass sie nachhaltige Anlagen einschließen und somit speziell auf nachhaltige Anlagen ausgerichtet sind.

Am 23. April 2021 wurde eine Rücknahme in Höhe von USD 14.500.000 im US Short-Term Fund von der Verwaltungsgesellschaft durchgeführt.

Am 29. April 2021 wurde der PIMCO ESG Income Fund aufgelegt.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Berichtszeitraums keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

22. EREIGNISSE NACH ABSCHLUSS DES BERICHTSZEITRAUMS

Am 01. Juli 2021 änderte sich die eingetragene Adresse der Verwaltungsgesellschaft von 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irland in folgende Adresse: Third Floor, Harcourt Building, Harcourt Street, Dublin, D02 F721, Irland. Am selben Datum wurde der Vergleichsindex, der von einzelnen Teilfonds der Gesellschaft für Performancevergleiche herangezogen wird (die Vergleiche werden auch zur Darstellung der vergangenen Performance in den KIIDs für jeden relevanten Teilfonds verwendet werden), wie unten näher erläutert, geändert. Die Änderungen wurden aufgrund des Vorhabens der FCA vorgenommen, die Anwendung des LIBOR bis Ende 2021 auslaufen zu lassen. Zwar sollen die EURIBOR-Sätze weiterhin verfügbar bleiben. Die Änderungen am EURIBOR wurden aber vorgenommen, weil der neue Vergleichsindex (wie unten beschrieben) künftig zum maßgeblichen Referenzsatz für die Euro-Bargeldmärkte werden soll.

Fonds	Bisheriger Vergleichsindex	Aktueller Vergleichsindex seit 1. Juli 2021
Dynamic Multi-Asset Fund	1 Month Euribor	ICE BofA ESTR Overnight Rate Index
Euro-Short Term Fund	1 Month Euribor	ICE BofA ESTR Overnight Rate Index

Darüber hinaus werden die Anteilsklassen der Teilfonds der Gesellschaft mit einer früheren Performance gegenüber einem der betroffenen Vergleichsindizes zu gegebener Zeit ihre frühere Performance in Bezug auf den aktualisierten Vergleichsindex anzeigen.

Aktueller Vergleichsindex	Neuer Vergleichsindex
Anteilsklassen mit Vergleichsindex GBP LIBOR	ICE BofA SONIA Overnight Rate Index (Sterling Overnight Index Average)
Anteilsklassen mit Vergleichsindex CHF LIBOR	ICE BofA SARON Overnight Rate Index (Swiss Average Rate Overnight)
Anteilsklassen mit Vergleichsindex EURIBOR	ICE BofA ESTR Overnight Rate Index (Euro Short-Term Rate)

Am selben Datum wurden die Ergänzungen für den Dynamic Multi-Asset Fund und den Euro Short-Term Fund unter Vorwegnahme des Auslaufens bestimmter IBOR-Sätze zwecks Anpassung an die Änderungen an von den Teilfonds verwendeten Vergleichsindizes aktualisiert. Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren nach Abschluss des Berichtszeitraums keine relevanten Ereignisse zu verzeichnen.

Während des Berichtszeitraums legte die Verwaltungsgesellschaft fest, dass die Gründungskosten für den Global Bond ESG Fund, den Global Investment Grade Credit ESG Fund, den Global Libor Plus Bond Fund, den Low Duration Global Investment Grade Credit Fund, den Low Duration Income Fund, den PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund, den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund und den US Investment Grade Corporate Bond Fund (die „Teilfonds“) für weitere zwei Jahre in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2015 zum 31. Dezember 2019 erstattet wurden.

23. GENEHMIGUNG VON FINANZABSCHLÜSSEN

Dieser Abschluss wurde am 20. August 2021 vom Verwaltungsrat genehmigt.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. Juni 2021		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	42.660.979	\$ 424.987	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	29.562.453	\$ 294.500
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 26.04.2024	\$ 34.000	34.296	China Evergrande Group 9,500 % fällig am 11.04.2022	\$ 17.700	17.292
Lenovo Group Ltd. 5,875 % fällig am 24.04.2025	26.200	29.763	Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029	15.110	15.312
NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % fällig am 10.03.2028	29.000	29.000	Vedanta Resources Finance PLC 8,000 % fällig am 23.04.2023	15.650	15.139
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3,750 % fällig am 30.03.2026	26.900	26.984	AIA Group Ltd. 2,700 % fällig am 07.04.2026	14.600	14.639
China Evergrande Group 7,500 % fällig am 28.06.2023	30.200	25.971	Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	12.600	13.635
China Evergrande Group 8,750 % fällig am 28.06.2025	31.400	25.616	SK Battery America, Inc. 2,125 % fällig am 26.01.2026	12.300	12.164
Vedanta Resources Finance PLC 8,950 % fällig am 11.03.2025	25.450	25.332	TML Holdings Pte. Ltd. 5,500 % fällig am 03.06.2024	11.200	11.644
Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029	23.710	23.909	Levc Finance Ltd. 1,375 % fällig am 25.03.2024	10.300	10.333
Central China Real Estate Ltd. 6,875 % fällig am 08.08.2022	22.700	22.435	Agile Group Holdings Ltd. 6,875 % fällig am 07.09.2021	10.000	10.225
Scenery Journey Ltd. 11,500 % fällig am 24.10.2022	23.600	22.247	China Evergrande Group 8,250 % fällig am 23.03.2022	10.300	10.086
Krung Thai Bank PCL 4,400 % fällig am 25.03.2026	20.800	20.848	Perenti Finance Pty. Ltd. 6,500 % fällig am 07.10.2025	8.334	8.800
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,750 % fällig am 28.09.2023	20.600	20.699	Scenery Journey Ltd. 11,500 % fällig am 24.10.2022	9.300	8.796
Vedanta Resources Finance PLC 8,000 % fällig am 23.04.2023	22.200	20.171	Times China Holdings Ltd. 6,200 % fällig am 22.03.2026	8.600	8.611
Pakistan Government International Bond 6,000 % fällig am 08.04.2026	19.700	20.052	Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % fällig am 30.06.2024	9.000	8.605
Oman Government International Bond 7,000 % fällig am 25.01.2051	19.100	19.379	China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd. 3,080 % fällig am 09.12.2025	8.200	8.355
Pakistan Government International Bond 6,875 % fällig am 05.12.2027	17.700	18.717	China Evergrande Group 4,250 % fällig am 14.02.2023	HKD 63.000	8.127
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % fällig am 30.06.2024	18.800	18.532	Yuzhou Group Holdings Co. Ltd. 6,350 % fällig am 13.01.2027	\$ 9.500	7.758
Pakuwon Jati Tbk PT 4,875 % fällig am 29.04.2028	17.400	17.648	Kaisa Group Holdings Ltd. 9,750 % fällig am 28.09.2023	7.400	7.616
SK Battery America, Inc. 2,125 % fällig am 26.01.2026	17.300	17.224	GLP China Holdings Ltd. 2,950 % fällig am 29.03.2026	7.300	7.274

(a) Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			VERKAUFE BIS 30. Juni 2021		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	6.104.145	\$ 60.809	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	5.802.165	\$ 57.800
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3,75 % fällig am 30.03.2026	\$ 4.850	4.868	SK Battery America, Inc. 2,125 % fällig am 26.01.2026	\$ 2.700	2.662
NAVER Corp. 1,500 % fällig am 29.03.2026	4.100	4.095	Indonesia Treasury Bond 8,125 % fällig am 15.05.2024	IDR 33.350.000	2.549
AIA Group Ltd. 2,700 % fällig am 07.04.2026	4.000	4.008	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,150 % fällig am 29.03.2027	\$ 2.200	2.525
Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.09.2026	IDR 42.635.000	3.373	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,400 % fällig am 01.03.2028	2.200	2.487
Export-Import Bank of Korea 2,500 % fällig am 29.06.2041	\$ 3.100	3.076	China Evergrande Group 8,250 % fällig am 23.03.2022	2.400	2.350
CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 3,875 % fällig am 19.06.2029	3.000	3.075	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 2,700 % fällig am 13.05.2030	2.200	2.220
Vedanta Resources Finance PLC 8,000 % fällig am 23.04.2023	3.200	2.935	Tencent Holdings Ltd. 3,240 % fällig am 03.06.2050	2.000	2.024
Yango Group Co. Ltd. 6,900 % fällig am 31.10.2022	CNY 20.000	2.929	Vedanta Resources Finance PLC 8,000 % fällig am 23.04.2023	1.900	1.837
Bank Mandiri Persero Tbk PT 2,000 % fällig am 19.04.2026	\$ 2.800	2.776	Airport Authority Hong Kong 2,400 % fällig am 08.03.2028	1.800	1.784
SK Battery America, Inc. 2,125 % fällig am 26.01.2026	2.700	2.688	BDO Unibank, Inc. 2,125 % fällig am 13.01.2026	1.700	1.748
Krung Thai Bank PCL 4,400 % fällig am 25.03.2026	2.600	2.604	Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	1.600	1.725
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 4,250 % fällig am 12.09.2028	2.300	2.594	Tencent Holdings Ltd. 3,840 % fällig am 22.04.2051	1.600	1.633
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,400 % fällig am 01.03.2028	2.200	2.560	Sands China Ltd. 5,400 % fällig am 08.08.2028	1.300	1.501
Pakistan Government International Bond 6,000 % fällig am 08.04.2026	2.500	2.543	Huaxin Cement International Finance Co. Ltd. 2,250 % fällig am 19.11.2025	1.500	1.489
Development Bank of the Philippines 2,375 % fällig am 11.03.2031	2.400	2.381	BOC Aviation Ltd. 2,625 % fällig am 17.09.2030	1.500	1.459
ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd. 3,125 % fällig am 16.07.2025	2.300	2.335	China Evergrande Group 4,250 % fällig am 14.02.2023	HKD 11.000	1.419
Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % fällig am 13.01.2026	2.300	2.316	Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030	\$ 1.300	1.362
Central China Real Estate Ltd. 6,875 % fällig am 08.08.2022	2.200	2.167	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 4,600 % fällig am 12.09.2048	1.100	1.352
Tencent Holdings Ltd. 3,940 % fällig am 22.04.2061	2.100	2.148	Scenery Journey Ltd. 13,000 % fällig am 06.11.2022	1.400	1.292

(a) Der Asia Strategic Interest Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			VERKAUFE BIS 30. Juni 2021		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	40.698.413	\$ 405.439	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	57.135.591	\$ 569.159
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	2.219.400	225.407			
	PARI (000S)		Bank of America Corp. 1,319 % fällig am 19.06.2026	\$ 80.500	81.674
Abertis Infraestructuras Finance BV 2,625 % fällig am 26.01.2027	€ 71.600	85.229	HSBC Holdings PLC 5,875 % fällig am 28.09.2026	£ 42.800	64.240
	AKTIEN		Natwest Group PLC 4,269 % fällig am 22.03.2025	\$ 58.171	63.327
Bank of America Corp.	2.394.700	83.846	KBC Group NV 4,250 % fällig am 24.10.2025	€ 47.000	60.498
	PARI (000S)		Credit Agricole S.A. 7,500 % fällig am 23.09.2021	£ 24.200	39.250
BNP Paribas S.A. 4,625 % fällig am 25.02.2031	\$ 59.300	59.300	Barclays PLC 3,250 % fällig am 17.01.2033	25.050	38.417
	AKTIEN		Virgin Money UK PLC 4,000 % fällig am 25.09.2026	23.000	34.820
Goldman Sachs Group, Inc.	187.698	59.231		AKTIEN	
	PARI (000S)		Bank of America Corp.	812.252	33.192
Banco Santander S.A. 4,125 % fällig am 12.11.2027	€ 38.000	45.824		PARI (000S)	
	AKTIEN		Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % fällig am 15.01.2026	€ 23.000	31.568
Lloyds Banking Group PLC	76.844.800	44.451	Wells Fargo & Co. 3,000 % fällig am 22.04.2026	\$ 27.500	30.057
	PARI (000S)		UBS Group AG 4,125 % fällig am 24.09.2025	26.700	30.008
Cooperatieve Rabobank UA 3,100 % fällig am 29.06.2028	€ 37.200	44.363	JPMorgan Chase & Co. 3,220 % fällig am 01.03.2025	27.000	29.134
	AKTIEN		Intesa Sanpaolo SpA 5,148 % fällig am 10.06.2030	£ 17.400	28.051
Wells Fargo & Co.	1.201.700	41.079	Credit Agricole S.A. 4,000 % fällig am 23.12.2027	€ 21.000	27.801
	PARI (000S)		Lloyds Banking Group PLC 7,625 % fällig am 27.06.2023	£ 17.600	26.269
Aroundtown S.A. 3,375 % fällig am 23.09.2024	€ 31.800	39.610	ING Groep NV 4,875 % fällig am 16.05.2029	\$ 24.000	24.901
Natwest Group PLC 4,600 % fällig am 28.06.2031	\$ 32.100	32.100	Credit Suisse Group AG 4,282 % fällig am 09.01.2028	21.950	24.451
Legal & General Group PLC 5,625 % fällig am 24.03.2031	£ 20.800	31.772		AKTIEN	
UBS Group AG 4,375 % fällig am 10.02.2031	\$ 30.200	30.219	UBS Group AG	1.576.600	24.375
Vodafone Group PLC 3,000 % fällig am 27.08.2080	€ 24.700	30.190		PARI (000S)	
Deutsche Bank AG 4,625 % fällig am 30.10.2027	24.800	29.855	BNP Paribas S.A. 4,625 % fällig am 25.02.2031	\$ 23.000	23.602
Standard Chartered PLC 4,750 % fällig am 14.01.2031	\$ 28.500	28.500	ABN AMRO Bank NV 4,375 % fällig am 22.09.2025	€ 17.600	22.895
Intesa Sanpaolo SpA 5,875 % fällig am 01.09.2031	€ 20.000	27.091	Lloyds Banking Group PLC 7,500 % fällig am 27.09.2025	\$ 19.000	22.130
Natwest Group PLC 4,500 % fällig am 31.03.2028	£ 19.200	26.549	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023	€ 16.600	21.752
Bayer AG 3,125 % fällig am 12.11.2079	€ 21.100	25.787	Nordea Bank Abp 6,625 % fällig am 26.03.2026	\$ 18.800	21.633
CNP Assurances 4,875 % fällig am 07.10.2030	\$ 24.800	24.800	BNP Paribas S.A. 3,500 % fällig am 16.11.2027	19.500	21.455
Natwest Group PLC 5,125 % fällig am 12.05.2027	£ 16.500	24.372	Lloyds Banking Group PLC 2,707 % fällig am 03.12.2035	£ 15.022	21.140
	AKTIEN		Bankinter S.A. 0,875 % fällig am 08.07.2026	€ 17.000	20.994
UBS Group AG	1.576.600	24.275		AKTIEN	
	PARI (000S)		Wells Fargo & Co.	469.204	20.958
HSBC Holdings PLC 4,000 % fällig am 09.03.2026	\$ 24.200	24.200		PARI (000S)	
			Nationwide Building Society 3,960 % fällig am 18.07.2030	\$ 17.500	19.632
			UBS Group AG 3,126 % fällig am 13.08.2030	18.100	19.428
			Goldman Sachs Group, Inc. 3,691 % fällig am 05.06.2028	17.000	19.385
			Bank of America Corp. 0,654 % fällig am 26.10.2031	€ 16.000	19.023
			AIB Group PLC 5,250 % fällig am 09.10.2024	14.100	18.356

(a) Der PIMCO Capital Securities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung PIMCO Climate Bond Fund

30. Juni 2021

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021		
BNP Paribas S.A. 0,500 % fällig am 04.06.2026	€ 4.100	\$ 4.949
Kojamo Oyj 0,875 % fällig am 28.05.2029	2.900	3.509
Santander UK Group Holdings PLC 2,896 % fällig am 15.03.2032	\$ 3.400	3.423
Verizon Communications, Inc. 1,500 % fällig am 18.09.2030	3.585	3.301
CTP NV 1,250 % fällig am 21.06.2029	€ 2.300	2.770
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (a)	\$ 2.203	2.448
EUROFIMA 0,010 % fällig am 23.06.2028	€ 2.000	2.436
Vmed O2 UK Financing PLC 4,750 % fällig am 15.07.2031	\$ 2.400	2.400
LeasePlan Corp. NV 0,250 % fällig am 23.02.2026	€ 2.000	2.398
Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	1.900	2.298
DTE Electric Co. 1,900 % fällig am 01.04.2028	\$ 2.200	2.198
Bank of America Corp. 0,981 % fällig am 25.09.2025	2.200	2.195
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	2.100	2.099
Chile Government International Bond 0,830 % fällig am 02.07.2031	€ 1.600	2.026
Regency Centers LP 2,950 % fällig am 15.09.2029	\$ 1.900	1.967
T-Mobile USA, Inc. 2,625 % fällig am 15.04.2026	1.900	1.917
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028	€ 1.500	1.820
Acef Holding S.C.A. 0,750 % fällig am 14.06.2028	1.500	1.816
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	1.500	1.804
Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	\$ 1.800	1.793
ReNew Power Pvt Ltd. 4,500 % fällig am 14.07.2028	1.700	1.696
Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % fällig am 16.03.2028	€ 1.400	1.667
Nidec Corp. 0,046 % fällig am 30.03.2026	1.400	1.656

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKAUFE BIS 30. Juni 2021		
Eversource Energy 1,650 % fällig am 15.08.2030	\$ 2.680	\$ 2.634
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (a)	2.207	2.399
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.11.2027	1.680	1.666
Westpac Banking Corp. 0,766 % fällig am 13.05.2031	€ 800	973
Bank Mandiri Persero Tbk PT 2,000 % fällig am 19.04.2026	\$ 700	696
Avangrid, Inc. 3,200 % fällig am 15.04.2025	638	687
Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875 % fällig am 15.01.2026	€ 500	661
Nokia Oyj 3,125 % fällig am 15.05.2028	500	645
Alibaba Group Holding Ltd. 2,700 % fällig am 09.02.2041	\$ 500	465
Rockefeller Foundation 2,492 % fällig am 01.10.2050	420	391
Level 3 Financing, Inc. 3,750 % fällig am 15.07.2029	350	354
Pacific Life Global Funding 1,375 % fällig am 14.04.2026	300	301
Nordstrom, Inc. 4,375 % fällig am 01.04.2030	300	299
adidas AG 0,625 % fällig am 10.09.2035	€ 200	241
Citigroup, Inc. 1,678 % fällig am 15.05.2024	\$ 225	231

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (a)	\$	74.698	\$ 80.959
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (a)		53.087	58.386
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030 (a)	€	39.747	51.754
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (a)	\$	40.615	44.172
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2031 (a)		38.173	41.594
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (a)		35.408	38.354
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (a)		29.381	31.959
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (a)		28.707	31.460
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (a)		26.490	28.833
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (a)		25.464	27.328
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (a)		23.806	25.391
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	¥	2.634.777	24.638
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2022 (a)	\$	21.980	22.522
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2023 (a)		17.218	18.089
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	106.000	16.765
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a)	\$	11.186	12.236
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (a)		6.233	7.048
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2021 (a)		6.835	6.963
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (a)		5.870	6.508
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 10.03.2031	¥	612.987	5.720

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKAUFE BIS 30. Juni 2021			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2031 (a)	\$	12.667	\$ 13.659
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2022 (a)		8.864	9.095
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (a)		6.013	6.631
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (a)		4.173	4.581
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2025	€	3.253	4.183
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (a)	\$	2.733	3.001
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (a)		2.823	2.911
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (a)		2.066	2.275
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2021 (a)		2.257	2.268
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030	€	1.700	2.160
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (a)	\$	1.855	2.093
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.11.2036	£	920	1.895
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2021 (a)	\$	1.534	1.547
U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 30.04.2026		1.000	996
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2039	£	304	647
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (a)	\$	497	640

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG			KOSTEN (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	39.622.373	\$	394.724
	PARI (000S)		
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£	65.400	90.546
Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€	71.200	84.853
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028		65.400	78.432
Peru Government International Bond 3,300 % fällig am 11.03.2041	\$	78.300	75.415
Madison Park Euro Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2032	€	58.000	68.211
Intesa Sanpaolo SpA 5,500 % fällig am 01.03.2028		49.379	64.186
Unipol Gruppo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2030		46.800	60.375
Sands China Ltd. 3,800 % fällig am 08.01.2026	\$	57.200	60.342
UPC Broadband Finco BV 4,875 % fällig am 15.07.2031		56.900	56.900
Griffith Park CLO DAC 0,720 % fällig am 21.11.2031	€	45.500	54.186
Egypt Government International Bond 7,500 % fällig am 16.02.2061	\$	49.200	49.200
South Africa Government International Bond 5,750 % fällig am 30.09.2049		50.100	48.890
Q-Park Holding BV 3,500 % fällig am 01.02.2025	€	38.350	45.704
Casino Guichard Perrachon S.A. 4,000 % fällig am 31.08.2025		37.500	43.868
Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,125 % fällig am 22.10.2025	\$	41.800	41.847
Ivory Coast Government International Bond 6,625 % fällig am 22.03.2048	€	29.600	39.856
Oman Government International Bond 6,250 % fällig am 25.01.2031	\$	39.700	39.700
Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % fällig am 18.03.2033	€	33.100	39.098
Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026		31.800	38.750
Indonesia Government International Bond 1,100 % fällig am 12.03.2033		29.900	36.400
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029	\$	35.800	35.800

BESCHREIBUNG			AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. Juni 2021				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	31.860.840	\$		317.400
	PARI (000S)			
Deutsche Bank AG 4,250 % fällig am 14.10.2021	\$	63.075		64.449
South Africa Government International Bond 5,875 % fällig am 16.09.2025		55.800		62.254
Jaguar Land Rover Automotive PLC 6,875 % fällig am 15.11.2026	€	41.400		55.947
Silverstone Master Issuer PLC 0,799 % fällig am 21.01.2070	£	35.574		49.352
Wells Fargo & Co. 2,406 % fällig am 30.10.2025	\$	43.290		45.331
Peru Government International Bond 3,300 % fällig am 11.03.2041		44.100		42.629
Bank of China Ltd. 1,250 % fällig am 24.06.2025		42.400		42.266
Jaguar Land Rover Automotive PLC 6,875 % fällig am 15.11.2026	€	29.800		40.259
ELO SACA 3,250 % fällig am 23.07.2027		28.100		38.903
Kazakhstan Government International Bond 5,125 % fällig am 21.07.2025	\$	28.800		34.022
Goldman Sachs Group, Inc. 0,013 % fällig am 21.04.2023	€	27.454		32.707
Bank of China Ltd. 0,884 % fällig am 24.06.2023	\$	25.600		25.754
Transocean, Inc. 8,000 % fällig am 01.02.2027		46.414		24.169
Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 01.12.2021	€	18.246		22.056
Fortune Star BVI Ltd. 5,950 % fällig am 19.10.2025	\$	20.400		21.394
Nokia Oyj 3,125 % fällig am 15.05.2028	€	16.100		20.761
Indonesia Government International Bond 4,125 % fällig am 15.01.2025	\$	18.800		20.642
Sysco Corp. 5,650 % fällig am 01.04.2025		16.930		19.685
Tencent Holdings Ltd. 1,810 % fällig am 26.01.2026		19.000		19.323
Lloyds Bank Corporate Markets PLC 1,500 % fällig am 23.06.2023	£	13.400		18.765
CNOOC Finance Ltd. 3,000 % fällig am 09.05.2023	\$	17.700		18.241
QVC, Inc. 5,450 % fällig am 15.08.2034		17.633		17.640
Energy Transfer Partners LP 5,875 % fällig am 01.03.2022		16.800		17.355

