



PIMCO

PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

# Jahresbericht

31. Dezember 2020



## ALLGEMEINE KENNDATEN

### Fondstyp:

OGAW

### Anzahl an Fonds der Gesellschaft:

51 Fonds

### Zum 31. Dezember 2020 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)  
 Institutional USD (Unhedged)  
 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)  
 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 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 (Hedged)  
 M Retail  
 M Retail AUD (Hedged)  
 M Retail HKD (Unhedged)  
 M Retail SGD (Hedged)  
 M Retail USD (Hedged)  
 N Retail  
 R Class  
 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 SEK (Hedged)  
 W Class SGD (Hedged)  
 W Class USD (Currency Exposure)  
 Z Class  
 Z Class AUD (Hedged)  
 Z Class EUR (Hedged)  
 Z Class EUR (Unhedged)  
 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 215.950.477

### Mindestbestand:

Der Mindestbestand für die Anteilsklassen Institutional, Investor, Administrative, H Institutional und W liegt bei 500.000 USD oder dem gleichen 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 Mindestanfangszeichnung und des Mindestbestandes gemäß dem aktuellen Verkaufsprospekt zu verzichten.

### Handelstag:

Für einen Fonds bezeichnet er den Tag oder die Tage, die die jeweilige Ergänzung zu diesem Fonds 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 Anteilinhabern des/der betroffenen Fonds im Voraus mitgeteilt.

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

### Funktionswährung der Fonds:

USD (\$), mit Ausnahme der Fonds UK Corporate Bond Fund und UK Long Term Corporate Bond Fund, die auf Pfund Sterling (£) lauten, sowie der Fonds 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.

\* Eine vollständige Liste aller während des aktuellen und vorangegangenen Berichtszeitraums ausgegebenen Anteilsklassen ist Erläuterung 19 zu entnehmen. Eine Liste aller für die einzelnen Fonds angebotenen Anteilsklassen ist dem Verkaufsprospekt zu entnehmen.

ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

**Zulassung in Hongkong:**

Die Gesellschaft und bestimmte ihrer Fonds 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 können die folgenden Fonds Finanzderivate zu Anlagezwecken, zur Absicherung und/oder zur effizienten Portfolioverwaltung erwerben. Der Einsatz von Finanzderivaten erfolgt vorbehaltlich der voraussichtlichen Höchstgrenzen im überarbeiteten Code, wie nachstehend aufgeführt. Die Einstufung der Fonds entweder als Derivatfonds oder als Nicht-Derivatfonds ist ebenfalls nachstehend angegeben. Es gibt keine Änderungen bezüglich des Einsatzes von Finanzderivaten durch die folgenden Fonds:

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

Die folgenden Fonds sind in Hongkong nicht zugelassen und für Einwohner von Hongkong nicht erhältlich:

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  
 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 Fonds werden von der Monetary Authority of Singapore gemäß dem Securities and Futures Act, Chapter 289 von Singapur, nicht anerkannt und stehen Privatanlegern in Singapur nicht zur Verfügung:

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:**  
 PAFPLC

™ Eingetragenes Warenzeichen oder Warenzeichen der Pacific Investment Management Company LLC in den USA und/oder sonstigen Ländern.

## Inhaltsverzeichnis

	Seite
Schreiben des Vorsitzenden	4
Wichtige Angaben zu den Fonds	5
Beschreibungen der Vergleichsindizes	63
Finanzstatus	68
Betriebsergebnisrechnung	90
Ausweis der Nettovermögensänderungen	112
Aufstellung der Wertpapieranlagen	118
Erläuterungen zum Abschluss	718
Bericht des Verwaltungsrats	848
Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers	851
Bericht der Verwahrstelle	855
Angaben zur Vergütung (ungeprüft)	856
Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung (ungeprüft)	857
Shareholder Rights Directive II (Ungeprüft)	908
Glossar (ungeprüft)	909
Allgemeine Informationen (ungeprüft)	910