(a) Der Diversified Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung Diversified Income Duration Hedged Fund 30. Juni 2021

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			VERKÄUFE BIS 30. Juni 2021		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	2.208.693	\$ 22.003	Deutsche Bank AG 4,250 % fällig am 14.10.2021	\$ 7.300	\$ 7.460
	PARI (000S)		South Africa Government International Bond 5,875 % fällig am 16.09.2025	4.600	5.132
Harvest CLO DAC 0,650 % fällig am 26.06.2030	€ 6.900	8.283	Kazakhstan Government International Bond 5,125 % fällig am 21.07.2025	4.200	4.962
Madison Park Euro Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2032	7.000	8.232	Peru Government International Bond 3,300 % fällig am 11.03.2041	4.200	4.058
Intesa Sanpaolo SpA 5,500 % fällig am 01.03.2028	6.100	7.944	Jaguar Land Rover Automotive PLC 6,875 % fällig am 15.11.2026	€ 2.900	3.921
Peru Government International Bond 3,300 % fällig am 11.03.2041	\$ 7.600	7.341	Wells Fargo & Co. 2,406 % fällig am 30.10.2025	\$ 3.610	3.781
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 5.100	7.061	Indonesia Government International Bond 4,125 % fällig am 15.01.2025	3.400	3.733
Asset-Backed Funding Certificates Trust 0,312 % fällig am 25.10.2036	\$ 7.629	6.987	ELO SACA 3,250 % fällig am 23.07.2027	€ 2.600	3.600
UPC Broadband Finco BV 4,875 % fällig am 15.07.2031	5.900	5.900	AKTIEN		
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 4.800	5.756	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	351.341	3.500
Unipol Gruppo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2030	3.500	4.510	PARI (000S)		
Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,125 % fällig am 22.10.2025	\$ 4.500	4.505	Jaguar Land Rover Automotive PLC 6,875 % fällig am 15.11.2026	€ 2.300	3.109
Casino Guichard Perrachon S.A. 4,000 % fällig am 31.08.2025	€ 3.700	4.328	Transocean, Inc. 8,000 % fällig am 01.02.2027	\$ 4.800	2.501
Sands China Ltd. 3,800 % fällig am 08.01.2026	\$ 4.100	4.325	Energy Transfer Partners LP 5,875 % fällig am 01.03.2022	2.400	2.479
Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 3.600	4.289	UBS AG 7,625 % fällig am 17.08.2022	2.200	2.423
Egypt Government International Bond 7,500 % fällig am 16.02.2061	\$ 4.000	4.000	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 01.12.2021	€ 1.900	2.295
South Africa Government International Bond 5,750 % fällig am 30.09.2049	4.000	3.904	NatWest Markets PLC 2,375 % fällig am 21.05.2023	\$ 1.900	1.981
Vmed O2 UK Financing PLC 4,500 % fällig am 15.07.2031	£ 2.800	3.897	Sysco Corp. 5,650 % fällig am 01.04.2025	1.700	1.977
Petroleos Mexicanos 6,750 % fällig am 21.09.2047	\$ 4.200	3.722	Nokia Oyj 3,125 % fällig am 15.05.2028	€ 1.500	1.934
Q-Park Holding BV 3,500 % fällig am 01.02.2025	€ 3.100	3.694	Deutsche Bank AG 3,375 % fällig am 12.05.2021	\$ 1.900	1.914
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	2.900	3.501	Lloyds Bank Corporate Markets PLC 1,500 % fällig am 23.06.2023	£ 1.300	1.820
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029	\$ 3.200	3.200	Morgan Stanley 4,000 % fällig am 23.07.2025	\$ 1.600	1.787
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % fällig am 28.04.2025	€ 2.500	3.110	CNOOC Finance Ltd. 3,000 % fällig am 09.05.2023	1.700	1.752
Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % fällig am 18.03.2033	2.600	3.071	Tencent Holdings Ltd. 1,810 % fällig am 26.01.2026	1.700	1.729
Oman Government International Bond 6,250 % fällig am 25.01.2031	\$ 3.000	3.000	Deutsche Bank AG 5,000 % fällig am 14.02.2022	1.600	1.668
Ivory Coast Government International Bond 6,625 % fällig am 22.03.2048	€ 2.200	2.963	NatWest Group PLC 1,626 % fällig am 15.05.2023	1.500	1.517
			DaVita, Inc. 4,625 % fällig am 01.06.2030	1.400	1.423
			Angolan Government International Bond 8,000 % fällig am 26.11.2029	1.400	1.384
			Quicken Loans LLC 5,250 % fällig am 15.01.2028	1.300	1.361
			Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 1,700 % fällig am 02.03.2031	1.400	1.335
			Petronas Capital Ltd. 7,875 % fällig am 22.05.2022	1.200	1.312
			Eastern Creation Investment Holdings Ltd. 1,000 % fällig am 10.09.2023	1.200	1.198
			Ally Financial, Inc. 3,050 % fällig am 05.06.2023	1.100	1.152

(a) Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021				VERKÄUFE BIS 30. Juni 2021			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		25.550.988	\$ 254.549	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		19.312.617	\$ 192.400
		PARI (000S)				PARI (000S)	
Australia Government International Bond 2,500 % fällig am 21.05.2030	AUD	48.300	40.169	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 30.04.2021	\$	42.100	42.315
U.S. Treasury Notes 0,500 % fällig am 28.02.2026	\$	30.100	29.667	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2027 (b)		31.940	39.311
Harvest CLO DAC 0,650 % fällig am 26.06.2030	€	13.000	15.607	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b)		29.706	38.414
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2022	ILS	44.400	13.621	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)		21.990	24.757
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,750 % fällig am 15.11.2031	€	11.100	13.419	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)		21.522	24.063
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028		10.100	12.081	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b)		18.258	21.317
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 0,720 % fällig am 15.01.2031		9.500	11.456	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b)		15.235	18.502
Dryden Euro CLO BV 0,660 % fällig am 15.04.2033		8.900	10.789	ONEOK, Inc. 4,550 % fällig am 15.07.2028		11.400	12.967
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£	7.600	10.522	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)		9.919	10.964
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,700 % fällig am 15.01.2031	€	6.500	7.934	BNP Paribas S.A. 3,375 % fällig am 09.01.2025		10.000	10.790
HSBC Holdings PLC 1,750 % fällig am 24.07.2027	£	5.200	7.210	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)		9.644	10.518
Twin Bridges PLC 0,899 % fällig am 12.03.2055		5.100	7.190	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030		10.500	9.979
Dryden Euro CLO BV 0,860 % fällig am 15.05.2034	€	5.800	7.024	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b)		8.302	9.836
UCB S.A. 1,000 % fällig am 30.03.2028		5.700	6.750	U.S. Bank N.A. 3,400 % fällig am 24.07.2023		6.800	7.252
DEI Sales, Inc. 6,250 % fällig am 23.04.2028	\$	6.700	6.600	ONEOK, Inc. 4,350 % fällig am 15.03.2029		4.900	5.588
Cairn CLO BV 0,780 % fällig am 15.10.2031	€	5.300	6.433	Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA 2,125 % fällig am 28.11.2024	€	4.400	5.313
Coty, Inc. 5,000 % fällig am 15.04.2026	\$	6.300	6.300	Citigroup, Inc. 3,668 % fällig am 24.07.2028	\$	4.600	5.115
North Westerly CLO BV 0,910 % fällig am 20.04.2031	€	5.000	6.097	Kuwait International Government Bond 3,500 % fällig am 20.03.2027		4.000	4.428
Banco Santander S.A. 1,500 % fällig am 14.04.2026	£	4.400	6.083	AerCap Ireland Capital DAC 4,450 % fällig am 01.10.2025		3.900	4.261

(a) Der Dynamic Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			
German Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.09.2021	€	83.520	€ 83.730
Canada Government International Bond 2,250 % fällig am 01.06.2029	CAD	98.348	70.350
		AKTIEN	
AP Moller - Maersk A/S 'B'		32.200	63.344
Luminar Technologies, Inc.		2.288.300	50.685
Freeport-McMoRan, Inc.		1.374.200	41.690
ASML Holding NV		73.600	39.545
Ambarella, Inc.		405.500	37.534
ams AG		1.907.300	37.451
Velodyne Lidar, Inc.		2.497.700	35.760
West Fraser Timber Co. Ltd.		571.200	34.377
Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd.		24.614.212	32.399
COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. 'H'		23.984.506	31.769
United Microelectronics Corp.		22.170.819	31.635
Baidu, Inc. SP - ADR		165.200	28.314
Stora Enso Oyj 'R'		1.657.900	27.709
Fortum Oyj		1.285.700	27.493
Intel Corp.		513.100	27.264
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.		1.551.909	27.194
UPM-Kymmene Oyj		838.900	27.130
Invesco Physical Gold ETC		171.300	26.265
Hamamatsu Photonics KK		504.900	26.046
		PARI (000S)	
France Government International Bond 3,250 % fällig am 25.10.2021	€	25.000	25.318
		AKTIEN	
Hitachi Zosen Corp.		4.481.100	24.908
SITC International Holdings Co. Ltd.		10.124.716	24.693
New Horizon Health Ltd.		3.039.560	24.458
Vestas Wind Systems A/S		764.900	24.397
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.		56.700	23.740
Aker Carbon Capture A/S		12.122.418	22.803
Canfor Corp.		1.082.800	22.792

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKAUFE BIS 30. Juni 2021			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (a)	\$	229.749	€ 209.535
		AKTIEN	
Invesco Physical Gold ETC		1.302.900	189.673
Invesco Physical Gold ETC		858.800	123.997
		PARI (000S)	
Canada Government International Bond 2,250 % fällig am 01.06.2029	CAD	98.348	70.351
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.02.2041 (a)	\$	57.001	68.400
		AKTIEN	
Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd.		10.425.900	40.571
AP Moller - Maersk A/S 'B'		15.600	36.942
Tesla, Inc.		68.900	35.211
NVIDIA Corp.		63.000	32.248
Pinduoduo, Inc.		206.300	27.100
NIO, Inc.		835.900	26.757
Alphabet, Inc. 'C'		16.750	26.355
BYD Co. Ltd. 'H'		1.294.650	24.448
Eaton Corp. PLC		190.300	23.097
Maxim Integrated Products, Inc.		295.700	22.393
Lam Research Corp.		45.500	21.691
		PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.02.2044 (a)	\$	19.607	21.125
		AKTIEN	
COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. 'H'		10.126.400	20.685
SITC International Holdings Co. Ltd.		6.337.700	20.274
JD.com, Inc.		536.700	19.907

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		143.338.410	\$ 1.427.925
		PARI (000S)	
China Government Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027	CNY	665.200	103.537
Israel Government International Bond 0,750 % fällig am 31.07.2022	ILS	170.600	51.654
Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP	146.644.000	42.808
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	520.900	40.404
Malaysia Government Investment Issue 3,465 % fällig am 15.10.2030	MYR	140.100	33.752
		AKTIEN	
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		320.800	32.594
		PARI (000S)	
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2022	ILS	102.300	31.299
Malaysia Government International Bond 3,733 % fällig am 15.06.2028	MYR	100.800	26.362
Poland Government International Bond 1,250 % fällig am 25.10.2030	PLN	104.200	26.022
Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR	89.600	24.335
Russia Government International Bond 5,700 % fällig am 17.05.2028	RUB	1.794.100	24.212
Egypt Government International Bond 13,765 % fällig am 05.01.2024	EGP	370.700	23.518
Colombian TES 10,000 % fällig am 24.07.2024	COP	67.562.700	20.723
Singapore Government International Bond 3,375 % fällig am 01.09.2033	SGD	21.100	18.385
Thailand Government International Bond 1,600 % fällig am 17.12.2029	THB	575.200	18.290
Thailand Government International Bond 3,775 % fällig am 25.06.2032		488.200	18.266
China Government Bond 3,810 % fällig am 14.09.2050	CNY	110.200	17.489
Malaysia Government Investment Issue 4,417 % fällig am 30.09.2041	MYR	70.870	17.439
Turkey Government International Bond 16,200 % fällig am 14.06.2023	TRY	146.600	17.403

BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. Juni 2021			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		152.231.063	\$ 1.516.500
		PARI (000S)	
China Development Bank 4,040 % fällig am 10.04.2027	CNY	291.400	46.330
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	540.800	43.408
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 2,300 % fällig am 01.10.2028	CLP	30.040.000	42.147
Malaysia Government Investment Issue 3,465 % fällig am 15.10.2030	MYR	140.100	34.720
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	432.500	33.428
Hungary Government International Bond 2,750 % fällig am 22.12.2026	HUF	9.130.400	31.990
Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP	110.580.600	31.678
Poland Government International Bond 2,500 % fällig am 25.07.2027	PLN	104.300	31.041
Poland Government International Bond 5,750 % fällig am 23.09.2022		105.580	30.061
Hungary Government International Bond 1,500 % fällig am 22.04.2026	HUF	7.871.800	26.644
China Government Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027	CNY	162.800	25.578
Poland Government International Bond 2,500 % fällig am 25.07.2026	PLN	80.300	23.018
Petroleos Mexicanos 7,190 % fällig am 12.09.2024	MXN	494.600	22.189
Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN	66.700	21.103
Malaysia Government International Bond 3,733 % fällig am 15.06.2028	MYR	80.600	20.924
Mexican Bonos 6,750 % fällig am 09.03.2023	MXN	410.900	20.812
Mexican Bonos 8,000 % fällig am 07.12.2023		385.000	20.544
Mexico Government International Bond 7,750 % fällig am 13.11.2042		382.800	19.783
China Development Bank 4,040 % fällig am 06.07.2028	CNY	123.000	19.543

(a) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		105.816.138	\$ 1.054.135
		PARI (000S)	
Hazine Mustesartligi Varlik Kiralama A/S 5,125 % fällig am 22.06.2026	\$	52.300	52.308
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	289.300	22.406
Airport Authority Hong Kong 1,625 % fällig am 04.02.2031	\$	22.200	22.009
Saudi Government International Bond 2,250 % fällig am 02.02.2033		19.700	19.524
Ukraine Government International Bond 7,253 % fällig am 15.03.2033		16.600	16.592
Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2022		15.500	16.182
Petronas Capital Ltd. 3,404 % fällig am 28.04.2061		15.900	15.900
S.A. Global Sukuk Ltd. 2,694 % fällig am 17.06.2031		15.200	15.244
Absa Group Ltd. 6,375 % fällig am 27.05.2026		14.300	14.713
Petroleos Mexicanos 5,950 % fällig am 28.01.2031		15.400	14.635
Sasol Financing International Ltd. 4,500 % fällig am 14.11.2022		14.200	14.590
Peru Government International Bond 2,783 % fällig am 23.01.2031		14.400	14.459
Mexico Government International Bond 3,750 % fällig am 19.04.2071		14.200	14.200
Vale S.A. 0,000 % fällig am 29.12.2049	BRL	147.300	14.138
JPMorgan Structured Products BV 3,550 % fällig am 29.12.2021	€	11.600	13.895
Poinsettia Finance Ltd. 6,625 % fällig am 17.06.2031	\$	13.700	13.289
Oman Government International Bond 6,250 % fällig am 25.01.2031		13.200	13.200
Jordan Government International Bond 5,750 % fällig am 31.01.2027		12.000	12.996
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 3,800 % fällig am 23.06.2050		11.800	12.936

BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. Juni 2021			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		113.873.960	\$ 1.134.400
		PARI (000S)	
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,125 % fällig am 16.04.2030	\$	24.800	27.769
Airport Authority Hong Kong 1,625 % fällig am 04.02.2031		22.200	21.878
Qatar Government International Bond 4,000 % fällig am 14.03.2029		18.000	21.145
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd. 3,250 % fällig am 15.08.2030		19.800	20.117
Brazilian Government International Bond 3,875 % fällig am 12.06.2030		19.000	18.921
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 1,700 % fällig am 02.03.2031		19.200	18.334
Russia Government International Bond 6,000 % fällig am 06.10.2027	RUB	1.357.900	16.908
Peru Government International Bond 2,783 % fällig am 23.01.2031	\$	15.900	15.933
Jordan Government International Bond 5,850 % fällig am 07.07.2030		14.400	15.678
Russia Government International Bond 7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB	1.059.000	15.319
Hungary Government International Bond 1,500 % fällig am 17.11.2050	€	12.300	14.990
Russia Government International Bond 7,250 % fällig am 10.05.2034	RUB	1.062.000	14.949
Metinvest BV 7,750 % fällig am 17.10.2029	\$	13.550	14.043
Corp. Nacional del Cobre de Chile 4,250 % fällig am 17.07.2042		11.700	12.947
Dominican Republic Government International Bond 4,875 % fällig am 23.09.2032		12.100	12.533
Serbia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.05.2027	€	9.400	12.533
Indonesia Government International Bond 4,450 % fällig am 15.04.2070	\$	10.700	11.770
Latam Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.11.2027		11.663	11.663
Brazil Government International Bond 2,875 % fällig am 06.06.2025		11.000	11.206

(a) Der Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021		
Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2021	\$ 22.567	\$ 22.924
Panama Government International Bond 4,500 % fällig am 16.04.2050	16.800	18.996
Bahrain Government International Bond 4,250 % fällig am 25.01.2028	18.500	18.584
Hazine Mustesarliği Varlık Kiralama A/S 5,125 % fällig am 22.06.2026	17.800	17.800
Mirae Asset Securities Co. Ltd. 1,375 % fällig am 07.07.2024	17.600	17.577
Malaysia Wakala Sukuk Bhd. 2,070 % fällig am 28.04.2031	17.300	17.300
Senegal Government International Bond 6,250 % fällig am 23.05.2033	12.600	13.870
Panama Government International Bond 4,300 % fällig am 29.04.2053	12.400	13.335
Akbank T.A.S. 6,800 % fällig am 22.06.2031	13.000	13.000
Romania Government International Bond 2,124 % fällig am 16.07.2031	€ 10.510	12.975
Philippines Government International Bond 3,200 % fällig am 06.07.2046	\$ 12.900	12.790
Brazil Government International Bond 4,750 % fällig am 14.01.2050	11.900	11.592
Türkiye İhracat Kredi Bankası A/S 5,750 % fällig am 06.07.2026	11.600	11.538
Eastern & Southern African Trade & Development Bank 4,125 % fällig am 30.06.2028	11.600	11.513
South Africa Government International Bond 5,750 % fällig am 30.09.2049	11.400	11.418
Absa Group Ltd. 6,375 % fällig am 27.05.2026	11.200	11.304
Banco Davivienda S.A. 6,650 % fällig am 22.04.2031	11.000	11.028
Georgian Railway JSC 4,000 % fällig am 17.06.2028	11.000	11.023
Morocco Government International Bond 4,000 % fällig am 15.12.2050	11.800	10.988
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 139.100	10.966

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKAUFE BIS 30. Juni 2021		
Hungary Government International Bond 1,750 % fällig am 05.06.2035	€ 13.500	\$ 17.986
Peru Government International Bond 2,783 % fällig am 23.01.2031	\$ 11.900	12.197
Malaysia Sukuk Global Bhd. 3,179 % fällig am 27.04.2026	7.400	8.270
Bharti Airtel Ltd. 3,250 % fällig am 03.06.2031	8.500	8.224
Corp. Nacional del Cobre de Chile 4,250 % fällig am 17.07.2042	7.400	8.188
Airport Authority Hong Kong 1,625 % fällig am 04.02.2031	8.300	8.181
Ivory Coast Government International Bond 6,875 % fällig am 17.10.2040	€ 5.000	6.834
Brazilian Government International Bond 3,875 % fällig am 12.06.2030	\$ 6.800	6.771
North Macedonia Government International Bond 1,625 % fällig am 10.03.2028	€ 5.900	6.757
Peru Government International Bond 2,392 % fällig am 23.01.2026	\$ 6.200	6.569
Russia Government International Bond 5,900 % fällig am 12.03.2031	RUB 516.900	6.477
Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	\$ 5.600	6.077
Colombia Government International Bond 3,875 % fällig am 25.04.2027	5.200	5.767
Mexico Government International Bond 1,350 % fällig am 18.09.2027	€ 4.500	5.498
Benin Government International Bond 6,875 % fällig am 19.01.2052	4.300	5.488
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,125 % fällig am 16.04.2030	\$ 4.700	5.263
Mexico Government International Bond 4,750 % fällig am 27.04.2032	4.600	5.143
Qatar Government International Bond 4,000 % fällig am 14.03.2029	4.100	4.817
Dominican Republic Government International Bond 6,000 % fällig am 19.07.2028	4.100	4.644
Banque Ouest Africaine de Developpement 2,750 % fällig am 22.01.2033	€ 3.550	4.519
Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 27.04.2051	\$ 3.650	3.969
Indonesia Government International Bond 4,450 % fällig am 15.04.2070	3.600	3.960
Russia Government International Bond 7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB 291.000	3.946
PLDT, Inc. 3,450 % fällig am 23.06.2050	\$ 3.900	3.920
Chile Government International Bond 2,450 % fällig am 31.01.2031	3.800	3.874
Peru Government International Bond 3,300 % fällig am 11.03.2041	3.900	3.814
MAF Sukuk Ltd. 3,933 % fällig am 28.02.2030	3.500	3.754
Airport Authority 2,625 % fällig am 04.02.2051	3.900	3.717
Kenya Government International Bond 8,250 % fällig am 28.02.2048	3.200	3.469
Brazil Government International Bond 2,875 % fällig am 06.06.2025	3.400	3.464
Hungary Government International Bond 1,500 % fällig am 17.11.2050	€ 2.800	3.412
Corp. Nacional del Cobre de Chile 4,875 % fällig am 04.11.2044	\$ 2.800	3.350
Russia Government International Bond 4,375 % fällig am 21.03.2029	3.000	3.349
Panama Government International Bond 4,300 % fällig am 29.04.2053	3.000	3.273
Turkey Government International Bond 5,250 % fällig am 13.03.2030	3.400	3.149
Russia Government International Bond 7,250 % fällig am 10.05.2034	RUB 219.300	3.098
Latam Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.11.2027	\$ 2.984	2.984
Indonesia Government International Bond 3,050 % fällig am 12.03.2051	2.900	2.918

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung Emerging Markets Corporate Bond Fund 30. Juni 2021

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		7.508.789	\$ 74.802
		PARI (000S)	
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	35.500	2.809
Ecopetrol S.A. 6,875 % fällig am 29.04.2030	\$	2.000	2.449
Petrobras Global Finance BV 5,600 % fällig am 03.01.2031		2.000	2.238
CSN Inova Ventures 6,750 % fällig am 28.01.2028		1.700	1.853
MARB BondCo PLC 3,950 % fällig am 29.01.2031		1.800	1.800
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	17.400	1.470
BRF S.A. 4,875 % fällig am 24.01.2030	\$	1.300	1.360
Banco de Credito del Peru 2,700 % fällig am 11.01.2025		1.300	1.358
Braskem Netherlands Finance BV 4,500 % fällig am 10.01.2028		1.300	1.347
Banco de Credito e Inversiones S.A. 3,500 % fällig am 12.10.2027		1.200	1.329
Sovcombank Via SovCom Capital DAC 3,400 % fällig am 26.01.2025		1.300	1.300
Oman Government International Bond 6,250 % fällig am 25.01.2031		1.300	1.300
Mizrahi Tefahot Bank Ltd. 3,077 % fällig am 07.04.2031		1.300	1.300
Dominican Republic Government International Bond 5,300 % fällig am 21.01.2041		1.300	1.277
Banco Internacional del Peru SAA Interbank 3,250 % fällig am 04.10.2026		1.200	1.275
Banco Santander Chile 2,700 % fällig am 10.01.2025		1.200	1.270
Bank of China Ltd. 5,000 % fällig am 13.11.2024		1.100	1.241
Natura Cosméticos S.A. 4,125 % fällig am 03.05.2028		1.200	1.200
InRetail Consumer 3,250 % fällig am 22.03.2028		1.200	1.200

BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKAUFE BIS 30. Juni 2021			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		7.247.518	\$ 72.200
		PARI (000S)	
Lamar Funding Ltd. 3,958 % fällig am 07.05.2025	\$	2.600	2.588
BOC Aviation Ltd. 2,625 % fällig am 17.09.2030		2.500	2.440
Petrobras Global Finance BV 4,750 % fällig am 14.01.2025	€	1.600	2.199
Total Play Telecomunicaciones S.A. de C.V. 7,500 % fällig am 12.11.2025	\$	2.000	1.967
Latam Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.11.2027		1.806	1.806
NBM U.S. Holdings, Inc. 7,000 % fällig am 14.05.2026		1.600	1.722
MARB BondCo PLC 3,950 % fällig am 29.01.2031		1.800	1.705
Saudi Arabian Oil Co. 3,250 % fällig am 24.11.2050		1.800	1.672
Embraer Netherlands Finance BV 5,050 % fällig am 15.06.2025		1.600	1.671
JBS USA Food Co. 7,000 % fällig am 15.01.2026		1.500	1.600
Tencent Holdings Ltd. 2,390 % fällig am 03.06.2030		1.600	1.555
Gran Tierra Energy, Inc. 7,750 % fällig am 23.05.2027		1.900	1.480
Stillwater Mining Co. 7,125 % fällig am 27.06.2025		1.400	1.474
Samarco Mineracao S.A. 5,750 % fällig am 24.10.2023		1.800	1.450
Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance PLC 5,150 % fällig am 20.02.2024	€	1.100	1.409
Sovcombank Via SovCom Capital DAC 8,000 % fällig am 07.04.2030	\$	1.300	1.409
Adecoagro S.A. 6,000 % fällig am 21.09.2027		1.300	1.357
Axiata SPV2 Bhd. 2,163 % fällig am 19.08.2030		1.400	1.354
China Reinsurance Finance Corp. Ltd. 3,375 % fällig am 09.03.2022		1.300	1.322

(a) Der Emerging Markets Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		7.971.450	\$ 79.410
		PARI (000S)	
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	92.200	7.788
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2022	ILS	23.300	7.146
Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP	14.071.000	4.130
China Government Bond 3,270 % fällig am 19.11.2030	CNY	21.600	3.340
Transnet SOC Ltd. 9,500 % fällig am 13.05.2021	ZAR	49.300	3.266
Republic of Angola Via Avenir BV 4,665 % fällig am 07.12.2023	\$	3.120	3.005
Singapore Government International Bond 3,375 % fällig am 01.09.2033	SGD	3.300	2.876
1MDB Global Investments Ltd. 4,400 % fällig am 09.03.2023	\$	2.600	2.626
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	30.700	2.376
Ecuador Government International Bond 0,500 % fällig am 31.07.2030	\$	4.000	2.348
Iraq Government International Bond 5,800 % fällig am 15.01.2028		2.188	2.119
Guara Norte SARL 5,198 % fällig am 15.06.2034		2.000	2.013
Oracle Corp. 4,100 % fällig am 25.03.2061		1.900	1.980
Ecopetrol S.A. 6,875 % fällig am 29.04.2030		1.600	1.941
PTT Treasury Center Co. Ltd. 3,700 % fällig am 16.07.2070		2.000	1.915
Pacific Gas & Electric Co. 4,550 % fällig am 01.07.2030		1.700	1.898
T-Mobile USA, Inc. 3,600 % fällig am 15.11.2060		1.900	1.882
Charter Communications Operating LLC 3,850 % fällig am 01.04.2061		1.900	1.820
Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC 1,450 % fällig am 02.06.2026	€	1.400	1.714

BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. Juni 2021			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		8.733.352	\$ 87.000
		PARI (000S)	
Malaysia Government Investment Issue 4,128 % fällig am 15.08.2025	MYR	20.000	5.332
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN	13.100	4.651
South Africa Government International Bond 7,750 % fällig am 28.02.2023	ZAR	53.100	3.824
Malaysia Government International Bond 3,882 % fällig am 14.03.2025	MYR	14.000	3.692
Malaysia Government International Bond 3,955 % fällig am 15.09.2025		13.700	3.639
Mexico Government International Bond 7,750 % fällig am 13.11.2042	MXN	57.000	2.835
Hungary Government International Bond 3,250 % fällig am 22.10.2031	HUF	756.000	2.822
Hrvatska Elektroprivreda 5,875 % fällig am 23.10.2022	\$	2.300	2.499
Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP	6.753.800	2.095
Russia Government International Bond 7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB	143.400	2.046
Russia Government International Bond 7,250 % fällig am 10.05.2034		142.200	1.999
China Development Bank 4,040 % fällig am 10.04.2027	CNY	12.200	1.927
Hungary Government International Bond 3,000 % fällig am 26.06.2024	HUF	483.500	1.720
Colombian TES 7,000 % fällig am 04.05.2022	COP	5.472.900	1.637
Dominican Republic Government International Bond 12,000 % fällig am 05.03.2032	DOP	58.200	1.283
Sunac China Holdings Ltd. 7,250 % fällig am 14.06.2022	\$	1.100	1.125
Vale Overseas Ltd. 6,875 % fällig am 21.11.2036		800	1.097
Barclays PLC 3,684 % fällig am 10.01.2023		1.000	1.030
PTT Treasury Center Co. Ltd. 3,903 % fällig am 06.12.2059		1.000	998

(a) Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			
Israel Government International Bond 5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS	8.400	\$ 2.766
Czech Republic Government International Bond 0,100 % fällig am 17.04.2022	CZK	35.500	1.610
AKTIEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		140.599	1.401
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		11.800	1.198
PARI (000S)			
Malaysia Government International Bond 4,160 % fällig am 15.07.2021	MYR	4.400	1.077
Colombian TES 5,750 % fällig am 03.11.2027	COP	3.104.000	874
Colombian TES 10,000 % fällig am 24.07.2024		1.576.000	560
Mexico Government International Bond 10,000 % fällig am 05.12.2024	MXN	8.000	444
Brazilian Government International Bond 2,875 % fällig am 01.04.2021	€	300	367
Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	1.000	326
Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos 4,500 % fällig am 01.03.2021	CLP	180.000	249
Sands China Ltd. 5,125 % fällig am 08.08.2025	\$	200	224
MAF Global Securities Ltd. 4,750 % fällig am 07.05.2024		200	219
Growthpoint Properties International Pty. Ltd. 5,872 % fällig am 02.05.2023		200	216
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,250 % fällig am 23.05.2023		200	212
Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2022		200	210
CSN Resources S.A. 7,625 % fällig am 13.02.2023		200	209
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,700 % fällig am 27.02.2022		200	203
Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021		200	202
DAE Funding LLC 1,550 % fällig am 01.08.2024		200	199
XP, Inc. 3,250 % fällig am 01.07.2026		200	198
Mexico Government International Bond 7,750 % fällig am 13.11.2042	MXN	3.000	169
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2022	ILS	500	153

BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKAUFE BIS 30. Juni 2021			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		240.920	\$ 2.400
PARI (000S)			
Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos 0,000 % fällig am 01.07.2021	CLP	1.010.000	1.376
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	11.900	934
Colombian TES 10,000 % fällig am 24.07.2024	COP	1.576.000	545
AKTIEN			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		4.500	457
PARI (000S)			
Mexico Government International Bond 10,000 % fällig am 05.12.2024	MXN	8.000	440
Israel Government International Bond 5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS	1.000	319
Dominican Republic Government International Bond 9,750 % fällig am 05.06.2026	DOP	16.000	310
Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	1.000	310
Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028		900	269
Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos 4,500 % fällig am 01.03.2021	CLP	180.000	255
Egypt Government International Bond 14,605 % fällig am 08.09.2025	EGP	3.100	197
Huarong Finance Co. Ltd. 3,625 % fällig am 22.11.2021	\$	200	170
Mexico Government International Bond 7,750 % fällig am 13.11.2042	MXN	3.000	167
Huarong Finance Co. Ltd. 3,250 % fällig am 03.06.2021	\$	200	158
Argentina Government International Bond 1,000 % fällig am 05.08.2021	ARS	15.980	153
Mexico Government International Bond 8,000 % fällig am 07.11.2047	MXN	2.300	120
South Africa Government International Bond 5,875 % fällig am 30.05.2022	\$	100	105
Hungary Government International Bond 3,000 % fällig am 21.08.2030	HUF	20.600	73
Petroleos Mexicanos 7,190 % fällig am 12.09.2024	MXN	900	40

(a) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.05.2022	€	200	\$ 255
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.11.2059	\$	199	222
KB Kookmin Card Co. Ltd. 1,500 % fällig am 13.05.2026		200	200
Weir Group PLC 2,200 % fällig am 13.05.2026		200	200
Marks & Spencer PLC 4,500 % fällig am 10.07.2027	£	100	148
CaixaBank S.A. 1,500 % fällig am 03.12.2026		100	141
Nokia Oyj 3,125 % fällig am 15.05.2028	€	100	134
NE Property BV 3,375 % fällig am 14.07.2027		100	133
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028		100	121
CaixaBank S.A. 0,750 % fällig am 26.05.2028		100	121
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028		100	121
Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027		100	121
Acef Holding S.C.A. 0,750 % fällig am 14.06.2028		100	121
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3,000 % fällig am 01.09.2029		100	121
ZF Finance GmbH 2,000 % fällig am 06.05.2027		100	121
Verallia S.A. 1,625 % fällig am 14.05.2028		100	121
EQT AB 0,875 % fällig am 14.05.2031		100	120
CTP NV 1,250 % fällig am 21.06.2029		100	120
Cyrusone Europe Finance DAC 1,125 % fällig am 26.05.2028		100	119
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 2,611 % fällig am 25.11.2036	\$	115	113
Liberty Street Trust 4,501 % fällig am 10.02.2036		100	109
BNC Mortgage Loan Trust 0,452 % fällig am 25.10.2036		130	108
1211 Avenue of the Americas Trust 4,280 % fällig am 10.08.2035		100	105
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 1,217 % fällig am 25.02.2035		100	100
Renewable Energy Group, Inc. 5,875 % fällig am 01.06.2028		100	100
Argent Securities Trust 0,392 % fällig am 25.06.2036		127	100
Residential Accredit Loans, Inc. Trust 0,472 % fällig am 25.12.2036		104	100
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 0,737 % fällig am 25.04.2035		103	100
VeriSign, Inc. 2,700 % fällig am 15.06.2031		100	100
GSAMP Trust 0,992 % fällig am 25.11.2035		100	98
Banc of America Funding Trust 6,479 % fällig am 25.10.2036		92	91
Structured Asset Securities Corp. Trust 6,762 % fällig am 25.05.2031		97	91
Countrywide Asset-Backed Certificates 0,232 % fällig am 25.06.2047		89	85
Korea Development Bank 4,800 % fällig am 10.06.2023	IDR	1.150.000	81
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.02.2044 (a)	\$	45	61
Hudson Pacific Properties LP 3,950 % fällig am 01.11.2027		50	55

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung Euro Bond Fund

30. Juni 2021

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			
PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		1.631.000	€ 159.541
		PARI (000S)	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,250 % fällig am 15.03.2028	€	79.900	79.291
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % fällig am 01.04.2026		45.500	45.354
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052		26.900	29.132
Europäische Union 0,250 % fällig am 22.04.2036		27.200	26.993
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030		24.948	26.883
Europäische Union 0,200 % fällig am 04.06.2036		25.400	25.294
Israel Government International Bond 0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS	92.700	23.541
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	£	16.400	18.735
Israel Government International Bond 5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS	63.800	17.070
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,150 % fällig am 01.03.2072	€	16.600	16.512
Ares European CLO DAC 0,780 % fällig am 15.10.2031		15.300	15.300
Europäische Investitionsbank 0,200 % fällig am 17.03.2036		14.800	14.774
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,800 % fällig am 01.03.2067		10.800	14.031
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % fällig am 15.05.2028		12.284	14.000
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 31.10.2031		13.400	13.344
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050		14.800	13.204
Realkredit Danmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	96.700	12.938
China Construction Bank Europe S.A. 0,000 % fällig am 28.06.2024	€	12.000	11.979
Trinity Square PLC 0,899 % fällig am 15.07.2059	£	10.100	11.797
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	85.900	11.580
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.06.2029	€	11.100	11.296

BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKAUFE BIS 30. Juni 2021			
PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		2.155.000	€ 210.779
		PARI (000S)	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,500 % fällig am 01.02.2026	€	46.300	47.360
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % fällig am 01.04.2026		45.500	45.363
France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050		34.700	45.219
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,350 % fällig am 01.02.2025		43.900	44.696
		AKTIEN	
PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		431.390	42.980
		PARI (000S)	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,850 % fällig am 01.07.2025	€	34.600	37.375
Europäische Investitionsbank 0,000 % fällig am 28.03.2028		22.200	23.045
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.07.2022	DKK	139.900	19.094
Europäische Union 0,200 % fällig am 04.06.2036	€	18.600	18.362
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,800 % fällig am 01.03.2067		13.800	16.920
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,700 % fällig am 01.09.2051		16.200	16.720
Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030		15.100	16.292
BMW Finance NV 0,060 % fällig am 24.06.2022		15.500	15.581
Europäische Investitionsbank 0,200 % fällig am 17.03.2036		14.800	14.793
Societe Generale S.A. 0,309 % fällig am 01.04.2022		14.300	14.388
Bpifrance Financement S.A. 0,125 % fällig am 25.11.2023		13.000	13.197
American Honda Finance Corp. 0,606 % fällig am 15.02.2022	\$	15.700	12.935
Daimler Canada Finance, Inc. 0,158 % fällig am 11.09.2022	€	12.700	12.781
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028		12.500	12.764
Spain Government International Bond 1,000 % fällig am 31.10.2050		12.100	12.042
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 20.07.2026		10.300	10.475
Wells Fargo & Co. 0,000 % fällig am 31.01.2022		10.200	10.229
EUROFIMA 0,250 % fällig am 25.04.2023		10.000	10.140
Europäische Investitionsbank 0,000 % fällig am 28.09.2028		9.700	9.778

(a) Der Euro Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	800.000	€ 78.286
	PARI (000S)	
BPCE S.A. 1,000 % fällig am 01.04.2025	€ 8.900	9.226
HSBC Holdings PLC 3,973 % fällig am 22.05.2030	\$ 9.700	9.053
BNP Paribas S.A. 0,250 % fällig am 13.04.2027	€ 9.000	8.947
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	£ 5.450	6.226
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 5.500	6.008
Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026	5.700	5.786
ING Groep NV 3,000 % fällig am 18.02.2026	£ 4.400	5.525
Credit Suisse Group AG 4,282 % fällig am 09.01.2028	\$ 6.000	5.515
Credit Suisse Group AG 3,091 % fällig am 14.05.2032	5.700	4.727
Deutsche Bank AG 0,750 % fällig am 17.02.2027	€ 4.600	4.586
Santander UK Group Holdings PLC 3,625 % fällig am 14.01.2026	£ 3.500	4.490
Lloyds Banking Group PLC 1,875 % fällig am 15.01.2026	3.500	4.113
Equitable Financial Life Global Funding 0,600 % fällig am 16.06.2028	€ 3.900	3.896
InterContinental Hotels Group PLC 2,125 % fällig am 15.05.2027	3.600	3.833
American Tower Corp. 0,875 % fällig am 21.05.2029	3.600	3.597
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,949 % fällig am 24.01.2024	3.400	3.583
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	3.500	3.490
Santander UK Group Holdings PLC 2,896 % fällig am 15.03.2032	\$ 4.200	3.487
Twin Bridges PLC 0,899 % fällig am 12.03.2055	£ 2.800	3.256
AA Bond Co. Ltd. 4,875 % fällig am 31.07.2043	2.600	3.204
Atlantia SpA 1,625 % fällig am 03.02.2025	€ 3.100	3.127
Dutch Property Finance BV 0,124 % fällig am 28.07.2058	2.900	2.900

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKAUFE BIS 30. Juni 2021		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	750.000	€ 73.368
	PARI (000S)	
Citigroup, Inc. 0,000 % fällig am 21.03.2023	€ 9.600	9.666
UniCredit Bank AG 1,875 % fällig am 05.07.2022	\$ 11.000	9.248
BPCE S.A. 3,000 % fällig am 22.05.2022	10.750	9.165
BMW Finance NV 2,250 % fällig am 12.08.2022	8.300	7.041
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 1,500 % fällig am 17.10.2031	€ 5.900	6.179
ArcelorMittal S.A. 1,000 % fällig am 19.05.2023	6.000	6.089
Metropolitan Life Global Funding 1,250 % fällig am 17.09.2021	5.700	5.758
RCI Banque S.A. 1,625 % fällig am 11.04.2025	5.500	5.746
Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 3,650 % fällig am 10.11.2021	\$ 6.800	5.642
HSBC Holdings PLC 3,950 % fällig am 18.05.2024	6.200	5.542
ING Bank NV 0,015 % fällig am 08.04.2022	€ 5.500	5.532
Credit Suisse Group AG 2,997 % fällig am 14.12.2023	\$ 6.250	5.332
Deutsche Bank AG 4,250 % fällig am 14.10.2021	6.100	5.189
BAT International Finance PLC 3,950 % fällig am 15.06.2025	5.430	5.060
American Express Credit Corp. 0,625 % fällig am 22.11.2021	€ 4.600	4.634
Santander UK Group Holdings PLC 0,231 % fällig am 18.05.2023	4.400	4.424
Lloyds Banking Group PLC 4,050 % fällig am 16.08.2023	\$ 4.600	4.154
Smurfit Kappa Treasury ULC 1,500 % fällig am 15.09.2027	€ 3.800	3.975
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,750 % fällig am 14.01.2025	3.600	3.767
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 5,375 % fällig am 18.01.2028	4.700	3.701
HSBC Holdings PLC 6,500 % fällig am 20.05.2024	£ 2.600	3.512
Deutsche Bank AG 3,375 % fällig am 12.05.2021	\$ 4.200	3.512
Santander UK Group Holdings PLC 0,312 % fällig am 27.03.2024	€ 3.400	3.437
Bayer AG 1,125 % fällig am 06.01.2030	3.000	3.074
Digital Euro Finco LLC 1,125 % fällig am 09.04.2028	2.900	3.005