FONDS	Fonds- überblick*	Aufstellung der Wertpapier- anlagen
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	6	118
Asia Strategic Interest Bond Fund	7	127
PIMCO Capital Securities Fund	8	134
PIMCO Climate Bond Fund	10	143
Commodity Real Return Fund	11	147
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	12	157
Diversified Income Fund	13	168
Diversified Income Duration Hedged Fund	15	190
Dynamic Bond Fund	16	205
Dynamic Multi-Asset Fund	17	219
Emerging Local Bond Fund	18	229
Emerging Markets Bond Fund	19	248
Emerging Markets Bond ESG Fund	20	262
Emerging Markets Corporate Bond Fund	21	273
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	22	280
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	23	292
Euro Bond Fund	24	302
Euro Credit Fund	25	312
Euro Income Bond Fund	26	320
Euro Long Average Duration Fund	27	331
Euro Short-Term Fund	28	337
PIMCO European High Yield Bond Fund	29	343
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	30	347
Global Advantage Fund	31	353
Global Bond Fund	32	371
Global Bond ESG Fund	34	398
Global Bond Ex-US Fund	35	413
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	36	431
Global High Yield Bond Fund	37	442
Global Investment Grade Credit Fund	38	453
Global Investment Grade Credit ESG Fund	41	483
Global Libor Plus Bond Fund	42	495
Global Low Duration Real Return Fund	43	507
Global Real Return Fund	44	516
Income Fund	45	526
Inflation Strategy Fund	47	563
Low Average Duration Fund	48	573
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	49	580

FONDS	Fonds- überblick*	Aufstellung der Wertpapieran- lagen
Low Duration Income Fund	50	590
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	51	602
Mortgage Opportunities Fund	52	606
StocksPLUS™ Fund	53	616
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	54	624
Strategic Income Fund	55	628
Total Return Bond Fund	56	644
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	57	656
UK Corporate Bond Fund	58	666
UK Long Term Corporate Bond Fund	59	675
US High Yield Bond Fund	60	683
US Investment Grade Corporate Bond Fund	61	693
US Short-Term Fund	62	709

Dieser Jahresbericht und der geprüfte Abschluss (der „Jahresbericht“) können in andere Sprachen übersetzt werden. Eine solche Übersetzung darf nur dieselben Informationen wie der englischsprachige Jahresbericht enthalten und muss dieselbe Bedeutung haben. Soweit zwischen dem englischsprachigen Jahresbericht und dem Jahresbericht in einer anderen Sprache Widersprüche bestehen, hat der englischsprachige Jahresbericht Vorrang, es sei denn, es ist in irgendeinem Rechtsgebiet, in dem die Anteile verkauft werden, gesetzlich vorgeschrieben, dass bei einer Klage, die auf Angaben in einem Jahresbericht in einer anderen Sprache als Englisch beruht, die Sprache des Jahresberichts, auf der diese Klage beruht, maßgeblich ist. Etwaige Streitigkeiten bezüglich der Bedingungen des Jahresberichts unterliegen unabhängig von der Sprache des Jahresberichts den Gesetzen Irlands und werden in Übereinstimmung mit diesen ausgelegt.

\* Dieses Dokument enthält die Meinungen der Verwaltungsgesellschaft, 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 31. Dezember 2020 abgeschlossenen zwölfmonatigen Berichtszeitraum umfasst. Auf den nachfolgenden Seiten finden Sie nähere Einzelheiten zu den Anlageergebnissen sowie eine Erörterung der Faktoren, die während des Berichtszeitraums den stärksten Einfluss auf die Wertentwicklung hatten.

### Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2020

Die Weltwirtschaft wurde durch die Auswirkungen der COVID-19-Pandemie stark beeinträchtigt. In seinem im Oktober 2020 veröffentlichten World Economic Outlook Update erklärte der Internationale Währungsfonds („IWF“), er rechne damit, dass das US-BIP 2020 um -4,3 % schrumpfen werde, verglichen mit einem BIP-Wachstum von 2,2 % im Jahr 2019. In der Eurozone, dem Vereinigten Königreich und Japan schätzte der IWF das BIP-Wachstum im Jahr 2020 derweil auf jeweils -8,3 % bzw. -9,8 % bzw. -5,3 %. Zum Vergleich: 2019 verzeichneten diese Länder jeweils ein BIP-Wachstum von 1,3 % bzw. 1,5 % bzw. 0,7 %.

Vor diesem Hintergrund ergriffen Zentralbanken und Regierungen weltweit eine Reihe aggressiver Maßnahmen. In Europa stellte die Europäische Zentralbank („EZB“) im März 2020 ein neues Anleihekaufprogramm mit einem Umfang von 750 Mrd. EUR vor, das im Juni 2020 um weitere 600 Mrd. EUR erweitert wurde. Im Juli verabschiedete die Europäische Union ein Ausgabenpaket in Höhe von 1,8 Bio. EUR zur Stützung ihrer Wirtschaft. Im Dezember 2020 erweiterte die EZB ihr geldpolitisches Anreizprogramm um weitere 500 Mrd. EUR. Die Bank of England senkte im März ihren Leitzins auf 0,10 % - ein Rekordtief -, erweiterte im Juni ihr Programm zur quantitativen Lockerung um 100 Mrd. GBP und erhöhte im November ihr Anleihekaufprogramm um 150 Mrd. GBP auf 895 Mrd. GBP. Gegen Ende des Jahres einigten sich das Vereinigte Königreich und die Europäische Union auf ein lang erwartetes Brexit-Abkommen. Unterdessen beließ die Bank of Japan ihren kurzfristigen Zinssatz unverändert bei -0,10 %. Gleichzeitig erhöhte sie das Ziel für ihre Bestände an Unternehmensanleihen von 3,2 Bio. JPY auf 4,2 Bio. JPY. Im Mai 2020 verdoppelte die japanische Regierung ihre Konjunkturmaßnahmen mit einem Paket im Wert von 117 Bio. JPY. Im Dezember 2020 schließlich kündigte die Bank of Japan ein neues Konjunkturpaket in Höhe von 73,6 Bio. JPY an.

Die US-Notenbank (die „Fed“) ergriff beispiellose Maßnahmen, um die Wirtschaft zu stützen und eine ordnungsgemäße Funktionsweise der Märkte zu gewährleisten. Anfang März 2020 senkte die Fed ihre Leitzinsen auf eine Spanne zwischen 1,00 % und 1,25 %. Im weiteren Verlauf des Monats senkte sie ihre Zinsen dann weiter auf einen Bereich zwischen 0,00 % bis 0,25 %. Am 23. März verkündete die Fed, dass sie Staatsanleihen und Hypothekentitel in unbegrenzter Höhe erwerben sowie erstmals Unternehmensanleihen am offenen Markt kaufen würde. Im August 2020 erklärte der Fed-Vorsitzende Jerome Powell, dass die Zentralbank ihre Sichtweise in Bezug auf den Zielkonflikt zwischen niedrigerer Arbeitslosigkeit und höherer Inflation geändert habe. Laut Powells Aussage wird der neue Ansatz der Fed bei der Festlegung der US-Geldpolitik auch beinhalten, einen Anstieg der Inflation in Kauf zu nehmen, was bedeuten könnte, dass die Zinsen für einen längeren Zeitraum niedrig bleiben. Im März 2020 verabschiedete die US-Regierung Konjunkturmaßnahmen in Höhe von etwa 2,8 Bio. USD, um die Wirtschaft zu unterstützen. Ein weiteres Konjunkturpaket in Höhe von 900 Mrd. USD wurde im Dezember 2020 verabschiedet.