(a) Der Euro Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. Juni 2021			VERKAUFE BIS 30. Juni 2021		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	538.500	€ 52.673	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	317.500	€ 31.044
	PARI (000S)		PIMCO Funds: Global Investors Series plc – US Short-Term Fund (a)	3.036.239	26.434
Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	€ 20.400	21.973		PARI (000S)	
Casino Guichard Perrachon S.A. 4,000 % fällig am 31.08.2025	21.400	21.347	ZF Finance GmbH 3,000 % fällig am 21.09.2025	€ 19.400	20.419
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	£ 15.300	17.478	Indonesia Government International Bond 3,375 % fällig am 30.07.2025	15.400	17.246
Oman Government International Bond 4,875 % fällig am 01.02.2025	\$ 18.900	15.816	ArcelorMittal S.A. 1,000 % fällig am 19.05.2023	16.500	16.745
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 12.800	14.609	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 12.700	14.895
Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 12.600	12.576	Telecom Italia SpA 2,750 % fällig am 15.04.2025	€ 13.800	14.608
Unipol Gruppo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2030	10.900	11.575	Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,125 % fällig am 17.04.2021	14.416	14.473
InterContinental Hotels Group PLC 1,625 % fällig am 08.10.2024	10.600	10.948	Egypt Government International Bond 4,750 % fällig am 11.04.2025	12.800	13.426
Santander UK Group Holdings PLC 2,896 % fällig am 15.03.2032	\$ 13.185	10.945	NatWest Markets PLC 0,625 % fällig am 02.03.2022	13.000	13.113
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 9.400	9.272	Conti-Gummi Finance BV 1,125 % fällig am 25.09.2024	11.600	12.041
Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % fällig am 31.01.2031	8.800	9.024	Yorkshire Building Society 0,625 % fällig am 21.09.2025	11.700	11.953
Dutch Property Finance BV 0,124 % fällig am 28.07.2058	7.900	7.900	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875 % fällig am 15.01.2026	10.700	11.845
Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	7.700	7.737	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,750 % fällig am 14.01.2025	11.300	11.827
Abertis Infraestructuras Finance BV 2,625 % fällig am 26.01.2027	7.800	7.690	Bank of Ireland Group PLC 1,000 % fällig am 25.11.2025	11.000	11.279
Q-Park Holding BV 3,500 % fällig am 01.02.2025	7.800	7.664	AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	10.300	10.663
CIMIC Finance Ltd. 1,500 % fällig am 28.05.2029	7.300	7.249	Santander UK Group Holdings PLC 0,312 % fällig am 27.03.2024	10.455	10.569
AMCO - Asset Management Co. SpA 0,750 % fällig am 20.04.2028	6.400	6.355	Abertis Infraestructuras S.A. 2,250 % fällig am 29.03.2029	8.900	9.666
Swedish Match AB 1,200 % fällig am 10.11.2025	6.100	6.292	Digital Euro Finco LLC 1,125 % fällig am 09.04.2028	9.100	9.429
Deutsche Bank AG 4,500 % fällig am 01.04.2025	\$ 6.500	5.865	Lincoln Financing SARL 3,875 % fällig am 01.04.2024	9.000	8.999
CPI Property Group S.A. 4,875 % fällig am 18.08.2026	€ 5.285	5.600	Santander UK Group Holdings PLC 0,231 % fällig am 18.05.2023	8.900	8.953
Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024	5.500	5.566	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 2,425 % fällig am 13.12.2026	7.800	8.764
ADLER Group S.A. 2,250 % fällig am 27.04.2027	5.600	5.526	Logicor Financing SARL 2,250 % fällig am 13.05.2025	7.800	8.344
Nykredit Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK 39.400	5.133	SELP Finance SARL 1,500 % fällig am 20.12.2026	7.500	8.036
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,500 % fällig am 01.10.2043	39.200	5.112	Stryker Corp. 2,625 % fällig am 30.11.2030	6.500	7.859
Jyske Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2043	39.000	5.085	Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 08.12.2026	7.300	7.811
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	37.600	4.996	Abertis Infraestructuras Finance BV 2,625 % fällig am 26.01.2027	7.800	7.631
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	37.400	4.966	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 1,164 % fällig am 15.11.2027	7.200	7.558
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	37.300	4.910	European Residential Loan Securitisation DAC 0,343 % fällig am 24.03.2063	7.497	7.501
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	37.200	4.899	RCI Banque S.A. 2,000 % fällig am 11.07.2024	7.100	7.460
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	36.800	4.884	Kinder Morgan, Inc. 1,500 % fällig am 16.03.2022	7.200	7.322
ASR Nederland NV 5,000 % fällig am 30.09.2024	€ 4.200	4.744	Dell International LLC 5,850 % fällig am 15.07.2025	\$ 7.300	7.177
NE Property BV 1,750 % fällig am 23.11.2024	4.600	4.738			
Kaisa Group Holdings Ltd. 10,875 % fällig am 23.07.2023	\$ 5.400	4.561			

(a) Der Euro Income Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung Euro Long Average Duration Fund 30. Juni 2021

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052 Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050	€	9.700	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	147.000	€ 14.389
		4.900		PARI (000S)	
		AKTIEN	France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050	€ 4.000	5.107
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		43.000	France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048	2.800	3.816
		PARI (000S)	Bundesrepublik Deutschland 1,250 % fällig am 15.08.2048	2.400	3.236
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.05.2072	€	4.000	France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2066	1.900	2.806
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % fällig am 04.07.2039		3.000	Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050	2.700	2.491
Israel Government International Bond 5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS	11.900	Europäische Investitionsbank 0,000 % fällig am 28.09.2028	2.400	2.418
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.06.2039	€	2.350	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,500 % fällig am 01.02.2026	2.200	2.248
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050		2.900	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2029	2.200	2.223
Europäische Investitionsbank 0,000 % fällig am 28.09.2028		2.500	Slovenia Government International Bond 1,750 % fällig am 03.11.2040	1.700	2.037
France Government International Bond 1,250 % fällig am 25.05.2036		2.000	France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.06.2039	1.400	1.748
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2029		2.200	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.03.2026	1.700	1.742
France Government International Bond 4,500 % fällig am 25.04.2041		1.200	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 20.07.2026	1.700	1.729
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.03.2026		1.700	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 15.12.2026	1.600	1.639
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 20.07.2026		1.700	Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050	1.700	1.535
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	13.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.06.2026	1.100	1.126
Europäische Union 0,250 % fällig am 22.04.2036	€	1.650	Land Nordrhein-Westfalen 1,750 % fällig am 26.10.2057	765	1.019
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 15.12.2026		1.600	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2035	1.000	978
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.06.2044		1.300	Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	900	971
Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030		1.100	Europäische Investitionsbank 0,000 % fällig am 14.01.2031	900	923
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$	1.228	Slovenia Government International Bond 3,125 % fällig am 07.08.2045	600	903
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.06.2026	€	1.100	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,010 % fällig am 10.09.2025	800	810
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.06.2029		1.100	Sculptor European DAC 0,820 % fällig am 18.01.2030	800	801
France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050		900	Europäische Investitionsbank 0,200 % fällig am 17.03.2036	800	798
Land Nordrhein-Westfalen 1,750 % fällig am 26.10.2057		765	France Government International Bond 1,250 % fällig am 25.05.2036	700	785
		1.016	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,800 % fällig am 01.03.2067	570	757

(a) Der Euro Long Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung Euro Short-Term Fund

30. Juni 2021

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021				VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,950 % fällig am 01.03.2023	€	19.100	€ 19.566	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,950 % fällig am 01.03.2023	€	19.100
Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	130.200	18.038	Goldman Sachs Group, Inc. 0,082 % fällig am 26.09.2023	9.500	9.529
Goldman Sachs Group, Inc. 0,466 % fällig am 30.04.2024	€	14.100	14.229	FTA Santander Consumo 0,153 % fällig am 18.09.2032	7.800	7.875
Goldman Sachs Group, Inc. 0,082 % fällig am 26.09.2023		8.000	8.031	Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,500 % fällig am 16.11.2022	6.900	7.000
Laurelin DAC 0,720 % fällig am 20.10.2031		8.000	8.000	Goldman Sachs Group, Inc. 0,013 % fällig am 21.04.2023	6.700	6.713
FTA Santander Consumo 0,153 % fällig am 18.09.2032		7.800	7.852	Barclays PLC 1,875 % fällig am 23.03.2021	6.100	6.105
Blackrock European CLO DAC 0,620 % fällig am 15.10.2031		7.800	7.800	HSBC Holdings PLC 0,162 % fällig am 27.09.2022	5.700	5.718
Saudi Government International Bond 0,000 % fällig am 03.03.2024		7.800	7.788	Bank of America Corp. 0,161 % fällig am 25.04.2024	5.500	5.539
Trinity Square PLC 0,899 % fällig am 15.07.2059	£	6.600	7.709	Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC 0,680 % fällig am 16.09.2025	£	4.481
Schaeffler AG 1,875 % fällig am 26.03.2024	€	6.500	6.756	easyJet PLC 1,125 % fällig am 18.10.2023	€	4.700
Santander UK Group Holdings PLC 0,312 % fällig am 27.03.2024		6.400	6.463	Societe Generale S.A. 0,000 % fällig am 27.05.2022	4.700	4.723
Bank of America Corp. 0,455 % fällig am 24.08.2025		6.200	6.313	Bank of America Corp. 0,244 % fällig am 04.05.2023	4.300	4.325
Natwest Group PLC 2,000 % fällig am 08.03.2023		5.861	5.996	BMW Finance NV 0,060 % fällig am 24.06.2022	4.100	4.125
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024		5.700	5.899	Lanark Master Issuer PLC 0,170 % fällig am 22.12.2054	3.827	3.829
American International Group, Inc. 1,500 % fällig am 08.06.2023		5.700	5.898	Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.04.2022	DKK	26.600
Ares European CLO DAC 0,660 % fällig am 15.10.2030		5.700	5.700	Wells Fargo & Co. 1,125 % fällig am 29.10.2021	€	3.500
Ryanair DAC 1,125 % fällig am 15.08.2023		4.700	4.799	Stratton Mortgage Funding PLC 0,880 % fällig am 12.03.2044	£	2.886
CNP Assurances 7,375 % fällig am 30.09.2041	£	4.000	4.765	Standard Chartered PLC 1,338 % fällig am 20.01.2023	\$	3.900
LeasePlan Corp. NV 0,750 % fällig am 03.10.2022	€	4.300	4.361	Credit Suisse AG 1,375 % fällig am 31.01.2022	€	3.000
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 2,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	30.700	4.252	Morgan Stanley 0,168 % fällig am 08.11.2022	2.800	2.810
Intesa Sanpaolo SpA 1,125 % fällig am 04.03.2022	€	4.000	4.057	Bumper UK Finance PLC 0,650 % fällig am 20.12.2028	£	2.391
Legal & General Group PLC 10,000 % fällig am 23.07.2041	£	3.300	3.982	Volkswagen Bank GmbH 0,101 % fällig am 15.06.2021	€	2.700
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060		3.450	3.941	Polaris PLC 1,300 % fällig am 27.05.2057	£	2.215
Israel Government International Bond 5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS	14.300	3.824	LeasePlan Corp. NV 1,000 % fällig am 24.05.2021	€	2.400
Bain Capital Euro DAC 0,740 % fällig am 20.01.2032	€	3.800	3.800	Purple Master Credit Cards 0,147 % fällig am 25.05.2034	2.100	2.123
Stratton Mortgage Funding PLC 0,901 % fällig am 25.09.2051	£	3.300	3.729	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.07.2022	DKK	15.500
Primrose Residential 0,200 % fällig am 24.03.2061	€	3.600	3.585	Wells Fargo & Co. 0,000 % fällig am 31.01.2022	€	2.000
Realkredit Danmark A/S 2,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	25.400	3.517	Poland Government International Bond 0,000 % fällig am 07.07.2023	1.900	1.915
Brazilian Government International Bond 2,875 % fällig am 01.04.2021	€	3.400	3.407	Nationwide Building Society 3,622 % fällig am 26.04.2023	\$	2.100
Harvest CLO DAC 0,640 % fällig am 15.10.2031		3.200	3.200	Metropolitan Life Global Funding 1,625 % fällig am 09.06.2022	£	1.500
Dryden Euro CLO BV 0,660 % fällig am 15.04.2033		3.100	3.100	Silverstone Master Issuer PLC 0,519 % fällig am 21.01.2070	1.500	1.751
Bank of Scotland PLC 7,754 % fällig am 31.05.2021	£	2.600	3.022	Nationale-Nederlanden Bank NV 0,375 % fällig am 31.05.2023	€	1.700
Volkswagen Leasing GmbH 0,000 % fällig am 19.07.2024	€	3.000	2.995	SPP-Distribucia A/S 2,625 % fällig am 23.06.2021	1.700	1.711
Aurium CLO DAC 0,670 % fällig am 16.04.2030		2.800	2.797			

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung PIMCO European High Yield Bond Fund 30. Juni 2021

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 5.300	€ 5.420	Atlantia SpA 1,625 % fällig am 03.02.2025	€ 4.300	€ 4.429
TalkTalk Telecom Group PLC 3,875 % fällig am 20.02.2025	£ 2.800	3.171	Telecom Italia SpA 4,000 % fällig am 11.04.2024	3.800	4.106
Deutsche Bank AG 5,625 % fällig am 19.05.2031	€ 2.600	3.064	Smurfit Kappa Treasury ULC 1,500 % fällig am 15.09.2027	2.450	2.560
INEOS Finance PLC 2,500 % fällig am 01.04.2024	2.593	2.586	Virgin Money UK PLC 7,875 % fällig am 14.12.2028	£ 1.600	2.134
Casino Guichard Perrachon S.A. 4,000 % fällig am 31.08.2025	1.900	1.895	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2030	€ 1.650	1.972
Casino Guichard Perrachon S.A. 3,580 % fällig am 07.02.2025	1.900	1.852	Grifols S.A. 1,625 % fällig am 15.02.2025	1.900	1.912
Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026	1.700	1.700	Casino Guichard Perrachon S.A. 4,000 % fällig am 31.08.2025	1.900	1.910
AA Bond Co. Ltd. 4,875 % fällig am 31.07.2043	£ 1.400	1.681	Marks & Spencer PLC 4,250 % fällig am 08.12.2023	£ 1.400	1.718
Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 1.600	1.641	easyJet PLC 0,875 % fällig am 11.06.2025	€ 1.700	1.680
Aedas Homes Opco SLU 4,000 % fällig am 15.08.2026	1.600	1.610	Crown European Holdings S.A. 2,875 % fällig am 01.02.2026	1.550	1.663
Trafigura Funding S.A. 3,875 % fällig am 02.02.2026	1.600	1.600	Trafigura Funding S.A. 3,875 % fällig am 02.02.2026	1.600	1.604
Dufry One BV 2,500 % fällig am 15.10.2024	1.600	1.583	Nidda Healthcare Holding GmbH 3,500 % fällig am 21.08.2026	1.600	1.590
Electricite de France S.A. 5,375 % fällig am 29.01.2025	1.400	1.583	Parts Europe S.A. 6,500 % fällig am 16.07.2025	1.500	1.575
easyJet PLC 0,875 % fällig am 11.06.2025	1.700	1.581	Netflix, Inc. 4,625 % fällig am 15.05.2029	1.200	1.512
INEOS Quattro Finance PLC 3,375 % fällig am 15.01.2026	\$ 1.900	1.572	International Consolidated Airline 2,750 % fällig am 25.03.2025	1.500	1.493
Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % fällig am 15.08.2024	€ 1.500	1.546	SoftBank Group Corp. 3,125 % fällig am 19.09.2025	1.400	1.456
Q-Park Holding BV 2,000 % fällig am 01.03.2027	1.600	1.534	Altice Financing S.A. 3,000 % fällig am 15.01.2028	1.400	1.344
Carnival Corp. 10,125 % fällig am 01.02.2026	1.300	1.511	Deutsche Bank AG 2,625 % fällig am 16.12.2024	£ 1.000	1.184
International Consolidated Airline 2,750 % fällig am 25.03.2025	1.500	1.485	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	1.000	1.168
Heathrow Finance PLC 4,375 % fällig am 01.03.2027	£ 1.100	1.326	CMA CGM S.A. 7,500 % fällig am 15.01.2026	€ 1.000	1.096
Ontex Group NV 3,500 % fällig am 15.07.2026	€ 1.200	1.200	easyJet PLC 1,875 % fällig am 03.03.2028	1.000	994
UniCredit SpA 9,250 % fällig am 03.06.2022	1.100	1.196	Lloyds Banking Group PLC 2,707 % fällig am 03.12.2035	£ 830	979
eG Global Finance PLC 4,375 % fällig am 07.02.2025	1.200	1.191	MPT Operating Partnership LP 3,692 % fällig am 05.06.2028	800	973
Intrum AB 4,875 % fällig am 15.08.2025	1.100	1.156	Jaguar Land Rover Automotive PLC 6,875 % fällig am 15.11.2026	€ 800	906
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 1.000	1.141	Cirsa Finance International SARL 4,750 % fällig am 22.05.2025	900	891
Virgin Money UK PLC 9,250 % fällig am 08.06.2024	800	1.085	Stonegate Pub Co. 8,250 % fällig am 31.07.2025	£ 700	857
Via Celere Desarrollos Inmobiliarios S.A. 5,250 % fällig am 01.04.2026	€ 1.000	1.043	Renault S.A. 1,125 % fällig am 04.10.2027	€ 900	853
Banijay Entertainment SASU 3,500 % fällig am 01.03.2025	1.000	1.012	INEOS Finance PLC 2,875 % fällig am 01.05.2026	800	814
Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024	1.000	1.006	Grifols S.A. 3,200 % fällig am 01.05.2025	800	808
Nexi SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026	1.000	1.000	Banijay Entertainment SASU 5,375 % fällig am 01.03.2025	\$ 950	802
Permanent TSB Group Holdings PLC 3,000 % fällig am 19.08.2031	1.000	1.000	Petroleos Mexicanos 3,625 % fällig am 24.11.2025	€ 800	800
Verisure Holding AB 3,250 % fällig am 15.02.2027	1.000	1.000	Athora Netherlands NV 7,000 % fällig am 19.06.2025	700	797
Energizer Gamma Acquisition BV 3,500 % fällig am 30.06.2029	1.000	1.000	Adevinta ASA 3,000 % fällig am 15.11.2027	750	775
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	1.000	1.000	Adevinta ASA 2,625 % fällig am 15.11.2025	750	774
Electricite de France S.A. 2,625 % fällig am 01.12.2027	1.000	992	Altice France S.A. 4,000 % fällig am 15.07.2029	750	754
easyJet PLC 1,875 % fällig am 03.03.2028	1.000	980	OCI NV 3,625 % fällig am 15.10.2025	700	733
Neinor Homes S.A. 4,500 % fällig am 15.10.2026	900	918	Crown European Holdings S.A. 4,000 % fällig am 15.07.2022	700	727
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 4,750 % fällig am 15.04.2024	900	900	UniCredit SpA 5,459 % fällig am 30.06.2035	\$ 800	715
CPI Property Group S.A. 4,375 % fällig am 09.11.2023	800	837	Pro-Gest SpA 3,250 % fällig am 15.12.2024	€ 750	711
Jaguar Land Rover Automotive PLC 7,750 % fällig am 15.10.2025	\$ 900	834	Sarens Finance Co. NV 5,750 % fällig am 21.02.2027	650	652
Jaguar Land Rover Automotive PLC 4,500 % fällig am 15.01.2026	€ 800	828			

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)			PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		
	257.500	€ 25.188		200.000	€ 19.554
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 44.400	5.973	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 43.229	5.968
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.03.2026	€ 5.600	5.737	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.03.2026	€ 5.600	5.737
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 15.12.2026	5.400	5.515	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 15.12.2026	5.400	5.524
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 20.07.2026	5.000	5.108	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,500 % fällig am 01.02.2026	5.000	5.115
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % fällig am 01.04.2026	4.900	4.884	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 20.07.2026	5.000	5.070
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2029	4.600	4.593	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % fällig am 01.04.2026	4.900	4.885
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.06.2026	3.900	3.991	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.06.2026	3.900	3.993
Europäische Union 0,250 % fällig am 22.04.2036	3.600	3.573	Europäische Union 0,200 % fällig am 04.06.2036	2.600	2.567
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,250 % fällig am 15.03.2028	3.500	3.473	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2029	2.500	2.531
Israel Government International Bond 0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS 12.300	3.124	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,050 % fällig am 18.01.2052	2.600	2.494
Europäische Union 0,200 % fällig am 04.06.2036	€ 3.100	3.087	Europäische Investitionsbank 0,000 % fällig am 14.01.2031	2.300	2.359
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 20.100	2.718	Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	2.100	2.266
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,050 % fällig am 18.01.2052	€ 2.600	2.540	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 17.000	2.170
Spain Government International Bond 0,100 % fällig am 30.04.2031	2.600	2.509	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2053	15.931	2.158
Marks & Spencer PLC 4,250 % fällig am 08.12.2023	£ 2.000	2.470	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	\$ 2.330	2.107
Europäische Investitionsbank 0,000 % fällig am 14.01.2031	€ 2.300	2.381	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028	€ 2.000	2.048
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.02.2051 (b)	\$ 2.703	2.251	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 15.000	1.979
Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	€ 2.000	2.180	Jyske Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	15.000	1.977
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 15.900	2.150	Enel Finance International NV 0,000 % fällig am 17.06.2024	€ 1.800	1.809
Israel Government International Bond 5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS 7.800	2.086	Europäische Investitionsbank 0,200 % fällig am 17.03.2036	1.700	1.698
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2031	€ 2.100	2.082	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,010 % fällig am 05.05.2027	1.500	1.521
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 31.10.2031	1.900	1.892	Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050	1.300	1.142
			Europäische Union 0,300 % fällig am 04.11.2050	1.000	954

(a) Der PIMCO European Short-Term Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)		
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	5.711.853	\$ 56.901	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	6.851.128	\$ 68.250		
	PARI (000S)			PARI (000S)			
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	\$	13.500	12.563	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b)	\$	9.071	9.455
China Government Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027	CNY	75.600	11.795	Russia Government International Bond 4,750 % fällig am 27.05.2026		4.400	5.063
China Government Bond 3,020 % fällig am 22.10.2025		55.700	8.539	France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050	€	3.200	4.983
Israel Government International Bond 0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS	21.000	6.402	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	\$	3.967	4.083
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b)	\$	4.535	4.728	Russia Government International Bond 7,700 % fällig am 23.03.2033	RUB	218.600	3.177
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€	3.300	4.282	United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.01.2049	£	2.000	3.024
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 3,000 % fällig am 30.06.2030	\$	4.000	4.120	Indonesia Government International Bond 2,625 % fällig am 14.06.2023	€	2.300	2.965
Malaysia Government International Bond 3,733 % fällig am 15.06.2028	MYR	12.200	3.110	Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030		2.000	2.668
United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.01.2049	£	2.000	2.990	Russia Government International Bond 4,375 % fällig am 21.03.2029	\$	2.200	2.490
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060		1.900	2.635	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)		1.928	2.461
Russia Government International Bond 1,125 % fällig am 20.11.2027	€	2.000	2.406	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,125 % fällig am 11.10.2027		2.200	2.401
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.12.2050	\$	1.993	2.113	Spain Government International Bond 1,850 % fällig am 30.07.2035	€	1.700	2.385
Petroleos Mexicanos 6,750 % fällig am 21.09.2047		2.300	2.038	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 3,150 % fällig am 01.04.2022	\$	2.100	2.143
Europäische Union 0,000 % fällig am 02.06.2028	€	1.600	2.019	Petrobras Global Finance BV 5,093 % fällig am 15.01.2030		1.970	2.089
Stratton Mortgage Funding PLC 0,901 % fällig am 25.09.2051	£	1.300	1.775	Europäische Union 0,000 % fällig am 02.06.2028	€	1.600	1.968
Saudi Government International Bond 4,375 % fällig am 16.04.2029	\$	1.500	1.749	Indonesia Government International Bond 4,100 % fällig am 24.04.2028	\$	1.700	1.959
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2031	€	1.300	1.563	Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 15.03.2115	€	1.300	1.861
7-Eleven, Inc. 0,625 % fällig am 10.02.2023	\$	1.400	1.399	Banco Votorantim S.A. 4,000 % fällig am 24.09.2022	\$	1.600	1.651
Malaysia Government International Bond 4,642 % fällig am 07.11.2033	MYR	5.200	1.363	Nationwide Building Society 3,960 % fällig am 18.07.2030		1.400	1.551

(a) Der Global Advantage Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung Global Bond Fund

30. Juni 2021

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	50.673.595	\$ 504.814	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	61.886.044	\$ 616.500
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	\$ 316.700	294.982	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.03.2049	\$ 307.924	330.248
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 70.500	91.715	Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	€ 93.200	123.833
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	£ 63.250	87.702	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 102.438	116.577
China Government Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027	CNY 517.000	79.849	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.09.2049	102.544	109.722
Spain Government International Bond 0,850 % fällig am 30.07.2037	€ 66.850	79.277	France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050	€ 67.500	105.339
China Government Bond 3,020 % fällig am 22.10.2025	CNY 491.300	74.927	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.03.2050	\$ 88.191	94.364
Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.12.2051	CAD 91.600	72.885	Spain Government International Bond 1,850 % fällig am 30.07.2035	€ 65.300	89.600
Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.12.2048	73.300	68.399	Europäische Union 0,200 % fällig am 04.06.2036	53.100	63.163
Israel Government International Bond 0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS 216.800	65.638	Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.12.2051	CAD 75.500	60.128
Europäische Union 0,200 % fällig am 04.06.2036	€ 53.100	62.838	Europäische Union 0,000 % fällig am 02.06.2028	€ 45.600	55.770
Europäische Union 0,250 % fällig am 22.04.2036	48.800	58.349	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	\$ 52.110	53.635
Europäische Union 0,000 % fällig am 02.06.2028	45.600	57.543	China Development Bank 4,040 % fällig am 06.07.2028	CNY 320.300	50.279
Israel Government International Bond 5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS 160.800	51.736	Lloyds Bank PLC 2,125 % fällig am 24.07.2022	\$ 43.800	44.798
Europäische Union 0,300 % fällig am 04.11.2050	€ 30.300	38.648	Petrobras Global Finance BV 5,093 % fällig am 15.01.2030	39.287	41.264
Credit Suisse AG 0,250 % fällig am 05.01.2026	30.500	36.964	Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 30.04.2029	€ 30.042	40.497
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2022	ILS 113.400	34.750	Europäische Union 0,250 % fällig am 22.04.2036	32.200	38.240
Trinity Square PLC 0,899 % fällig am 15.07.2059	£ 23.100	32.093	China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd. 2,400 % fällig am 10.12.2022	\$ 35.700	36.435
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2031	€ 26.400	31.739	Europäische Union 0,300 % fällig am 04.11.2050	€ 30.300	34.560
China Government Bond 2,850 % fällig am 04.06.2027	CNY 202.400	30.755	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2035	28.400	33.100

(a) Der Global Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung Global Bond Ex-US Fund

30. Juni 2021

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	15.068.022	\$ 150.102	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	9.737.062	\$ 97.000
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Israel Government International Bond 0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS 43.800	13.339	Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	€ 8.600	11.370
China Government Bond 3,030 % fällig am 11.03.2026	CNY 74.700	11.701	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 7.483	8.525
China Government Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027	74.600	11.510	Japan Government International Bond 1,400 % fällig am 20.09.2034	¥ 660.000	7.099
China Government Bond 3,020 % fällig am 22.10.2025	48.000	7.321	France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050	€ 3.500	5.450
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 4.300	5.577	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	\$ 5.254	5.408
Japan Government International Bond 0,500 % fällig am 20.03.2049	¥ 590.000	5.248	Spain Government International Bond 1,850 % fällig am 30.07.2035	€ 3.600	4.940
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	£ 3.550	4.922	China Development Bank 4,040 % fällig am 06.07.2028	CNY 28.100	4.413
Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.12.2051	CAD 5.500	4.384	Europäische Union 0,200 % fällig am 04.06.2036	€ 3.200	3.796
Spain Government International Bond 0,850 % fällig am 30.07.2037	€ 3.600	4.269	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 22.555	3.665
China Development Bank 4,240 % fällig am 24.08.2027	CNY 26.300	4.235	Province of Quebec 0,000 % fällig am 29.10.2030	€ 3.100	3.650
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.12.2050	\$ 3.587	3.804	Spain Government International Bond 1,000 % fällig am 31.10.2050	3.000	3.612
Europäische Union 0,200 % fällig am 04.06.2036	€ 3.200	3.787	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,700 % fällig am 01.09.2051	2.750	3.484
Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.12.2048	CAD 3.300	3.081	Lloyds Bank PLC 2,125 % fällig am 24.07.2022	\$ 3.000	3.068
Europäische Union 0,000 % fällig am 02.06.2028	€ 2.400	3.029	Europäische Union 0,000 % fällig am 02.06.2028	€ 2.400	2.952
Ontario Teachers' Finance Trust 0,100 % fällig am 19.05.2028	2.400	2.895	MUFG Union Bank N.A. 0,757 % fällig am 09.12.2022	\$ 2.750	2.769
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,800 % fällig am 01.03.2067	1.800	2.876	China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd. 2,400 % fällig am 10.12.2022	2.700	2.756
International Development Association 0,350 % fällig am 22.04.2036	2.400	2.860	Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.12.2051	CAD 3.400	2.710
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 17.800	2.817	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.02.2044 (b)	\$ 2.037	2.696
Standard Chartered PLC 2,678 % fällig am 29.06.2032	\$ 2.700	2.700	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,800 % fällig am 01.03.2067	€ 1.800	2.626
			AT&T, Inc. 1,800 % fällig am 05.09.2026	2.000	2.578
			Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2,014 % fällig am 07.11.2022	\$ 2.500	2.559

(a) Der Global Bond Ex-US Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	26.138.730	\$ 260.394	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	21.960.090	\$ 218.771
PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	313.500	31.843		PARI (000S)	
		PARI (000S)	China Development Bank 3,340 % fällig am 14.07.2025	CNY 430.700	67.593
China Government Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027	CNY 200.100	31.706	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 92.100	7.337
		AKTIEN	Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN 14.200	4.708
PIMCO Funds: Global Investors Series plc – Mortgage Opportunities Fund (a)	1.270.479	13.572	UniCredit SpA 7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 2.600	3.015
		PARI (000S)		AKTIEN	
Berry Global, Inc. 4,875 % fällig am 15.07.2026	\$ 12.600	13.496	Equinix, Inc.	3.719	2.670
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR 76.400	5.025	Alexandria Real Estate Equities, Inc.	14.675	2.547
China Government Bond 2,850 % fällig am 04.06.2027	CNY 31.300	4.725	Snowflake, Inc.	9.621	2.335
Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 13.700	4.423	NXP Semiconductors NV	9.190	1.856
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3,000 % fällig am 29.03.2025	€ 3.200	4.125	DoorDash, Inc.	10.857	1.565
Midwest Connector Capital Co. LLC 3,900 % fällig am 01.04.2024	\$ 3.400	3.481	Palantir Technologies, Inc.	62.546	1.504
China Development Bank 3,340 % fällig am 14.07.2025	CNY 21.500	3.342	Welltower, Inc.	19.059	1.376
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 4,950 % fällig am 23.03.2027	\$ 2.900	3.306	Sun Communities, Inc.	4.752	772
		AKTIEN		PARI (000S)	
Travel & Leisure Co.	49.509	3.245	Dominican Republic Government International Bond 9,750 % fällig am 05.06.2026	DOP 38.900	770
Choice Hotels International, Inc.	27.286	3.241		AKTIEN	
Marriott Vacations Worldwide Corp.	18.550	3.240	DraftKings, Inc.	13.363	670
Hyatt Hotels Corp. 'A'	41.078	3.231	Clarivate PLC	20.389	651
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	26.239	3.216	Bentley Systems, Inc.	9.222	561
Marriott International, Inc. 'A'	22.665	3.200	NVIDIA Corp.	700	557
		PARI (000S)	Wix.com Ltd.	1.880	483
RCS & RDS S.A. 3,250 % fällig am 05.02.2028	€ 2.500	3.101	Agilon Health, Inc.	13.031	466
		AKTIEN			
WR Grace & Co.	44.576	3.061			

(a) Der PIMCO Global Dividend Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000\$)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	81.463.133	\$ 811.519	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	80.425.921	\$ 801.200
	PARI (000\$)			PARI (000\$)	
U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030	\$ 40.000	39.119	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030	\$ 40.000	37.549
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 22.375	30.978	Heathrow Finance PLC 4,375 % fällig am 01.03.2027	£ 10.000	14.311
Sotera Health Holdings LLC 3,250 % fällig am 11.12.2026	\$ 25.000	25.000	Kraft Heinz Foods Co. 2,250 % fällig am 25.05.2028	€ 11.000	14.272
Herens Midco SARL 5,250 % fällig am 15.05.2029	€ 15.000	18.023	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.08.2030	\$ 15.000	13.721
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	12.500	14.991	Berry Global, Inc. 1,500 % fällig am 15.01.2027	€ 10.000	12.299
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	12.000	14.378	Sprint Corp. 7,250 % fällig am 15.09.2021	\$ 11.000	11.206
Vine Energy Holdings LLC 6,750 % fällig am 15.04.2029	\$ 14.000	14.318	Change Healthcare Holdings LLC 5,750 % fällig am 01.03.2025	10.000	10.213
Carnival Corp. 5,750 % fällig am 01.03.2027	12.750	12.750	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	10.000	9.966
Organon Finance LLC 5,125 % fällig am 30.04.2031	12.500	12.552	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % fällig am 31.03.2027	€ 7.500	8.412
PetSmart, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2028	12.000	12.029	Genovus Energy, Inc. 6,750 % fällig am 15.11.2039	\$ 6.000	7.865
Univision Communications, Inc. 4,500 % fällig am 01.05.2029	12.000	12.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 3,150 % fällig am 01.10.2026	8.000	7.598
Team Health Holdings, Inc. 3,750 % fällig am 06.02.2024	12.000	11.483	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 01.12.2021	€ 5.900	7.051
Post Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 15.09.2031	11.000	11.000	Telenet Finance Luxembourg Notes SARL 3,500 % fällig am 01.03.2028	5.000	6.337
Energizer Gamma Acquisition BV 3,500 % fällig am 30.06.2029	€ 8.975	10.936	Ball Corp. 1,500 % fällig am 15.03.2027	5.000	6.102
Verisure Holding AB 3,250 % fällig am 15.02.2027	8.450	10.218	CDW LLC 3,250 % fällig am 15.02.2029	\$ 5.750	5.815
Sirius XM Radio, Inc. 4,000 % fällig am 15.07.2028	\$ 10.000	10.000	AECOM 5,125 % fällig am 15.03.2027	5.000	5.513
PennyMac Financial Services, Inc. 4,250 % fällig am 15.02.2029	10.000	10.000	Drax Finco PLC 2,625 % fällig am 01.11.2025	€ 4.400	5.372
Central Garden & Pet Co. 4,125 % fällig am 30.04.2031	10.000	10.000	FCE Bank PLC 2,727 % fällig am 03.06.2022	£ 3.750	5.371
Community Health Systems, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2031	10.000	9.997	Navient Corp. 5,875 % fällig am 25.10.2024	\$ 5.000	5.263

(a) Der Global High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	289.725.216	\$ 2.886.247	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	434.112.787	\$ 4.324.600
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	\$ 361.800	340.899	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	\$ 164.164	180.537
U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	208.533	196.008	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2049	128.500	158.028
U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.05.2041	72.700	72.282	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049	104.300	119.381
U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030	54.600	54.186	U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	133.900	112.964
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029	46.600	46.566	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2048	87.200	109.014
HSBC Holdings PLC 1,750 % fällig am 24.07.2027	£ 32.800	45.481	U.S. Treasury Bonds 1,250 % fällig am 15.05.2050	121.399	99.934
Flex Intermediate Holdco LLC 3,363 % fällig am 30.06.2031	\$ 44.900	44.927	U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.08.2050	98.162	87.142
Boeing Co. 2,196 % fällig am 04.02.2026	40.500	40.500	Russia Government International Bond 7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB 6.035.500	84.762
U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.02.2031	41.800	40.193	HSBC Holdings PLC 2,633 % fällig am 07.11.2025	\$ 62.100	65.791
Australia Government International Bond 1,000 % fällig am 21.11.2031	AUD 55.200	39.390	Russia Government International Bond 8,500 % fällig am 17.09.2031	RUB 3.598.400	53.726
Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,125 % fällig am 22.10.2025	\$ 36.900	36.942	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 43.135	48.942
Boeing Co. 1,433 % fällig am 04.02.2024	34.500	34.500	UniCredit SpA 7,500 % fällig am 03.06.2026	€ 32.700	46.288
Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032	33.335	33.392	Santander UK Group Holdings PLC 4,796 % fällig am 15.11.2024	\$ 40.745	45.144
Midwest Connector Capital Co. LLC 3,900 % fällig am 01.04.2024	30.701	31.392	Natwest Group PLC 2,500 % fällig am 22.03.2023	€ 31.458	40.076
Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2030	€ 20.573	30.083	BNP Paribas S.A. 4,705 % fällig am 10.01.2025	\$ 34.200	37.979
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 20.600	28.521	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 1,250 % fällig am 26.04.2027	€ 29.000	35.576
Broadcom, Inc. 2,450 % fällig am 15.02.2031	\$ 27.000	26.947	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,910 % fällig am 09.03.2021	\$ 35.100	35.112
DAE Funding LLC 3,375 % fällig am 20.03.2028	26.200	25.862	Amipeace Ltd. 2,250 % fällig am 22.10.2030	35.000	33.794
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 1,500 % fällig am 17.02.2027	€ 20.700	25.110	VMware, Inc. 2,950 % fällig am 21.08.2022	30.000	30.964

(a) Der Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	\$ 24.900	\$ 23.528	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	\$ 21.200	\$ 20.792
U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.05.2041	21.800	22.260	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (a)	8.849	9.618
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (a)	9.037	9.778	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.08.2030	7.500	6.843
U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 30.04.2026	7.400	7.383	U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	6.200	5.383
JPMorgan Chase & Co. 2,580 % fällig am 22.04.2032	6.500	6.500	Nidec Corp. 0,046 % fällig am 30.03.2026	€ 3.600	4.375
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	€ 5.000	6.041	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2031 (a)	\$ 2.865	3.122
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (a)	\$ 5.382	6.028	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	3.100	3.102
Morgan Stanley 0,731 % fällig am 05.04.2024	6.000	6.000	NVR, Inc. 3,000 % fällig am 15.05.2030	2.600	2.742
Goldman Sachs Group, Inc. 2,615 % fällig am 22.04.2032	6.000	6.000	Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 0,100 % fällig am 17.09.2035	€ 2.100	2.585
EQT AB 0,875 % fällig am 14.05.2031	€ 4.900	5.855	U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	\$ 2.848	2.426
Bank of America Corp. 2,687 % fällig am 22.04.2032	\$ 4.800	4.813	Walt Disney Co. 2,650 % fällig am 13.01.2031	2.000	2.052
Nidec Corp. 0,046 % fällig am 30.03.2026	€ 3.600	4.259	Wells Fargo & Co. 0,805 % fällig am 19.05.2025	2.000	2.005
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028	3.400	4.125	Mexico Government International Bond 1,350 % fällig am 18.09.2027	€ 1.600	1.972
Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	3.400	4.117	Kia Corp. 1,000 % fällig am 16.04.2024	\$ 1.800	1.810
Acef Holding S.C.A. 0,750 % fällig am 14.06.2028	3.300	3.996	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2,000 % fällig am 01.09.2028	€ 1.400	1.679
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,800 % fällig am 01.03.2041	3.100	3.973	FCE Bank PLC 0,869 % fällig am 13.09.2021	1.400	1.674
International Development Association 0,350 % fällig am 22.04.2036	3.000	3.575	T-Mobile USA, Inc. 2,250 % fällig am 15.11.2031	\$ 1.700	1.664
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2,100 % fällig am 20.05.2048	\$ 3.550	3.548	Aflac, Inc. 1,125 % fällig am 15.03.2026	1.600	1.592
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	3.500	3.498	Nokia Oyj 3,125 % fällig am 15.05.2028	€ 1.200	1.547
OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027	3.400	3.400	Klabn Austria GmbH 3,200 % fällig am 12.01.2031	\$ 1.600	1.530
			Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,650 % fällig am 27.02.2024	1.500	1.501
			Contemporary Ruiding Development Ltd. 2,625 % fällig am 17.09.2030	1.500	1.489
			Faurecia SE 2,375 % fällig am 15.06.2029	€ 1.150	1.428
			Westpac Banking Corp. 0,786 % fällig am 13.05.2031	1.100	1.338

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000\$)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000\$)		
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021				
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	51.645.244	\$ 514.487	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	30.565.993	\$ 304.500		
	PARI (000\$)			PARI (000\$)			
U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 31.03.2026	\$	50.600	50.256	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	\$	35.000	35.381
Australia Government International Bond 2,500 % fällig am 21.05.2030	AUD	46.700	38.743	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)		16.010	18.602
Israel Government International Bond 5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS	102.600	33.033	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2027 (b)		14.375	17.693
Stratton Mortgage Funding PLC 0,901 % fällig am 25.09.2051	£	12.100	16.519	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)		10.049	11.144
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	\$	15.600	14.819	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)		8.696	9.722
Twin Bridges PLC 0,899 % fällig am 12.03.2055	£	10.200	14.380	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2031 (b)		6.632	7.324
Dryden Euro CLO BV 0,860 % fällig am 15.05.2034	€	11.700	14.169	Eutelsat S.A. 2,250 % fällig am 13.07.2027	€	3.000	4.014
Aqueduct European CLO DAC 0,640 % fällig am 20.07.2030		9.800	11.880	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$	3.245	3.789
Harvest CLO DAC 0,640 % fällig am 15.10.2031		9.600	11.634	Sarens Finance Co. NV 5,750 % fällig am 21.02.2027	€	3.100	3.753
Standard Chartered PLC 2,819 % fällig am 30.01.2026	\$	11.100	11.618	BNP Paribas S.A. 3,375 % fällig am 09.01.2025	\$	3.100	3.345
Cairn CLO BV 0,600 % fällig am 30.04.2031	€	8.200	9.953	ONEOK, Inc. 4,000 % fällig am 13.07.2027		3.000	3.336
Pacific Gas & Electric Co. 4,550 % fällig am 01.07.2030	\$	8.300	9.029	AIA Group Ltd. 3,375 % fällig am 07.04.2030		2.600	2.832
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€	7.400	8.875	U.S. Bank N.A. 3,400 % fällig am 24.07.2023		2.400	2.558
Boeing Co. 2,196 % fällig am 04.02.2026	\$	8.600	8.601	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 3,250 % fällig am 25.02.2030		2.500	2.494
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£	6.200	8.584	ONEOK, Inc. 4,350 % fällig am 15.03.2029		2.000	2.281
Charter Communications Operating LLC 4,400 % fällig am 01.12.2061	\$	8.200	8.192	UNIQA Insurance Group AG 1,375 % fällig am 09.07.2030	€	1.700	2.249
Citigroup Mortgage Loan Trust 0,262 % fällig am 25.07.2045		9.397	8.152	Sands China Ltd. 4,600 % fällig am 08.08.2023	\$	1.900	2.027
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	£	5.450	7.557	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,125 % fällig am 04.09.2026	€	1.500	1.865
Banco Santander S.A. 1,500 % fällig am 14.04.2026		5.400	7.510	Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN	3.200	1.059

(a) Der Global Libor Plus Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	10.922.100	\$ 108.805	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	\$ 132.931.186	\$ 136.378
	PARI (000S)			AKTIEN	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	\$ 65.935	67.684	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	13.100	130.500
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.10.2024 (b)	50.588	54.869		PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	50.469	54.820	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$ 23.960	27.765
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	41.281	44.530	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	22.916	24.981
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)	31.054	33.770	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2022 (b)	20.868	21.299
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	29.191	32.417	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	17.803	19.559
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)	25.128	27.448	United Kingdom Gilt 2,750 % fällig am 07.09.2024	£ 8.900	13.372
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2031 (b)	23.479	25.485	France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2029	€ 9.678	13.307
United Kingdom Gilt 1,875 % fällig am 22.11.2022	£ 16.571	24.759	Spain Government International Bond 1,400 % fällig am 30.07.2028	7.000	9.514
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2028	€ 12.875	17.358	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2023 (b)	\$ 7.261	7.607
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£ 10.275	16.555	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)	6.414	7.074
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	€ 10.918	14.124	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.11.2036	£ 3.287	6.893
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2026	¥ 1.206.196	11.257	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	\$ 5.761	6.453
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	939.542	8.926	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	4.968	5.435
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 53.700	8.662	Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	€ 4.000	5.135
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	50.600	8.250	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	\$ 2.285	2.608
Realkredit Danmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	41.000	6.578	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 15.000	2.362
Spain Government International Bond 0,700 % fällig am 30.11.2033	€ 3.792	5.593	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 30.04.2026	\$ 1.900	1.893
Ares European CLO DAC 0,780 % fällig am 15.10.2031	4.200	5.125	France Government International Bond 0,700 % fällig am 25.07.2030	€ 1.268	1.849
			Qatar Government International Bond 3,875 % fällig am 23.04.2023	\$ 1.700	1.817

(a) Der Global Low Duration Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)		
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021				
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	24.575.077	\$ 244.803	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	20.086.858	\$ 200.100		
	PARI (000S)			PARI (000S)			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	€	116.840	151.229	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$ 68.276	74.708	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)	\$	80.509	87.763	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	43.793	48.004	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2031 (b)		78.089	85.356	United Kingdom Gilt 0,750 % fällig am 22.11.2047	£	15.927	44.725
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)		64.193	69.622	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	\$	36.939	41.604
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)		53.216	59.008	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£	21.696	35.204
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2032	£	26.380	56.282	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)	\$	28.202	32.055
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2051		19.190	50.221	France Government International Bond 0,700 % fällig am 25.07.2030	€	19.781	29.332
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.03.2050		14.060	39.318	Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030		22.000	27.950
France Government International Bond 0,700 % fällig am 25.07.2030	€	24.182	35.143	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.11.2036	£	13.231	27.256
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£	21.692	34.950	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)	\$	22.155	24.445
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	¥	3.049.526	29.120	France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024	€	15.958	20.395
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b)	\$	22.176	26.766	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2031 (b)	\$	17.694	19.846
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2039	£	11.800	25.398	United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.03.2050	£	6.367	17.779
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$	21.930	24.653	United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.03.2040		5.893	13.953
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	150.400	24.529	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027		7.597	13.782
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	\$	21.893	23.994	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.02.2041 (b)	\$	8.149	11.965
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£	9.050	23.279	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b)		6.034	7.188
Spain Government International Bond 0,700 % fällig am 30.11.2033	€	15.067	22.221	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	45.000	7.097
United Kingdom Gilt 0,375 % fällig am 22.03.2062	£	5.604	19.510	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 30.04.2026	\$	6.900	6.875
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2028	€	13.710	18.210				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.02.2042 (b)	\$	14.379	17.409				
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	102.200	16.578				
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053		102.300	16.471				
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028	¥	1.710.923	16.281				