Die Renditen auf sowohl kurz- als auch langfristige US-Staatsanleihen sanken stark. Unserer Einschätzung nach war dies auf verschiedene Faktoren zurückzuführen, unter anderem das stark schrumpfende globale Wachstum, die lockere Geldpolitik der US-Notenbank und Phasen erhöhter Risikoscheu unter den Anlegern. Die Rendite auf die als Benchmark angesetzten 10-jährigen US-Staatsanleihen lag zum Ende des Berichtszeitraums bei 0,93 %, nachdem sie zum 31. Dezember 2019 noch 1,92 % 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 5,12 %. Der Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged), ein weitläufig verwendeter Index für globale Anleihen mit Investment Grade-Rating, rentierte derweil mit 7,78 %. Mit höherem Risiko behaftete festverzinsliche Anlageklassen wie etwa hochverzinsliche Unternehmensanleihen und Schuldtitel aus Schwellenländern legten ebenfalls deutlich zu. Der ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged), ein weitläufig verwendeter Index für Anleihen unterhalb von Investment Grade, verzeichnete eine Rendite von 5,68 %, während Auslandsschulden von Schwellenländern, die vom JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (USD Hedged) abgebildet werden, mit 5,88 % rentierten. Auf Landeswährungen lautende Schwellenmarktanleihen, die vom JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) abgebildet werden, rentierten mit 2,69 %.

Trotz der Belastung durch die Pandemie erzielten die globalen Aktien im Allgemeinen gute Ergebnisse. Alles in allem erzielten die vom S&P 500 Index abgebildeten US-Aktien eine Rendite von 18,40 %, teilweise beflügelt durch einen deutlichen Anstieg im November und Dezember 2020, der unserer Ansicht nach auf eine Verbesserung der Anlegerstimmung nach positiven Nachrichten zu COVID-19-Impfstoffen zurückzuführen war. Die im MSCI World Index vertretenen globalen Aktien brachten eine Rendite von 15,90 %, während die im MSCI Emerging Markets Index vertretenen Schwellenmarktaktien mit 18,31 % rentierten. Die am Nikkei 225 Index gemessenen japanischen Aktien verbuchten in JPY eine Rendite von 18,24 %. Dagegen lieferten die am MSCI Europe Index gemessenen europäischen Aktien in EUR eine Rendite von -3,32 %.

Die Rohstoffpreise waren volatil und erbrachten gemischte Ergebnisse. Zu Beginn des Berichtszeitraums notierte Rohöl der Sorte Brent noch bei etwa 67 USD je Barrel. Nach dem Ausbruch der Pandemie wurde Rohöl der Sorte Brent bei unter 20 USD je Barrel gehandelt. Am Ende des Berichtszeitraums lag der Preis bei etwa 52 USD je Barrel. Wir glauben, dass der Rückgang der Ölpreise auf den Einbruch der Nachfrage aufgrund der Pandemie zurückzuführen ist. Im Gegensatz dazu tendierten die Gold- und Kupferpreise aufwärts.

An den Devisenmärkten schließlich wurden auch Phasen erhöhter Volatilität verzeichnet, was unserer Einschätzung nach auf das schwankende Wirtschaftswachstum, Handelskonflikte und eine veränderte geldpolitische Ausrichtung der Zentralbanken sowie die Wahlen in den USA und verschiedene geopolitische Ereignisse zurückzuführen war. Der US-Dollar gab gegenüber einer Reihe anderer Hauptwährungen nach. Beispielsweise verbuchte der US-Dollar gegenüber dem Euro, dem britischen Pfund und dem japanischen Yen eine Rendite von jeweils -8,94 % bzw. -3,12 % und -5,19 %.

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 Fonds

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 Fonds 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 Fonds gehaltenen Rentenpapiere voraussichtlich an Wert verlieren. Die Kursschwankungsintensität von Rentenpapieren kann in Zeiten steigender Zinsen ebenfalls zunehmen und dadurch zu erhöhten Verlusten für die Fonds 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 Fonds 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 Fonds 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, die mit einem bestimmten Sektor einhergehenden Anlagerisiken und die Risiken in Verbindung mit einer Epidemie/Pandemie. Die Fonds 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 Fonds eine Position nicht dann glattstellen kann, wenn es für ihn am vorteilhaftesten wäre. Fonds, 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 Fonds mit einem zusätzlichen Risiko und einer zusätzlichen Volatilität einhergehen.

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

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

Die Teilfonds können in bestimmte Instrumente investieren, die sich in bestimmter Weise auf den London Interbank Offered Rate („LIBOR“) stützen. 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 endgültig auslaufen zu lassen. Es besteht weiterhin Ungewissheit hinsichtlich der zukünftigen Nutzung des LIBOR und des Charakters eines etwaigen Ersatzzinssatzes (z. B. des besicherten Tagesgeldsatzes (Secured Overnight Financing Rate), der den USD-LIBOR ersetzen soll und die Kosten von Übernachtskrediten in der Form von mit US-Schatzpapieren besicherten Pensionsgeschäften misst.). Die möglichen Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR auf einen Fonds oder auf bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investiert, lassen sich gegebenenfalls nur mit Schwierigkeiten ermitteln, und sie können in Abhängigkeit von verschiedenen Faktoren unterschiedlich ausfallen. Der Übergang kann außerdem zu einer Verringerung des Werts bestimmter von einem Fonds gehaltener Instrumente oder zu einer Verringerung der Wirksamkeit damit verbundener Fondstransaktionen wie z. B. Absicherungen führen. Derartige Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR sowie andere unvorhergesehene Auswirkungen könnten dazu führen, dass ein Fonds Verluste erleidet.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit bietet keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Überblicksseiten der einzelnen Fonds in diesem Bericht bieten eine Übersicht über den Gesamtertrag der Anlageentwicklung, in der die Wertentwicklung – davon ausgehend, dass alle Dividenden und Kapitalgewinnausschüttungen wiederangelegt wurden – gemessen wird. Anlageerträge und der Kapitalwert schwanken, sodass der Wert der Fonds-Anteile bei Rücknahme über oder unter ihrem ursprünglichen Wert liegen kann. In den Erträgen ist der Abzug von Steuern, die ein Anteilinhaber auf (i) Ausschüttungen des Fonds oder (ii) die Rückgabe von Investmentanteilen des Fonds zu zahlen hat, nicht berücksichtigt. Die aktuelle Wertentwicklung kann geringer oder höher ausfallen als die angeführten Wertentwicklungsdaten. Sämtliche Fondserträge verstehen sich nach Gebühren und Aufwendungen.

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

Die frühere Wertentwicklung stellt keinen Indikator für die laufende und zukünftige Wertentwicklung dar. Die Daten zur Wertentwicklung lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

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](http://www.pimco.com).

# PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	5,20 %	7,93 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	5,20 %	7,96 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020)	—	3,83 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	4,67 %	7,43 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 01. Jul. 2020)	—	7,90 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	4,25 %	6,99 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	4,23 %	6,98 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	5,89 %	8,68 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade	4,94 %	7,00 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2020)	—	4,61 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (AUD Hedged)	—	3,63 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Okt. 2020)	—	4,20 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 23. Okt. 2020)	—	4,20 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 23. Okt. 2020)	—	4,10 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 23. Okt. 2020)	—	4,13 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (CHF Hedged)	—	3,71 %
<b>Auf CNH lautende Klassen</b>		
Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	—	4,73 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (CNH Hedged)	—	3,92 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 25. Sep. 2020)	—	4,70 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 25. Sep. 2020)	—	4,65 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 10. Sep. 2020)	—	2,70 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 25. Sep. 2020)	—	4,50 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 25. Sep. 2020)	—	4,41 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (EUR Hedged)	—	1,84 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	3,84 %	6,33 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	3,80 %	6,31 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (HKD Unhedged)	4,43 %	6,32 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 20. Aug. 2020)	—	3,83 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	3,65 %	6,39 %
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	3,70 %	6,42 %
JP Morgan JACI Non-Investment Grade (SGD Hedged)	4,29 %	6,36 % <sup>2</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund strebt eine maximale Gesamterträge 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 Fonds 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:

- » Die Positionen im chinesischen Immobiliensektor trugen aufgrund der Titelauswahl zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Die Positionen im Spielektor in Macau trugen aufgrund der Titelauswahl zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Das Engagement in staatlichen und quasi-staatlichen Anleihen in Indonesien trug aufgrund der Titelauswahl zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Das übergewichtete Engagement im indischen Transportsektor war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich der Sektor schlechter entwickelte als der breiter gefasste Index.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der Hongkong-Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen nachgaben.

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

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

# Asia Strategic Interest Bond Fund

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, ausschüttend (Auflegung 04. Sep. 2020)	—	2,19 %
Class E, thesaurierend (Auflegung 04. Sep. 2020)	—	1,90 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2010)	7,00 %	4,37 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung 01. Dez. 2020)	—	0,90 %
JPMorgan Asia Credit Index <sup>3</sup>	6,33 %	4,96 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2011)	(1,82 %)	4,03 %
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Unhedged) <sup>3</sup>	(2,45 %)	5,21 %
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 04. Sep. 2020)	—	1,92 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2011)	6,49 %	2,68 %
JPMorgan Asia Credit Index (HKD Unhedged) <sup>3</sup>	5,85 %	3,63 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	—	3,00 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	—	2,81 %
JPMorgan Asia Credit Index (SGD Hedged) <sup>3</sup>	—	1,55 %

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

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

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Asia Strategic Interest Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 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 dem 01. Juni 2016: JPMorgan Asia Credit Index.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Asia Strategic Interest Bond Fund (ehemals Emerging Asia Bond Fund) strebt die Erwirtschaftung attraktiver und stabiler Erträge an. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Fonds kann bis zu 50 % of seines Gesamtvermögens in hoch verzinsliche Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) investieren. Der Fonds konzentriert seine Anlagen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) in Asien, ausgenommen Japan, anlegt. Er kann jedoch bis zu ein Drittel seines Gesamtvermögens in andere Renteninstrumente (wie im Verkaufsprospekt definiert) investieren, darunter auch Papiere von staatlichen Emittenten und Unternehmen außerhalb Asiens, ausgenommen Japan.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Das Engagement in staatlichen und quasi-staatlichen Anleihen aus China, Indonesien und Indien trug aufgrund des hohen positiven Carry zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Die Positionen im chinesischen Immobilien-, Internet- und Technologiesektor trugen aufgrund der Titelauswahl zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Es gab keine nennenswerten Verlustbringer für die absolute Wertentwicklung.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	6,32 %	7,08 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2014)	6,28 %	6,24 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2014)	5,88 %	5,66 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	5,91 %	5,67 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	5,76 %	6,45 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	5,76 %	6,44 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	5,35 %	5,78 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	5,41 %	5,12 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	5,31 %	5,52 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	6,11 %	6,01 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	4,90 %	5,32 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2013)	7,15 %	7,52 %
3 Month USD LIBOR Index	0,98 %	1,10 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	3,63 %	5,83 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Aug. 2015)	4,75 %	7,01 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	0,37 %	1,57 % <sup>2</sup>
<b>Auf BRL lautende Klassen</b>		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jan. 2018)	(17,43 %)	(7,34 %)
ICE BofAML 3 Month USD LIBOR Index Hedged BRL Denominated in USD	(20,30 %)	(10,41 %)
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	4,70 %	6,99 %
3 Month USD LIBOR (CAD Hedged) Index	0,96 %	1,43 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	3,83 %	4,85 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Jun. 2014)	2,96 %	2,58 %
3 Month USD LIBOR (in CHF besichert)	(0,82 %)	(0,87 %) <sup>2</sup>
<b>Auf CNH lautende Klassen</b>		
Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	7,30 %	9,02 %
3 Month USD LIBOR (CNH Hedged) Index	2,87 %	3,01 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	4,07 %	5,28 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	4,07 %	5,28 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	4,02 %	4,13 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2016)	3,69 %	5,88 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	3,59 %	4,75 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	3,10 %	4,05 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	3,11 %	3,45 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	3,92 %	3,80 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	2,71 %	3,14 %
3 Month Euribor	(0,41 %)	(0,18 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	4,01 %	5,94 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	4,08 %	6,04 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	—	2,25 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	3,88 %	4,48 %
3 Month GBP LIBOR Index	0,34 %	0,55 % <sup>2</sup>