(a) Der Global Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		
	1.462.227.635	\$ 14.566.661		1.421.894.212	\$ 14.164.700
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.07.2050	\$ 2.484.379	2.634.584	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.07.2050	\$ 2.279.452	2.417.707
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.06.2051	1.193.002	1.274.183	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.03.2049	1.859.070	1.987.737
Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.07.2050	928.128	984.385	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.07.2050	1.345.354	1.423.579
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.01.2051	862.174	926.770	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.06.2051	1.116.295	1.193.799
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.03.2049	541.873	579.132	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.01.2051	745.286	797.281
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.07.2049	434.101	466.317	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.05.2050	581.414	622.016
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 5.853.200	462.061	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.09.2050	544.711	583.772
U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.02.2031	\$ 439.881	421.231	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.06.2050	536.646	569.983
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.05.2050	304.841	327.435	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.07.2049	412.983	442.192
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	£ 148.050	205.286	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.03.2050	407.813	436.360
Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.12.2050	\$ 187.024	198.526	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.02.2049	269.831	286.410
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.09.2050	164.921	176.919	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.04.2050	255.327	268.378
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	€ 140.600	170.055	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.04.2050	221.577	235.032
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.06.2051	\$ 150.930	161.200	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.05.2050	220.520	231.792
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.07.2049	130.671	139.515	Freddie Mac 3,500 % fällig am 01.12.2049	199.415	211.799
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.07.2050	125.099	134.149	Saudi Government International Bond 4,000 % fällig am 17.04.2025	186.300	206.572
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029	127.800	127.457	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.08.2049	189.618	201.323
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.05.2049	117.271	125.905	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.12.2049	183.741	195.005
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.11.2048	116.408	125.149	Freddie Mac 3,500 % fällig am 01.02.2050	178.636	189.696

(a) Der Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.141.995	\$ 31.301	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	2.860.846	\$ 28.500
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	€ 4.247	5.511	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b)	\$ 1.705	2.031
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2031 (b)	\$ 3.030	3.315	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2031 (b)	1.100	1.233
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 10.600	1.693	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	1.147	1.178
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	9.800	1.562	France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2026	€ 703	932
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	\$ 1.220	1.340	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)	\$ 805	888
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	1.109	1.197	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	662	745
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	¥ 120.249	1.124	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b)	652	718
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2051	£ 380	994	United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.03.2040	£ 206	487
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2028	€ 523	702	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	\$ 407	463
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 10.03.2031	¥ 70.338	657	United Kingdom Gilt 0,750 % fällig am 22.11.2047	£ 142	397
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2039	£ 300	646	United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.03.2050	138	385
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	\$ 574	589	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 30.04.2026	\$ 300	299
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	508	566	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£ 107	269
Realkredit Danmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 3.400	548		AKTIEN	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)	\$ 401	438	Targa Resources Corp.	5.000	238
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 2.500	405		PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 30.04.2026	\$ 300	299	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.11.2036	£ 114	237
	AKTIEN			AKTIEN	
Targa Resources Corp.	8.388	290	Prologis, Inc.	1.953	217
	PARI (000S)		Pembina Pipeline Corp.	6.800	216
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028	¥ 30.296	283	Kinder Morgan, Inc.	11.493	202
			ONEOK, Inc.	2.989	137

(a) Der Inflation Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	12.168.913 \$	121.222	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	12.969.678 \$	129.200
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.11.2049	\$ 7.701	8.391	Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.11.2049	\$ 13.592	14.775
Israel Government International Bond 0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS 20.000	6.048	Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.08.2049	10.386	11.303
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	£ 4.250	5.893	Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.02.2049	4.825	5.235
Jubilee CLO BV 0,610 % fällig am 15.04.2030	€ 4.000	4.864	AbbVie Inc 2,300 % fällig am 21.11.2022	4.400	4.551
Trinity Square PLC 0,899 % fällig am 15.07.2059	£ 3.200	4.446	AbbVie, Inc. 2,150 % fällig am 19.11.2021	4.300	4.364
Primrose Residential 0,200 % fällig am 24.03.2061	€ 3.600	4.360	Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.04.2049	3.955	4.323
Toyota Motor Corp. 0,681 % fällig am 25.03.2024	\$ 3.700	3.700	CC Holdings GS LLC 3,849 % fällig am 15.04.2023	3.400	3.648
Anthem, Inc. 0,450 % fällig am 15.03.2023	3.700	3.699	Thomson Reuters Corp. 4,300 % fällig am 23.11.2023	2.800	3.068
Harvest CLO DAC 0,650 % fällig am 26.06.2030	€ 3.000	3.602	ING Groep NV 1,146 % fällig am 02.10.2023	3.000	3.058
Atmos Energy Corp. 0,503 % fällig am 09.03.2023	\$ 3.600	3.600	Daimler Finance North America LLC 1,030 % fällig am 22.02.2022	3.000	3.025
Verizon Communications, Inc. 0,550 % fällig am 22.03.2024	3.600	3.600	Bank of America Corp. 2,881 % fällig am 24.04.2023	2.900	2.992
Daimler Finance North America LLC 0,750 % fällig am 01.03.2024	3.600	3.594	Phillips 66 0,900 % fällig am 15.02.2024	2.900	2.908
Griffith Park CLO DAC 0,720 % fällig am 21.11.2031	€ 3.000	3.573	Allstate Corp. 0,750 % fällig am 15.12.2025	2.900	2.902
Boeing Co. 1,167 % fällig am 04.02.2023	\$ 3.500	3.500	Stryker Corp. 1,150 % fällig am 15.06.2025	2.800	2.842
Catamaran CLO Ltd. 1,444 % fällig am 22.04.2030	3.482	3.483	Bristol-Myers Squibb Co. 3,200 % fällig am 15.06.2026	2.500	2.797
Penske Truck Leasing Co. LP 1,700 % fällig am 15.06.2026	3.300	3.299	Chevron Corp. 1,554 % fällig am 11.05.2025	2.700	2.786
Madison Park Euro Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2032	€ 2.700	3.175	Ginnie Mae 4,500 % fällig am 20.01.2049	2.151	2.328
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,750 % fällig am 15.11.2031	2.600	3.143	Goldman Sachs Group, Inc. 3,618 % fällig am 26.04.2022	2.100	2.106
Barclays Bank PLC 10,000 % fällig am 21.05.2021	£ 2.200	3.112	Equitable Holdings, Inc. 3,900 % fällig am 20.04.2023	1.767	1.901
Hyundai Capital America 0,800 % fällig am 03.04.2023	\$ 3.100	3.094			
Hasbro, Inc. 3,550 % fällig am 19.11.2026	2.800	3.038	(a) Der Low Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.		
Pacific Gas & Electric Co. 1,367 % fällig am 10.03.2023	3.000	3.000	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
CenterPoint Energy Resources Corp. 0,631 % fällig am 02.03.2023	3.000	3.000	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
NTT Finance Corp. 0,373 % fällig am 03.03.2023	3.000	3.000			
JPMorgan Chase & Co. 0,697 % fällig am 16.03.2024	3.000	3.000			
Southern Co. 0,600 % fällig am 26.02.2024	3.000	3.000			
Fidelity National Information Services, Inc. 0,375 % fällig am 01.03.2023	3.000	2.998			
Ford Motor Credit Co. LLC 3,096 % fällig am 04.05.2023	2.900	2.965			
7-Eleven, Inc. 0,612 % fällig am 10.08.2022	2.900	2.900			
Venture CLO Ltd. 1,288 % fällig am 20.01.2029	2.900	2.900			
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 0,420 % fällig am 22.02.2023	2.900	2.900			
7-Eleven, Inc. 0,625 % fällig am 10.02.2023	2.900	2.898			
7-Eleven, Inc. 0,800 % fällig am 10.02.2024	2.900	2.898			
SK Hynix, Inc. 1,000 % fällig am 19.01.2024	2.900	2.894			
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 0,720 % fällig am 15.01.2031	€ 2.400	2.894			
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,700 % fällig am 15.01.2031	2.200	2.685			

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000\$)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	16.064.284	\$ 160.034	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	12.858.924	\$ 128.100
	PARI (000\$)			PARI (000\$)	
U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 30.04.2026	\$ 17.500	17.462	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$ 29.221	31.758
China Construction Bank Europe S.A. 0,000 % fällig am 28.06.2024	€ 2.800	3.326	Russia Government International Bond 6,500 % fällig am 28.02.2024	RUB 388.200	5.208
Wells Fargo & Co. 0,805 % fällig am 19.05.2025	\$ 3.300	3.300	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	\$ 4.900	4.863
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,625 % fällig am 24.09.2024	€ 2.600	3.219	Informa PLC 2,125 % fällig am 06.10.2025	€ 2.300	2.924
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % fällig am 01.04.2026	2.700	3.213	Citigroup, Inc. 0,981 % fällig am 01.05.2025	\$ 2.700	2.707
U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 31.05.2026	\$ 3.200	3.176	Nationwide Building Society 1,000 % fällig am 28.08.2025	2.700	2.679
DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024	3.200	3.172	CMS Energy Corp. 3,600 % fällig am 15.11.2025	1.650	1.812
Berry Global, Inc. 0,950 % fällig am 15.02.2024	3.170	3.170	Castellum AB 2,125 % fällig am 20.11.2023	€ 1.300	1.633
Virgin Money UK PLC 0,375 % fällig am 27.05.2024	€ 2.500	3.053	AP Moller - Maersk A/S 3,750 % fällig am 22.09.2024	\$ 1.450	1.568
Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 26.04.2024	\$ 2.700	2.708	National Fuel Gas Co. 5,500 % fällig am 15.01.2026	1.300	1.506
Citigroup, Inc. 0,981 % fällig am 01.05.2025	2.700	2.700	Southern California Edison Co. 1,200 % fällig am 01.02.2026	1.500	1.497
Morgan Stanley 0,731 % fällig am 05.04.2024	2.700	2.700	Banco Santander Mexico S.A. 5,375 % fällig am 17.04.2025	1.300	1.476
Credit Agricole S.A. 1,185 % fällig am 22.03.2024	2.600	2.622	Kaisa Group Holdings Ltd. 11,500 % fällig am 30.01.2023	1.400	1.428
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 3,854 % fällig am 16.11.2025	2.500	2.506	Hasbro, Inc. 3,550 % fällig am 19.11.2026	1.300	1.423
Banco Santander S.A. 1,500 % fällig am 14.04.2026	£ 1.700	2.333	Galp Energia SGPS S.A. 2,000 % fällig am 15.01.2026	€ 1.000	1.277
Expedia Group, Inc. 6,250 % fällig am 01.05.2025	\$ 2.000	2.329	Energy Transfer LP 2,900 % fällig am 15.05.2025	\$ 1.200	1.259
Diamondback Energy, Inc. 0,900 % fällig am 24.03.2023	2.300	2.300	China Development Bank 0,625 % fällig am 12.01.2024	1.200	1.199
Vantage Towers AG 0,000 % fällig am 31.03.2025	€ 1.900	2.241	Bank Mandiri Persero Tbk PT 3,750 % fällig am 11.04.2024	1.100	1.170
KLA Corp. 4,650 % fällig am 01.11.2024	\$ 2.000	2.236	MUFG Union Bank N.A. 2,100 % fällig am 09.12.2022	1.000	1.028

(a) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	11.069.187	\$ 110.269	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.063.867	\$ 140.100
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Fannie Mae 2,500 % fällig am 01.02.2051	\$ 13.829	14.562	Fannie Mae 2,500 % fällig am 01.02.2051	\$ 13.595	14.125
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 15.04.2025	€ 11.000	14.313	Dell Bank International DAC 1,625 % fällig am 24.06.2024	€ 6.500	8.105
U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.02.2031	\$ 11.649	11.156	Barclays PLC 3,375 % fällig am 02.04.2025	3.800	5.021
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	€ 8.500	10.270	S.A. Global Sukuk Ltd. 0,946 % fällig am 17.06.2024	\$ 4.600	4.606
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 125.300	9.952	Verizon Communications, Inc. 1,450 % fällig am 20.03.2026	4.562	4.598
ADLER Group S.A. 2,250 % fällig am 27.04.2027	€ 8.300	9.863	Natwest Group PLC 1,697 % fällig am 25.06.2024	3.200	3.280
Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	7.500	9.055	VMware, Inc. 4,700 % fällig am 15.05.2030	2.699	3.131
INEOS Finance PLC 2,500 % fällig am 01.04.2024	7.181	8.535	Pacific Gas & Electric Co. 3,150 % fällig am 01.01.2026	2.750	2.946
JDE Peet's NV 0,500 % fällig am 16.01.2029	5.700	6.903	Informa PLC 3,125 % fällig am 05.07.2026	£ 1.300	1.952
Wynn Resorts Finance LLC 7,750 % fällig am 15.04.2025	\$ 5.797	6.239	Broadcom, Inc. 3,150 % fällig am 15.11.2025	\$ 1.600	1.734
Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 4.400	5.308	InterContinental Hotels Group PLC 3,750 % fällig am 14.08.2025	£ 1.100	1.663
Dufry One BV 3,625 % fällig am 15.04.2026	CHF 4.753	5.246	AT&T, Inc. 2,750 % fällig am 01.06.2031	\$ 1.508	1.580
CommScope, Inc. 8,250 % fällig am 01.03.2027	\$ 4.900	5.243	Dell International LLC 5,850 % fällig am 15.07.2025	1.300	1.523
Societe Generale S.A. 1,792 % fällig am 09.06.2027	5.200	5.200	Broadcom, Inc. 4,250 % fällig am 15.04.2026	1.200	1.361
American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	5.098	5.098	SIG Combibloc Purchase Co. SARL 2,125 % fällig am 18.06.2025	€ 1.008	1.301
Petco Health & Wellness Co., Inc. 4,000 % fällig am 03.03.2028	5.030	5.017	HSBC Holdings PLC 2,633 % fällig am 07.11.2025	\$ 1.200	1.274
Pacific Gas & Electric Co. 1,367 % fällig am 10.03.2023	5.000	5.000	Dell International LLC 6,020 % fällig am 15.06.2026	1.000	1.195
Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033	€ 4.100	4.826	GE Capital Funding LLC 4,400 % fällig am 15.05.2030	1.000	1.171
VICI Properties LLC 1,841 % fällig am 20.12.2024	\$ 4.800	4.770	Life Storage LP 3,500 % fällig am 01.07.2026	1.000	1.123
Atrium Finance Issuer BV 2,625 % fällig am 05.09.2027	€ 3.900	4.651			
S.A. Global Sukuk Ltd. 0,946 % fällig am 17.06.2024	\$ 4.600	4.604			
S.A. Global Sukuk Ltd. 0,946 % fällig am 17.06.2024	4.600	4.600			
Verizon Communications, Inc. 1,450 % fällig am 20.03.2026	4.562	4.553			
TransDigm, Inc. 2,354 % fällig am 09.12.2025	4.500	4.449			
Bombardier, Inc. 6,125 % fällig am 15.01.2023	3.800	4.033			
PetSmart, Inc. 4,500 % fällig am 12.02.2028	4.000	3.960			
Petroleos Mexicanos 5,950 % fällig am 28.01.2031	4.000	3.876			
Broadcom, Inc. 3,469 % fällig am 15.04.2034	3.807	3.867			

(a) Der Low Duration Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000\$)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.533.774	\$ 35.204	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	2.760.515	\$ 27.500
TC Energy Corp.	28.300	1.442	Kinder Morgan, Inc.	137.200	2.209
Hess Midstream LP 'A'	54.581	1.150	ONEOK, Inc.	39.600	1.746
Targa Resources Corp.	35.100	1.140	Pembina Pipeline Corp.	57.800	1.737
Diamondback Energy, Inc.	15.200	1.093	Targa Resources Corp.	33.200	1.568
Enbridge, Inc.	26.600	1.080	Williams Cos., Inc.	35.700	818
EQT Corp.	46.000	859	Equitrans Midstream Corp.	107.900	777
Ovintiv, Inc.	33.900	843	Pioneer Natural Resources Co.	4.500	670
Cimarex Energy Co.	12.600	808	TC Energy Corp.	9.800	414
Chesapeake Energy Corp.	17.600	804			
Williams Cos., Inc.	26.400	639			
Pioneer Natural Resources Co.	4.500	597			
Equitrans Midstream Corp.	45.944	437			
ONEOK, Inc.	8.800	422			
Kinder Morgan, Inc.	28.600	403			
Cheniere Energy, Inc.	6.100	390			
Rattler Midstream LP	29.100	321			

(a) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	146.669.052	\$ 1.461.100	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	155.671.574	\$ 1.550.800
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Freddie Mac 2,000 % fällig am 01.04.2051	\$ 146.900	147.442	Freddie Mac 2,000 % fällig am 01.04.2051	\$ 146.493	146.767
Fannie Mae 2,000 % fällig am 01.03.2036	116.000	121.174	Fannie Mae 2,000 % fällig am 01.03.2036	115.305	119.139
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.06.2051	56.896	59.668	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.01.2051	60.025	63.927
Freddie Mac 2,000 % fällig am 01.03.2036	54.267	56.145	Freddie Mac 2,000 % fällig am 01.03.2036	53.476	55.125
Fannie Mae 2,000 % fällig am 01.01.2036	43.604	44.999	Fannie Mae 2,000 % fällig am 01.01.2036	43.093	44.527
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.05.2051	39.056	41.641	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.11.2050	30.156	31.159
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.05.2051	34.056	36.280	Fannie Mae 2,000 % fällig am 01.02.2036	29.145	30.206
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.06.2051	31.878	33.853	Freddie Mac 2,000 % fällig am 01.02.2036	17.262	17.880
Fannie Mae 2,000 % fällig am 01.02.2036	29.532	30.893	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.08.2050	14.762	15.446
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.04.2051	28.599	30.373	Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.07.2050	12.594	13.119
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.04.2051	28.233	30.017	Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.01.2049	7.659	8.206
Fingal Securities RMBS DAC 1,462 % fällig am 28.07.2055	€ 21.845	27.012	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.12.2050	7.903	8.160
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.06.2051	\$ 24.655	26.305	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.12.2049	7.655	8.079
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.02.2040	22.439	24.066	Freddie Mac 3,000 % fällig am 01.05.2050	7.621	7.976
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.01.2051	22.445	23.889	Contego CLO BV 0,369 % fällig am 15.11.2026	€ 5.398	6.429
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.04.2051	21.957	23.533	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.06.2047	\$ 5.362	5.759
Uniform Mortgage-Backed Security 2,000 % fällig am 01.04.2036	22.434	23.093	Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.06.2047	5.002	5.372
Madison Park Euro Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2032	€ 19.600	23.051	Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.08.2050	5.068	5.266
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.05.2051	\$ 21.077	22.510	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.03.2050	4.989	5.214

(a) Der Mortgage Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	7.600.478	\$ 75.716	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	11.583.925	\$ 115.400
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Trinity Square PLC 0,899 % fällig am 15.07.2059	£ 23.800	33.065	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	\$ 33.287	34.172
Bank of America Corp. 0,455 % fällig am 24.08.2025	€ 23.500	29.060	JPMorgan Chase & Co. 1,063 % fällig am 23.07.2024	10.800	10.956
Madison Park Euro Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2032	24.700	29.048	Citigroup, Inc. 1,158 % fällig am 01.06.2024	9.300	9.413
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	15.000	18.235	Nationwide Building Society 3,766 % fällig am 08.03.2024	8.700	9.190
Griffith Park CLO DAC 0,720 % fällig am 21.11.2031	11.600	13.814	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2022 (b)	6.785	6.933
Credit Suisse Mortgage Capital Trust 3,850 % fällig am 25.09.2057	\$ 10.420	10.869	Suntory Holdings Ltd. 2,550 % fällig am 28.06.2022	6.700	6.856
GS Mortgage Securities Corp. Trust 4,074 % fällig am 10.01.2047	9.886	10.671	CDBL Funding 1,406 % fällig am 15.11.2021	6.000	5.999
Barclays PLC 2,375 % fällig am 06.10.2023	£ 6.700	9.692	Development Bank of Japan, Inc. 2,000 % fällig am 19.10.2021	5.000	5.047
Taurus DEU DAC 1,200 % fällig am 22.12.2030	€ 7.200	8.591	Syngenta Finance NV 4,441 % fällig am 24.04.2023	4.050	4.244
Stratton Mortgage Funding PLC 0,749 % fällig am 12.12.2043	£ 4.900	6.941	Standard Chartered PLC 1,328 % fällig am 10.09.2022	4.100	4.117
Pacific Gas & Electric Co. 1,750 % fällig am 16.06.2022	\$ 5.512	5.512	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 1,036 % fällig am 26.07.2023	4.000	4.054
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2049 (b)	3.681	4.740	Tokyo Metropolitan Government 2,500 % fällig am 08.06.2022	3.200	3.278
HSBC Holdings PLC 1,750 % fällig am 24.07.2027	£ 3.300	4.576	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 1,070 % fällig am 22.02.2022	2.500	2.517
Canada Square Funding PLC 0,829 % fällig am 17.06.2058	3.200	4.446	Bayer U.S. Finance LLC 1,129 % fällig am 15.12.2023	2.400	2.434
HSBC Holdings PLC 2,633 % fällig am 07.11.2025	\$ 3.900	4.116	Equifax, Inc. 1,026 % fällig am 15.08.2021	2.300	2.306
Deutsche Bank AG 0,750 % fällig am 17.02.2027	€ 3.400	4.097	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)	1.490	1.891
Dorchester Park CLO DAC 1,050 % fällig am 21.01.2029	3.100	3.737	Wells Fargo & Co. 1,741 % fällig am 04.05.2030	€ 1.400	1.821
Israel Government International Bond 0,750 % fällig am 31.07.2022	ILS 11.900	3.670	NTT Finance Corp. 1,900 % fällig am 21.07.2021	\$ 1.400	1.406
Bear Stearns ALT-A Trust 3,115 % fällig am 25.11.2036	\$ 4.542	3.485	Penske Truck Leasing Co. LP 3,375 % fällig am 01.02.2022	1.300	1.324

(a) Der StocksPLUS™ Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	50.224	\$ 500
	PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.02.2031	\$ 300	287
Vericrest Opportunity Loan Transferee 2,116 % fällig am 25.04.2051	200	200
Pretium Mortgage Credit Partners LLC 2,240 % fällig am 27.09.2060	200	200
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.02.2044 (b)	112	156
Precise Mortgage Funding PLC 1,249 % fällig am 12.12.2055	£ 100	138
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2046 (b)	\$ 110	136
Jubilee CLO BV 0,610 % fällig am 15.04.2030	€ 100	122
Contego CLO DAC 0,640 % fällig am 23.01.2030	100	121
Armada Euro CLO DAC 0,720 % fällig am 15.07.2031	100	119
Griffith Park CLO DAC 0,720 % fällig am 21.11.2031	100	119
OAK Hill European Credit Partners DAC 0,730 % fällig am 20.01.2032	100	119
Ares European CLO DAC 0,660 % fällig am 15.10.2030	100	118
Expedia Group, Inc. 6,250 % fällig am 01.05.2025	\$ 100	116
T-Mobile USA, Inc. 2,250 % fällig am 15.02.2026	100	100
Nissan Motor Acceptance Corp. 2,750 % fällig am 09.03.2028	50	50

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	\$ 660	\$ 730
	AKTIEN	
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	30.114	300

- (a) Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.
 (b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung Strategic Income Fund

30. Juni 2021

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	19.253.517	\$ 191.803	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	19.644.661	\$ 195.700
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.03.2049	\$ 5.899	6.298	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.03.2049	\$ 26.310	28.139
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 64.600	5.126	Paragon Mortgages PLC 1,099 % fällig am 15.05.2045	£ 8.179	11.313
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029	\$ 5.100	5.100	Ripon Mortgages PLC 0,881 % fällig am 20.08.2056	3.972	5.470
Verizon Communications, Inc. 3,400 % fällig am 22.03.2041	3.460	3.458	AKTIEN Exxon Mobil Corp.	98.577	5.462
American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	3.457	3.457	PARI (000S)		
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	€ 2.800	3.368	Navient Student Loan Trust 1,142 % fällig am 27.12.2066	\$ 4.009	4.078
Aeroporti di Roma SpA 1,750 % fällig am 30.07.2031	2.762	3.282	AKTIEN International Business Machines Corp.	28.298	3.725
Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033	2.735	3.219	PARI (000S)		
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. 7,750 % fällig am 15.04.2028	\$ 2.825	2.825	Gallatin CLO Ltd. 1,484 % fällig am 15.07.2027	\$ 3.626	3.628
Summe SE	AKTIEN 59.406	2.782	AKTIEN AbbVie, Inc.	33.316	3.627
Altria Group, Inc.	39.515	1.972	BHP Group Ltd.	95.258	3.439
Telefonica S.A.	430.962	1.960	Occidental Petroleum Corp.	129.569	3.266
Exxon Mobil Corp.	34.193	1.920	PARI (000S)		
Soundview Home Loan Trust 0,402 % fällig am 25.06.2036	\$ 2.004	1.818	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.01.2050	\$ 2.962	3.170
Caesars Resort Collection LLC 4,604 % fällig am 21.07.2025	1.800	1.809	AKTIEN Altria Group, Inc.	64.316	3.000
Repsol S.A.	147.681	1.805	Macy's, Inc.	164.534	2.810
PARI (000S)			Lumen Technologies, Inc.	202.699	2.660
U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.02.2031	\$ 1.880	1.800	PARI (000S)		
Windstream Escrow LLC 7,750 % fällig am 15.08.2028	1.689	1.734	Twin Bridges PLC 0,864 % fällig am 12.09.2044	£ 1.928	2.654
AKTIEN Chevron Corp.	15.003	1.545	AKTIEN Ford Motor Co.	201.824	2.434
			PARI (000S)		
			Petrobras Global Finance BV 5,093 % fällig am 15.01.2030	\$ 2.193	2.337
			AKTIEN Philip Morris International, Inc.	25.807	2.298
			AT&T, Inc.	76.281	2.271

(a) Der Strategic Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung Total Return Bond Fund

30. Juni 2021

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	37.560.938	\$ 374.174	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	57.659.536	\$ 574.400
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	\$ 38.800	37.249	Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.07.2049	\$ 33.642	36.602
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	£ 23.300	32.308	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.05.2035	30.179	32.189
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 26.700	32.020	Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.08.2049	23.576	25.705
Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.07.2049	\$ 25.203	27.463	Verizon Communications, Inc. 3,376 % fällig am 15.02.2025	18.901	20.806
Jubilee CLO BV 0,610 % fällig am 15.04.2030	€ 20.000	24.319	Latam Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.11.2027	15.916	15.916
Trinity Square PLC 0,899 % fällig am 15.07.2059	£ 16.500	22.923	Boston Properties LP 3,200 % fällig am 15.01.2025	14.450	15.698
Primrose Residential 0,200 % fällig am 24.03.2061	€ 16.000	19.379	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.02.2049	14.709	15.633
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	\$ 19.400	19.256	Charter Communications Operating LLC 4,464 % fällig am 23.07.2022	14.700	15.462
Venture CLO Ltd. 1,288 % fällig am 20.01.2029	19.200	19.200	Bank of America Corp. 0,981 % fällig am 25.09.2025	15.000	15.148
Natwest Group PLC 0,780 % fällig am 26.02.2030	€ 15.000	18.238	Daimler Finance North America LLC 2,550 % fällig am 15.08.2022	14.200	14.655
LeasePlan Corp. NV 0,250 % fällig am 23.02.2026	15.000	18.128	Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.11.2049	12.359	13.467
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	15.000	17.862	Goldman Sachs Group, Inc. 0,966 % fällig am 31.10.2022	13.280	13.342
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % fällig am 27.01.2028	13.300	16.002	Wells Fargo & Co. 3,750 % fällig am 24.01.2024	11.900	12.948
Broadcom, Inc. 2,600 % fällig am 15.02.2033	\$ 16.000	15.964	Citigroup, Inc. 0,776 % fällig am 30.10.2024	12.600	12.707
CVC Cordatus Loan Fund DAC 0,630 % fällig am 15.09.2031	€ 13.000	15.807	Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.10.2049	10.033	10.933
Blackrock European CLO DAC 0,620 % fällig am 15.10.2031	13.000	15.807	Ginnie Mae 4,500 % fällig am 20.06.2048	9.371	10.169
Standard Chartered PLC 1,456 % fällig am 14.01.2027	\$ 15.800	15.800	Ginnie Mae 4,500 % fällig am 20.01.2049	8.869	9.600
Cairn CLO BV 0,600 % fällig am 30.04.2031	€ 13.000	15.779	CenterPoint Energy Resources Corp. 3,550 % fällig am 01.04.2023	9.000	9.591
Atlas Senior Loan Fund Ltd. 1,530 % fällig am 16.01.2030	\$ 15.000	15.003	Johnson & Johnson 0,550 % fällig am 01.09.2025	9.400	9.388
Bank of Ireland Group PLC 0,375 % fällig am 10.05.2027	€ 12.300	14.795			
Lehman XS Trust 0,292 % fällig am 25.03.2047	\$ 14.857	14.569	(a) Der Total Return Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.		
Madison Park Euro Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2032	€ 12.300	14.465	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
Armada Euro CLO DAC 0,720 % fällig am 15.07.2031	12.000	14.326	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Griffith Park CLO DAC 0,720 % fällig am 21.11.2031	12.000	14.291			
Entergy Louisiana LLC 2,350 % fällig am 15.06.2032	\$ 14.000	13.928			
Man GLG Euro CLO DAC 0,690 % fällig am 15.12.2031	€ 11.100	13.219			
Digital Intrepid Holding BV 0,625 % fällig am 15.07.2031	10.300	12.583			
ING Groep NV 1,125 % fällig am 07.12.2028	£ 9.100	12.507			
Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % fällig am 16.03.2028	€ 10.200	12.115			
Japan Finance Organization for Municipalities 0,010 % fällig am 02.02.2028	9.900	12.098			
Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 0,875 % fällig am 21.03.2046	10.000	11.862			
Nidec Corp. 0,046 % fällig am 30.03.2026	10.000	11.830			
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 0,737 % fällig am 25.01.2036	\$ 11.199	11.202			
Workspace Group PLC 2,250 % fällig am 11.03.2028	£ 7.600	10.616			

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	1.244.951	\$ 12.402	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	893.361	\$ 8.900
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Goldman Sachs Group, Inc. 0,441 % fällig am 08.03.2023	\$ 1.100	1.100	Charles Schwab Corp. 0,550 % fällig am 18.03.2024	\$ 200	201
Boeing Co. 1,167 % fällig am 04.02.2023	600	603	(a) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.		
St Paul's CLO DAC 0,850 % fällig am 25.04.2030	€ 400	485	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
Dilosk RMBS DAC 0,197 % fällig am 20.02.2060	400	482	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Towd Point Mortgage Funding PLC 1,111 % fällig am 20.10.2051	£ 343	474			
BBAM European CLO DAC 1,600 % fällig am 22.01.2033	€ 300	362			
OAK Hill European Credit Partners DAC 0,740 % fällig am 20.10.2031	300	353			
Euro-Galaxy CLO DAC 0,620 % fällig am 24.04.2034	250	303			
Harvest CLO DAC 0,650 % fällig am 26.06.2030	250	300			
Atmos Energy Corp. 0,503 % fällig am 09.03.2023	\$ 300	300			
Israel Government International Bond 0,020 % fällig am 30.11.2021	ILS 940	285			
Trinity Square PLC 0,899 % fällig am 15.07.2059	£ 200	278			
Charles Schwab Corp. 0,550 % fällig am 18.03.2024	\$ 200	200			
7-Eleven, Inc. 0,612 % fällig am 10.08.2022	200	200			
Israel Government International Bond 0,750 % fällig am 31.07.2022	ILS 360	109			
Israel Government International Bond 5,500 % fällig am 31.01.2022	240	77			
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2022	100	31			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
MPT Operating Partnership LP 2,500 % fällig am 24.03.2026	£ 5.300	£ 5.297	Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030	€ 8.500	£ 7.751
Credit Suisse AG 1,125 % fällig am 15.12.2025	4.300	4.280	E.ON International Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034	£ 3.000	3.991
ING Groep NV 1,125 % fällig am 07.12.2028	3.800	3.770	Glencore Finance Europe Ltd. 3,125 % fällig am 26.03.2026	3.700	3.949
Goldman Sachs Group, Inc. 1,875 % fällig am 16.12.2030	3.700	3.688	Amgen, Inc. 4,000 % fällig am 13.09.2029	3.200	3.839
Goldman Sachs Group, Inc. 1,500 % fällig am 07.12.2027	3.700	3.681	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	2.900	2.936
Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 22.12.2028	3.500	3.469	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 1,750 % fällig am 19.05.2032	2.800	2.915
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,875 % fällig am 07.12.2027	3.400	3.400	HSBC Holdings PLC 3,000 % fällig am 29.05.2030	2.700	2.906
Cooperatieve Rabobank UA 4,375 % fällig am 29.06.2027	€ 3.400	3.345	BMW International Investment BV 0,750 % fällig am 08.03.2024	2.700	2.726
BNP Paribas S.A. 2,000 % fällig am 24.05.2031	£ 3.200	3.193	Wells Fargo & Co. 2,500 % fällig am 02.05.2029	2.500	2.723
LeasePlan Corp. NV 0,250 % fällig am 23.02.2026	€ 3.500	3.041	Severn Trent Utilities Finance PLC 2,750 % fällig am 05.12.2031	2.300	2.614
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 2.900	2.900	Enel Finance International NV 1,000 % fällig am 20.10.2027	2.500	2.474
Banco Santander S.A. 1,500 % fällig am 14.04.2026	2.900	2.887	Shell International Finance BV 1,750 % fällig am 10.09.2052	2.700	2.454
AA Bond Co. Ltd. 4,875 % fällig am 31.07.2043	2.700	2.876	Volkswagen Financial Services NV 1,625 % fällig am 30.11.2022	2.400	2.445
Digital Intrepid Holding BV 0,625 % fällig am 15.07.2031	€ 3.100	2.786	HSBC Bank PLC 4,750 % fällig am 24.03.2046	1.747	2.394
Nykredit Realkredit A/S 0,375 % fällig am 17.01.2028	2.700	2.343	Goldman Sachs Group, Inc. 3,125 % fällig am 25.07.2029	2.000	2.217
APT Pipelines Ltd. 2,500 % fällig am 15.03.2036	£ 2.100	2.088	LeasePlan Corp. NV 0,250 % fällig am 23.02.2026	€ 2.400	2.083
Travis Perkins PLC 4,500 % fällig am 07.09.2023	1.800	1.948	Prologis International Funding S.A. 1,625 % fällig am 17.06.2032	2.100	2.060
Bank of America Corp. 1,667 % fällig am 02.06.2029	1.900	1.900	Anheuser-Busch InBev S.A. 2,250 % fällig am 24.05.2029	£ 1.900	2.056
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	1.900	1.884	Motability Operations Group PLC 1,750 % fällig am 03.07.2029	1.900	2.042
Grainger PLC 3,000 % fällig am 03.07.2030	1.685	1.845	Credit Suisse AG 1,125 % fällig am 15.12.2025	2.000	1.987
Mortimer BTL PLC 0,750 % fällig am 23.06.2053	1.800	1.800	CaixaBank S.A. 0,750 % fällig am 10.07.2026	€ 2.100	1.955
Whitbread Group PLC 2,375 % fällig am 31.05.2027	1.800	1.791	Northern Powergrid Northeast PLC 1,875 % fällig am 16.06.2062	£ 1.950	1.955
Babcock International Group PLC 1,875 % fällig am 05.10.2026	1.800	1.767	Bayer AG 1,125 % fällig am 06.01.2030	€ 2.000	1.910
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 2.000	1.720	Bayer AG 0,750 % fällig am 06.01.2027	2.000	1.873
Twin Bridges PLC 0,899 % fällig am 12.03.2055	£ 1.700	1.700	General Electric Co. 5,250 % fällig am 07.12.2028	£ 1.500	1.864
Vantage Towers AG 0,375 % fällig am 31.03.2027	€ 1.900	1.634	Whitbread Group PLC 2,375 % fällig am 31.05.2027	1.800	1.804
CaixaBank S.A. 1,500 % fällig am 03.12.2026	£ 1.600	1.598	Anglian Water Services Financing PLC 1,625 % fällig am 10.08.2025	1.700	1.765
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 0,200 % fällig am 21.01.2061	€ 1.700	1.514	Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % fällig am 24.06.2024	1.550	1.725
			Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 27.03.2037	1.200	1.664

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKAUFE BIS 30. JUNI 2021		
MPT Operating Partnership LP 3,375 % fällig am 24.04.2030	£ 3.000	£ 2.983	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % fällig am 15.09.2026	£ 7.500	£ 7.634
Electricite de France S.A. 5,125 % fällig am 22.09.2050	1.700	2.615		AKTIEN	
Electricite de France S.A. 2,625 % fällig am 01.12.2027	€ 3.000	2.575	PIMCO ETFs plc – PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)	69.000	7.097
Thames Water Utilities Finance PLC 4,375 % fällig am 03.07.2034	£ 1.600	2.104		PARI (000S)	
M&G PLC 5,560 % fällig am 20.07.2055	1.800	2.054	Europäische Investitionsbank 6,000 % fällig am 07.12.2028	£ 5.000	6.907
E.ON International Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034	1.500	1.992	Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030	€ 6.300	5.745
London & Quadrant Housing Trust 2,000 % fällig am 20.10.2038	1.700	1.802	Network Rail Infrastructure Finance PLC 4,750 % fällig am 29.11.2035	£ 1.800	2.605
Verizon Communications, Inc. 1,875 % fällig am 03.11.2038	1.800	1.713	University of Oxford 2,544 % fällig am 08.12.2117	1.300	1.881
BNP Paribas S.A. 2,000 % fällig am 24.05.2031	1.700	1.696	Berkshire Hathaway, Inc. 2,625 % fällig am 19.06.2059	1.400	1.767
CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 22.01.2028	1.500	1.526	General Electric Co. 5,250 % fällig am 07.12.2028	1.400	1.748
	AKTIEN		E.ON International Finance BV 6,375 % fällig am 07.06.2032	1.000	1.467
PIMCO ETFs plc – PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)	14.500	1.492	Italy Government International Bond 6,000 % fällig am 04.08.2028	1.100	1.425
	PARI (000S)		Pfizer, Inc. 2,735 % fällig am 15.06.2043	1.250	1.424
National Grid Gas PLC 1,125 % fällig am 14.01.2033	£ 1.500	1.488	Eastern Power Networks PLC 1,875 % fällig am 01.06.2035	1.400	1.416
Morhomes PLC 3,400 % fällig am 19.02.2040	1.300	1.468	Natwest Group PLC 3,125 % fällig am 28.03.2027	1.300	1.398
American Tower Corp. 1,250 % fällig am 21.05.2033	€ 1.700	1.453	National Grid Gas PLC 1,125 % fällig am 14.01.2033	1.500	1.390
Great Places Housing Group Ltd. 4,750 % fällig am 22.10.2042	£ 1.000	1.408	Telereal Securitisation PLC 5,948 % fällig am 10.12.2031	1.108	1.377
Scottish Hydro Electric Transmission PLC 2,125 % fällig am 24.03.2036	1.400	1.393	Connect Plus M25 Issuer PLC 2,607 % fällig am 31.03.2039	1.235	1.367
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	1.300	1.300	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	1.300	1.316
Bank of America Corp. 1,667 % fällig am 02.06.2029	1.300	1.300	Motability Operations Group PLC 3,625 % fällig am 10.03.2036	1.000	1.305
Mortimer BTL PLC 0,750 % fällig am 23.06.2053	1.300	1.300	HSBC Bank PLC 4,750 % fällig am 24.03.2046	1.000	1.302
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 1.500	1.290	Bank of America Corp. 1,667 % fällig am 02.06.2029	1.300	1.300
Credit Suisse Group AG 7,500 % fällig am 11.12.2023	\$ 1.600	1.274	States of Guernsey Bond 3,375 % fällig am 12.12.2046	1.000	1.296
Enel Finance International NV 0,875 % fällig am 17.06.2036	€ 1.500	1.267	Cadent Finance PLC 2,625 % fällig am 22.09.2038	1.250	1.276
Lloyds Banking Group PLC 7,875 % fällig am 27.06.2029	£ 1.000	1.250	BPCE S.A. 5,250 % fällig am 16.04.2029	1.000	1.238
Gatwick Funding Ltd. 3,125 % fällig am 28.09.2041	1.200	1.230	McDonald's Corp. 2,950 % fällig am 15.03.2034	1.100	1.216
Aroundtown S.A. 3,625 % fällig am 10.04.2031	1.000	1.177	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 1,750 % fällig am 19.05.2032	1.200	1.213
General Electric Co. 5,375 % fällig am 18.12.2040	850	1.162	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.10.2030	€ 1.300	1.134
HSBC Bank PLC 4,750 % fällig am 24.03.2046	800	1.139	Electricite de France S.A. 5,000 % fällig am 21.09.2048	\$ 1.300	1.132
JPMorgan Chase & Co. 1,895 % fällig am 28.04.2033	1.100	1.100	Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 27.03.2037	£ 800	1.119
Paragon Treasury PLC 2,000 % fällig am 07.05.2036	1.100	1.096	Southern Electric Power Distribution PLC 5,500 % fällig am 07.06.2032	800	1.110
Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 22.12.2028	1.100	1.095	Lloyds Banking Group PLC 7,625 % fällig am 27.06.2023	1.000	1.095
Notting Hill Genesis 2,000 % fällig am 03.06.2036	1.100	1.089	Digital Stout Holding LLC 3,750 % fällig am 17.10.2030	950	1.094
United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.04.2029	\$ 1.332	1.056			
Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 1.200	1.025	(a) Der UK Long Term Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.		
Natwest Group PLC 2,105 % fällig am 28.11.2031	£ 1.000	1.000	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
HSBC Holdings PLC 1,750 % fällig am 24.07.2027	1.000	999	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
APT Pipelines Ltd. 2,500 % fällig am 15.03.2036	1.000	994			
CCEP Finance Ireland DAC 1,500 % fällig am 06.05.2041	€ 1.100	949			
AT&T, Inc. 4,250 % fällig am 01.06.2043	£ 700	921			
Twin Bridges PLC 0,899 % fällig am 12.03.2055	900	900			
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	900	893			

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	53.100.040	\$ 528.970	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	62.478.593	\$ 622.400
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Endure Digital, Inc. 6,000 % fällig am 15.02.2029	\$ 12.750	12.686	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030	\$ 30.000	28.064
Madison IAQ LLC 5,875 % fällig am 30.06.2029	12.500	12.526	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	20.000	20.001
CCO Holdings LLC 4,500 % fällig am 01.06.2033	11.750	11.750	Change Healthcare Holdings LLC 5,750 % fällig am 01.03.2025	9.000	9.270
Community Health Systems, Inc. 6,875 % fällig am 15.04.2029	11.500	11.500	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	10.000	9.191
BCPE Empire Holdings, Inc. 7,625 % fällig am 01.05.2027	11.500	11.471	Brand Industrial Services, Inc. 8,500 % fällig am 15.07.2025	8.000	8.146
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 8.750	10.494	United States Steel Corp. 6,875 % fällig am 01.03.2029	6.425	6.537
PetSmart, Inc. 7,750 % fällig am 15.02.2029	\$ 10.000	10.089	Cenovus Energy, Inc. 6,750 % fällig am 15.11.2039	5.000	6.502
PetSmart, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2028	10.000	10.045	Credit Agricole S.A. 7,875 % fällig am 23.01.2024	5.000	5.669
Organon Finance LLC 5,125 % fällig am 30.04.2031	10.000	10.032	Navient Corp. 5,875 % fällig am 25.10.2024	5.000	5.275
Victors Merger Corp. 6,375 % fällig am 15.05.2029	10.000	10.011	Ally Financial, Inc. 5,125 % fällig am 30.09.2024	3.750	4.242
U.S. Foods, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2029	10.000	10.007	Korn Ferry 4,625 % fällig am 15.12.2027	4.000	4.205
Park River Holdings, Inc. 5,625 % fällig am 01.02.2029	10.000	10.001	Terex Corp. 5,000 % fällig am 15.05.2029	4.000	4.165
SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	10.000	10.000	CDW LLC 3,250 % fällig am 15.02.2029	3.750	3.792
Go Daddy Operating Co. LLC 3,500 % fällig am 01.03.2029	10.000	10.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 3,150 % fällig am 01.10.2026	4.000	3.790
Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	10.000	10.000	Devon Energy Corp. 5,250 % fällig am 15.10.2027	3.250	3.506
Post Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 15.09.2031	10.000	9.969	BNP Paribas S.A. 7,375 % fällig am 19.08.2021	3.000	3.496
Ahead DB Holdings LLC 6,625 % fällig am 01.05.2028	9.625	9.726	Berry Global, Inc. 5,625 % fällig am 15.07.2027	3.250	3.445
Bombardier, Inc. 7,125 % fällig am 15.06.2026	9.500	9.500	Cenovus Energy, Inc. 4,250 % fällig am 15.04.2027	3.000	3.274
Deluxe Corp. 8,000 % fällig am 01.06.2029	9.350	9.490	Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings, Inc. 6,000 % fällig am 01.02.2026	3.000	3.098

(a) Der US High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	10.911.319	\$ 108.701	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	11.523.437	\$ 114.800
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	\$ 30.700	28.530	Morgan Stanley 2,188 % fällig am 28.04.2026	\$ 8.000	8.402
U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 15.05.2031	18.290	18.403	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030	8.670	8.145
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 9.100	10.913	U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	7.662	6.763
U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	\$ 7.662	7.065	U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.08.2049	6.100	6.660
Oracle Corp. 2,300 % fällig am 25.03.2028	6.800	6.783	JPMorgan Chase & Co. 4,005 % fällig am 23.04.2029	5.400	6.148
7-Eleven, Inc. 1,800 % fällig am 10.02.2031	6.600	6.596	Bank of America Corp. 3,500 % fällig am 19.04.2026	5.000	5.563
Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 26.04.2024	6.200	6.236	Weyerhaeuser Co. 4,000 % fällig am 15.11.2029	4.600	5.220
U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.05.2041	6.000	6.051	Walt Disney Co. 1,750 % fällig am 13.01.2026	4.700	4.893
Verizon Communications, Inc. 0,840 % fällig am 20.03.2026	5.500	5.500	U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.08.2050	5.700	4.703
Wynn Macau Ltd. 5,625 % fällig am 26.08.2028	5.065	5.329	U.S. Treasury Bonds 1,250 % fällig am 15.05.2050	5.600	4.653
JPMorgan Chase & Co. 2,580 % fällig am 22.04.2032	5.100	5.100	Credit Suisse Group AG 7,250 % fällig am 12.09.2025	3.800	4.275
Charter Communications Operating LLC 3,900 % fällig am 01.06.2052	5.000	4.897	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3,500 % fällig am 12.11.2029	3.500	3.601
American Tower Corp. 2,700 % fällig am 15.04.2031	4.300	4.292	Shell International Finance BV 3,250 % fällig am 06.04.2050	3.500	3.385
DTE Electric Co. 1,900 % fällig am 01.04.2028	3.800	3.797	Synchrony Financial 3,950 % fällig am 01.12.2027	2.900	3.197
Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026	3.200	3.200	UnitedHealth Group, Inc. 2,750 % fällig am 15.05.2040	3.300	3.163
Bank of America Corp. 2,687 % fällig am 22.04.2032	3.200	3.200	Discover Bank 2,450 % fällig am 12.09.2024	2.800	2.959
UniCredit SpA 7,500 % fällig am 03.06.2026	€ 2.200	3.171	NSTAR Electric Co. 3,950 % fällig am 01.04.2030	2.500	2.920
Saudi Government International Bond 2,250 % fällig am 02.02.2033	\$ 2.700	2.676	Prudential Financial, Inc. 5,700 % fällig am 15.09.2048	2.500	2.884
Cooperatieve Rabobank UA 3,100 % fällig am 29.06.2028	€ 2.200	2.624	Wells Fargo & Co. 2,879 % fällig am 30.10.2030	2.700	2.777

a) Der US Investment Grade Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2021			VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2021		
U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 31.03.2023	\$ 200.000	\$ 199.899	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 30.11.2022	\$ 114.400	\$ 114.381
Federal Home Loan Bank 1,020 % fällig am 24.02.2027	45.000	45.000	Federal Home Loan Bank 0,700 % fällig am 19.08.2025	65.000	65.004
Federal Home Loan Bank 0,900 % fällig am 26.02.2027	41.900	41.883	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 30.04.2023	40.700	40.689
U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 30.04.2023	40.700	40.673	AKTIEN		
Federal Home Loan Bank 0,830 % fällig am 10.02.2027	37.000	37.000	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.734.084	37.200
Stratton Mortgage Funding PLC 0,948 % fällig am 20.07.2060	£ 25.950	35.982	PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	314.100	31.887
Federal Home Loan Bank 0,850 % fällig am 17.02.2027	\$ 33.500	33.500	PARI (000S)		
QNB Finance Ltd. 1,125 % fällig am 17.06.2024	32.100	32.090	Federal Home Loan Bank 0,700 % fällig am 18.08.2025	\$ 25.000	25.001
Federal Home Loan Bank 1,115 % fällig am 26.02.2027	31.500	31.500	Federal Home Loan Bank 0,750 % fällig am 21.07.2025	21.515	21.518
Federal Home Loan Bank 0,920 % fällig am 26.02.2027	29.100	29.100	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 31.03.2023	17.700	17.697
Federal Home Loan Bank 0,960 % fällig am 05.03.2026	28.300	28.300	QNB Finance Ltd. 1,176 % fällig am 02.05.2022	15.090	15.173
Ginnie Mae 0,410 % fällig am 20.06.2051	28.200	28.121	Turbo Finance 9 PLC 0,880 % fällig am 20.08.2028	£ 9.070	12.512
Federal Home Loan Bank 0,750 % fällig am 24.02.2026	28.000	28.000	Charles Schwab Corp. 0,550 % fällig am 18.03.2024	\$ 9.500	9.560
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,700 % fällig am 15.01.2031	€ 20.000	24.413	Bumper UK Finance PLC 0,650 % fällig am 20.12.2028	£ 6.570	9.019
DBC Mortgage Trust 0,801 % fällig am 15.06.2034	\$ 21.800	21.784	Phillips 66 0,776 % fällig am 15.02.2024	\$ 8.875	8.892
Israel Government International Bond 5,500 % fällig am 31.01.2022	ILS 61.400	19.786	Mizuho Financial Group, Inc. 1,034 % fällig am 13.09.2023	7.655	7.722
Santander UK Group Holdings PLC 1,089 % fällig am 15.03.2025	\$ 19.000	19.000	QNB Finance Ltd. 1,256 % fällig am 12.02.2022	7.300	7.338
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 0,850 % fällig am 10.02.2027	18.800	18.799	Lloyds Banking Group PLC 2,858 % fällig am 17.03.2023	7.000	7.185
Contego CLO DAC 0,640 % fällig am 23.01.2030	€ 13.500	16.401	QNB Finance Ltd. 2,125 % fällig am 07.09.2021	5.718	5.738
Ginnie Mae 0,760 % fällig am 20.06.2051	\$ 16.100	16.082	ADCB Finance Cayman Ltd. 1,400 % fällig am 14.06.2021	£ 4.000	5.678
Ford Motor Credit Co. LLC 5,875 % fällig am 02.08.2021	14.900	15.219	AT&T, Inc. 1,299 % fällig am 12.06.2024	\$ 5.500	5.651
Atmos Energy Corp. 0,503 % fällig am 09.03.2023	11.600	11.600	Credit Suisse AG 1,000 % fällig am 05.05.2023	4.000	4.058

(a) Der US Short-Term Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Glossar: (möglicherweise im vorstehenden Abschluss verwendete Abkürzungen)

Abkürzungen der Kontrahenten:

AZD	Australia and New Zealand Banking Group	DUB	Deutsche Bank AG	MFK	Barclays Capital, Inc.
BOA	Bank of America N.A.	FAR	Wells Fargo Bank National Association	MSB	Morgan Stanley Bank, N.A.
BOS	BoFA Securities, Inc.	FBF	Credit Suisse International	MYC	Morgan Stanley Capital Services LLC
BPG	BNP Paribas Securities Corp.	FCT	Credit Suisse Capital LLC	MYI	Morgan Stanley & Co. International PLC
BPS	BNP Paribas S.A.	FICC	Fixed Income Clearing Corporation	NOM	Nomura Securities International Inc.
BRC	Barclays Bank PLC	GLM	Goldman Sachs Bank USA	RBC	Royal Bank of Canada
BSH	Banco Santander S.A. – New York Branch	GRE	NatWest Markets Securities Inc.	RDR	RBC Capital Markets LLC
BSN	The Bank of Nova Scotia – Toronto	GSC	Goldman Sachs & Co. LLC	RYL	NatWest Markets Plc
BSS	Banco Santander S.A.	GST	Goldman Sachs International	SAL	Citigroup Global Markets, Inc.
CBK	Citibank N.A.	HUS	HSBC Bank USA N.A.	SCX	Standard Chartered Bank, London
CFR	Credit Suisse Securities (Europe) Ltd.	IND	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	SGY	Societe Generale, NY
CIB	Canadian Imperial Bank of Commerce	JLN	JP Morgan Chase Bank N.A. London	SOG	Societe Generale Paris
CKL	Citibank N.A. London	JML	JP Morgan Securities Plc	SSB	State Street Bank and Trust Co.
CLY	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	JPM	JP Morgan Chase Bank N.A.	TDM	TD Securities (USA) LLC
CSN	Credit Suisse AG (New York)	JPS	J.P. Morgan Securities LLC	TOR	The Toronto-Dominion Bank
DBL	Deutsche Bank AG London	MAC	Macquarie Bank Limited	UAG	UBS AG Stamford
DEU	Deutsche Bank Securities, Inc.	MBC	HSBC Bank Plc	UBS	UBS Securities LLC
		MEI	Merrill Lynch International		

Währungskürzel:

AED	Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	HKD	Hongkong-Dollar	RON	Rumänischer neuer Leu
ARS	Argentinischer Peso	HUF	Ungarischer Forint	RUB	Russischer Rubel
AUD	Australischer Dollar	IDR	Indonesische Rupie	RSB	Serbischer Dinar
BRL	Brasilianischer Real	ILS	Israelischer Shekel	SEK	Schwedische Krone
CAD	Kanadischer Dollar	INR	Indische Rupie	SGD	Singapur-Dollar
CHF	Schweizer Franken	JPY (or ¥)	Japanischer Yen	THB	Thailändischer Baht
CLP	Chilenescher Peso	KES	Kenia-Schilling	TRY	Türkische neue Lira
CNH	Chinesische Renminbi (Offshore)	KRW	Südkoreanischer Won	TWD	Taiwanesischer Dollar
CNY	Chinesische Renminbi (Mainland)	KZT	Kasachischer Tenge	UAH	Ukrainische Hrywnja
COP	Kolumbianischer Peso	MXN	Mexikanischer Peso	UGX	Uganda-Schilling
CZK	Tschechische Krone	MYR	Malaysischer Ringgit	USD (or \$)	US-Dollar
DKK	Dänische Krone	NGN	Nigerianische Naira	UYU	Uruguayischer Peso
DOP	Dominikanischer Peso	NOK	Norwegische Krone	VND	Vietnamesischer Dong
EGP	Ägyptisches Pfund	NZD	Neuseeländischer Dollar	ZAR	Südafrikanischer Rand
EUR (or €)	Euro	PEN	Peruanischer neuer Sol	ZMW	Sambischer Kwacha
GBP (or £)	Britisches Pfund	PHP	Philippinischer Peso		
GHS	Ghanaischer Cedi	PLN	Polnischer Zloty		

Börsenkürzel:

BIST	Borsa Istanbul Exchange	FTSE	Financial Times Stock Exchange	OTC	Over the Counter
CBOE	Chicago Board Options Exchange	OSE	Osaka Securities Exchange	WIG20	Kapitalisierungsgewichteter Börsenindex der 20 größten an der Warschauer Börse notierten Unternehmen
CBOT	Chicago Board of Trade				

Index-/Spread-Kürzel:

ABX.HE	Asset-Backed Securities Index – Home Equity	CPTFEMU	Eurozone HICP ex-Tobacco Index	NDUEACWF	MSCI ACWI Index Future
AMZX	Alerian MLP Total Return Index	CPURNSA	Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index	OMX	Stockholm 30 Index
BCOMF1T	Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return	DAX	Deutscher Aktien Index 30	PrimeX.ARM	Prime Mortgage-Backed Securities Index – Adjustable Rate Mortgage
BCOMTR	Bloomberg Commodity Index Total Return	DWRTFT	Dow Jones Wilshire REIT Total Return Index	S&P 500	Standard & Poor's 500 Index
BCPMREHO	Barclays Hotel REITs Index	FRCPTXTOB	Französischer Verbraucherpreisindex ohne Tabak	S&P CNX Nifty	Standard & Poor's Nifty 50 Index
BOVESPA	Brazil Bovespa Index	FTSE/JSE	South African Performance Index	SONIO	Sterling Overnight Interbank Average Rate
CAC	Cotation Assistée en Continu	FTSE/MIB	Index der 40 italienischen Aktien mit der höchsten Liquidität/Marktkapitalisierung der Borsa Italiana	SPI 200	Australian Equity Futures Index
CDX.EM	Credit Derivatives Index – Emerging Markets	IBEX 35	Spanish Continuous Exchange Index	SXIE	STOXX Insurance EUR Price
CDX.HY	Credit Derivatives Index – High Yield	IBR	Indicador Bancario de Referencia	TOPIX	Tokyo Price Index
CDX.IG	Credit Derivatives Index – Investment Grade	JMABDEWU	J.P. Morgan Custom Commodity Index	TRNGLU	FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD
CIXBSTR3	Individuell zusammengestellter Rohstoffindex	KOSPI	Korea Composite Stock Price Index	UKRPI	United Kingdom Retail Prices Index
CMBX	Commercial Mortgage-Backed Index	MEXBOL	Mexico Bolsa IPC Index	USSW10	10 Year USSW Rate
CNREPOFIX	China Fixing Repo Rates 7-Day	MTGEFNCL	FNMA 30-Year Coupon Index	VSTOXX	Euro Stoxx 50 Volatility Index
CPALEMU	Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index	NASDAQ	National Association of Securities Dealers Automated Quotations		

Kommunalanleihen- oder Behördenkürzel:

AGM	Assured Guaranty Municipal				
-----	----------------------------	--	--	--	--

Sonstige Kürzel:

ABS	Asset-Backed Security (forderungsbesichertes Wertpapier)	EURIBOR	Euro Interbank Offered Rate	REMIC	Real Estate Mortgage Investment Conduit
ADR	American Depositary Receipt	HIBOR	Hong Kong Interbank Offered Rate	RMBS	Residential Mortgage-Backed Security
ALT	Alternate Loan Trust	JIBAR	Johannesburg Interbank Agreed Rate	SOR	Swap Offer Rate
ATM	At-the-money	JSC	Joint Stock Company	SP - ADR	Sponsored American Depositary Receipt
BABs	Build America Bonds	KLIBOR	Kuala Lumpur Interbank Offered Rate	STIBOR	Stockholm Interbank Offered Rate
BBR	Bank Bill Rate	KORIBOR	Korea Interbank Offered Rate	TBA	To-Be-Announced
BBSW	Bank Bill Swap Reference Rate	LIBOR	London Interbank Offered Rate	TBD	To-Be-Determined
BTP	Buoni del Tesoro Poliennali „Long-term Treasury Bond“	MIBOR	Mumbai Interbank Offered Rate	TBD%	Bei Abrechnung des Darlehens oder zum Zeitpunkt der Finanzierung zu ermittelnder Zinssatz
CBO	Collateralized Bond Obligation	NIBOR	Norwegian Interbank Offered Rate	TELBOR	Tel Aviv Inter-Bank Offered Rate
CDI	Brazil Interbank Deposit Rate	OAT	Obligations Assimilables du Trésor	THBFIX	Thai Baht Floating-Rate Fix
CDO	Collateralized Debt Obligation (besicherte Schuldverschreibungen)	OIS	Overnight Index Swap	TIIE	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio „Gleichgewichtszinssatz im Interbankengeschäft“
CHILIBOR	Chile Interbank Offered Rate	PIK	Payment-in-Kind (Sachausschüttung)	USSW	USD Swap Spread (halbjährlicher Festzins vs. 3-Month LIBOR)
CLO	Collateralized Loan Obligation (durch Kreditportfolio besicherte Wertpapiere)	PRIBOR	Prague Interbank Offered Rate		
CMBS	Collateralized Mortgage-Backed Security	REIT	Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds)		
DAC	Designated Activity Company			WIBOR	Warsaw Interbank Offered Rate

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited,
(bis 30. Juni 2021)
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irland.

(mit Wirkung zum 1. Juli 2021)

Third Floor,
Harcourt Building,
Harcourt Street,
Dublin,
D02 F721,
Irland.

ANLAGEBERATUNGSGESELLSCHAFT

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

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

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapur 018960.

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.

VERTRIEBSSTELLEN

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

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

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapur 018960.

PIMCO Asia Limited,
Suite 2201, 22nd Floor,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street,
Central Hong Kong.

PIMCO Australia Pty Ltd.,
Level 19, 5 Martin Place,
363 George Street,
Sydney, New South Wales 2000,
Australien.

ÖSTERREICHISCHE ZAHLSTELLE

UniCredit Bank Austria AG,
AMG/9991,
Am Hof 2,
1010 Wien,
Österreich.

REPRÄSENTANT IN SINGAPUR

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapur 018960.

ITALIENISCHE KORRESPONDENZBANKEN

State Street Bank S.p.A.,
Via Ferrante Aporti, 10,
20125 Mailand,
Italien.

Allianz Bank Financial Advisors S.p.A.,
Piazzale Lodi, 3
20137 Mailand,
Italien.

BNP Paribas Securities Services,
Piazza Lina Bo Bardi 3,
20124 Mailand,
Italien.

Société Générale Securities Services
S.p.A. („SGSS“)
Via Benigno Crespi, 19/A - MAC 2,
20159 Mailand,
Italien.

Allfunds Bank S.A.,
Via Santa Margherita 7,
20121 Mailand,
Italien.

Banca Sella Holding S.p.A.,
Piazza Gaudenzio Sella, 1,
13900 Biella,
Italien.

Banca Monte dei Paschi di Siena,
Piazza Salimbeni 3,
53100 Siena,
Italien.

REPRÄSENTANT IN HONGKONG

PIMCO Asia Limited,
Suite 2201, 22nd Floor,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street,
Central Hong Kong.

LUXEMBURGER ZAHLSTELLE UND VERTRETUNGSSTELLE

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

SCHWEIZER ZAHLSTELLE UND REPRÄSENTANZ

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

BRITISCHER REPRÄSENTANT

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

BELGISCHE ZAHLSTELLE

Société Générale Private Banking NV,
Kortrijksesteenweg 302,
B-9000 Gent,
Belgien.

DEUTSCHE ZAHL- UND INFORMATIONSTELLE

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

PORTUGIESISCHE ZAHLSTELLE

Banco Activobank (Portugal) S.A.,
Rua Augusta 86,
1149-023, Lissabon,
Portugal.

SCHWEDISCHE ZAHLSTELLE

SEB Merchant Banking,
SE-106 40,
Stockholm,
Schweden.

GRIECHISCHE ZAHLSTELLE

Eurobank Ergasias S.A.,
22, Voukourestriou & 3, Valaoritou str.
GR 10671 Athen,
Griechenland.

UNGARISCHE ZAHLSTELLE

European Investment Centre,
Tomasikova 64,
831 04 Bratislava,
Slowakische Republik.

ZAHLSTELLE IN DER TSCHECHISCHEN REPUBLIK

European Investment Centre,
Veveří 2581/102,
616 00 Brno,
Tschechische Republik.

FRANZÖSISCHE ZENTRALISIERUNGS- UND FINANZSTELLE

Société Générale Securities Services,
3, Rue d'Antin,
75002 Paris,
Frankreich.

ZAHLSTELLE IN LIECHTENSTEIN

LGT Bank Ltd.,
Herrengasse 12,
FL-9490 Vaduz,
Liechtenstein.

RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT

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

RECHTSBERATER FÜR US-RECHT

Dechert LLP,
1900 K Street N.W.,
Washington, D.C. 20006,
USA.

UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER

PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants und Statutory
Audit Firm,
One Spencer Dock,
North Wall Quay,
Dublin 1, D01 X9R7,
Irland.

SEKRETÄR

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

BETREUENDER MAKLER

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

EINGETRAGENER GESCHÄFTSSITZ

PIMCO Funds: Global Investors
Series plc,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2, D02 HD32,
Irland.

VERWALTUNGSRAT DER GESELLSCHAFT UND VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

V. Mangala Ananthanarayanan¹ (Indien)
Ryan P. Blute¹ (USA)
John Bruton (unabhängiges
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)
Craig A. Dawson¹ (USA)
David M. Kennedy (unabhängiges
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)
Frances Ruane (unabhängiges
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)

Der Prospekt, Prospektergänzungen, die Gründungsurkunde und Satzung, die wesentlichen Anlegerinformationen sowie Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos beim Repräsentanten oder Agenten eines jeden Rechtsraums bezogen werden.

Eine Kopie der Liste der Portfolioveränderungen in dem am 30. Juni 2021 abgelaufenen Berichtszeitraum kann von den Anteilhabern kostenlos bei der Verwahrstelle oder den Zahlstellen sowie bei der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland und der Vertretungsstelle in der Schweiz bezogen werden.

¹ Mitarbeiter von PIMCO.

PIMCO Europe Ltd (Registernummer 2604517) wurde von der Financial Conduct Authority (12 Endeavour Square, London, E20 1JN) in Großbritannien zugelassen und wird von ihr reguliert. Die von PIMCO Europe GmbH 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), PIMCO Europe GmbH Italian Branch (Registernummer 10005170963), PIMCO Europe GmbH Irish Branch (Registernummer 909462), PIMCO Europe GmbH UK Branch (Registernummer BR022803) und PIMCO Europe GmbH Spanish Branch (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 § 32 des Gesetzes über das Kreditwesen (KWG) reguliert. Des Weiteren sind die o. g. Niederlassung in Italien, Irland, dem Vereinigten Königreich und Spanien zusätzlich von den folgenden Behörden zugelassen: (1) Italienische Niederlassung: Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) gemäß Artikel 27 des italienischen Testo Unico della Finanza; (2) Irische Niederlassung: Central Bank of Ireland gemäß Regulation 43 der 2017 erlassenen Umsetzung der europäischen Richtlinie (Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente) in der jeweils gültigen Fassung; (3) Niederlassung im Vereinigten Königreich: Financial Conduct Authority; (4) Spanische Niederlassung: Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) gemäß den Verpflichtungen nach Artikel 168 und 203 bis 224 sowie den Verpflichtungen in Title V, Abschnitt I des spanischen Ley del Mercado de Valores (LMV) sowie Artikel 111, 114 und 117 des Real Decreto-ley 217/2008. Die von PIMCO Europe GmbH erbrachten Dienstleistungen stehen nur professionellen Kunden im Sinne von § 67, Abs. 2 des deutschen Wertpapierhandelsgesetzes (WpHG) zur Verfügung. Sie sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten.

PIMCO (Schweiz) GmbH (zugelassen 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.