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Capital Securities Fund strebt Engagements mit Fokus auf Capital Securities (wie im Verkaufsprospekt definiert) zusammen mit einer maximalen Gesamterträge 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 Fonds 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:

- » Ein Engagement in zusätzlichen Tier-1-Anleihen trug zur Wertentwicklung bei, da während des Jahres positive Überschussrenditen zu verzeichnen waren.
- » Ein Engagement in erstrangigen Bankanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da während des Jahres positive Überschussrenditen zu verzeichnen waren.
- » Ein Engagement in Tier 2-Anleihen trug zur Wertentwicklung bei, da während des Jahres positive Überschussrenditen zu verzeichnen waren.
- » Ein taktisches Engagement in europäischen Bankaktien belastete die Wertentwicklung, da die Anlageklasse abverkauft wurde.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	4,79 %	5,14 %
3 Month HIBOR Index	1,45 %	1,68 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	5,08 %	6,41 %
M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 23. Dez. 2013)	4,41 %	5,31 %
3 Month SGD LIBOR Index	0,62 %	1,11 % <sup>2</sup>

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

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

# PIMCO Climate Bond Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2020)	—	1,70 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2020)	—	1,80 %
Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index (USD Hedged)	—	1,48 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 13. Nov. 2020)	—	0,60 %
Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index (CHF Hedged)	—	0,54 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	—	1,40 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Dez. 2020)	—	0,50 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sept. 2020)	—	1,10 %
Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index (EUR Hedged)	—	1,20 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	—	1,50 %
Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index (GBP Hedged)	—	1,35 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Climate Bond Fund strebt optimale risikobereinigte Renditen bei umsichtiger Vermögensverwaltung an und berücksichtigt dabei langfristige klimabezogene Risiken und Chancen. 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.

Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 23. September 2020 auf.

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl bei Investment-Grade-Schuldtiteln, insbesondere von Banken und REITs (Real Estate Investment Trusts), trug zur Wertentwicklung bei.
- » Ein Long-Engagement in hochverzinslichen Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein Long-Engagement in der US-Duration, insbesondere am Bauch der Kurve, schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.

# Commodity Real Return Fund

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2006)	2,16 %	(2,85 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	1,95 %	(5,74 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	1,32 %	(4,39 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return	(3,12 %)	(4,39 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2010)	(0,30 %)	(3,82 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	(1,15 %)	(7,21 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Hedged)	(5,54 %)	(5,84 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2017)	(0,54 %)	(2,18 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Hedged)	(4,89 %)	(3,55 %)

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der 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 in 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:

- » Die strukturelle Allokation auf globale kurzfristige US Treasury Inflation-Protected Securities (TIPS) als Sicherheiten zur Deckung des Rohstoffengagements des Fonds 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.
- » Ein Engagement in breiten Rohstoffkategorien belastete die absolute Wertentwicklung, da breite Rohstoffkategorien, gemessen am Bloomberg Commodity Index Total Return (BCOM), Verluste verbuchten.
- » Ein übergewichtetes Engagement in der US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die US-Zinsen zurückgingen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in britischen Breakeven-Inflationsspreads (BEI) trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die britischen BEI-Spreads nachgaben.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Erdgassektor trug zur relativen Wertentwicklung bei, da Erdgas, gemessen am Bloomberg Natural Gas Subindex (BCOMNG), gegenüber den im Bloomberg Commodity Index (BCOM) vertretenen breiteren Rohstoffen eine Underperformance aufwies.
- » Eine Übergewichtung von Schwellenmarktwährungen belastete die relative Wertentwicklung, da Schwellenmarktwährungen während des Berichtszeitraums abgewertet wurden.

# PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	3,27 %	3,65 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	2,27 %	1,96 %
3 Month USD LIBOR Index	0,98 %	0,96 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2012)	1,40 %	1,08 %
3 Month USD LIBOR (in CHF besichert)	(0,82 %)	(0,81 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	1,72 %	2,40 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	0,77 %	0,59 %
3 Month Euribor	(0,41 %)	(0,01 %) <sup>2</sup>

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche langfristige Rendite erzielen. Der Fonds 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:

- » Ein über einen Total Return Swap eingerichtetes Short-Engagement im US-Hochzinsmarkt trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Kreditspreads weiteten.
- » Makrostrategien und insbesondere ein Engagement in der US-Duration trugen zur Wertentwicklung bei, da die Renditen während des Berichtszeitraums zurückgingen.
- » Die Titelauswahl im Dienstleistungssektor, da eine ausgewählte Anleihe während des Berichtszeitraums eine Outperformance aufwies.
- » Die Titelauswahl bei den REITs, da ausgewählte Anleihen im ersten und zweiten Quartal eine Underperformance aufwiesen.
- » Ein Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern belastete die Wertentwicklung, da der Sektor während des Berichtszeitraums negative Überschussrenditen verzeichnete.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	7,86 %	6,90 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Sep. 2008)	7,83 %	7,36 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	7,49 %	4,83 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	7,53 %	4,83 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	7,34 %	5,62 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	6,89 %	6,02 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	6,87 %	6,10 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2011)	7,69 %	5,92 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Mai 2020)	—	12,43 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	6,90 %	5,38 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	6,95 %	5,24 %
N Retail, ausschüttend II (Auflegung: 30. Okt. 2020)	—	4,80 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	6,51 %	4,85 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	6,43 %	4,84 %
Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	—	4,00 %
Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	—	4,03 %
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 <sup>3</sup>	6,60 %	6,39 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mai 2019)	5,64 %	7,14 %
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung: 19. Dez. 2012)	5,21 %	5,15 %
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 <sup>3</sup>	4,94 %	5,63 % <sup>2</sup>
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2019)	7,03 %	8,91 %
Class W CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	—	3,90 %
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 <sup>3</sup>	5,45 %	7,59 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	5,50 %	4,32 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	5,53 %	3,71 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Sept. 2019)	4,56 %	4,19 %
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	—	3,40 %
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	—	3,52 %
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 <sup>3</sup>	4,68 %	4,04 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2007)	5,76 %	5,90 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Okt. 2007)	5,80 %	6,02 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2007)	5,37 %	5,77 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	5,36 %	3,44 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jul. 2007)	5,18 %	5,62 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jul. 2007)	4,79 %	5,22 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2009)	4,82 %	4,91 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	4,39 %	2,82 %

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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 untergewichtetes Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads während des Berichtszeitraums weiteten.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Investment-Grade- und Hochzins-Bereich bei Banken, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Hochzinsanleihen aus dem Industriesektor, die sich während des Berichtszeitraums unterdurchschnittlich entwickelten, trug zur Wertentwicklung bei.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der USD-Duration war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen während des Berichtszeitraums sanken.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Hochzinsanleihen aus dem Telekommunikationssektor belastete die Wertentwicklung, da der Sektor während des Berichtszeitraums eine Outperformance aufwies.

## Diversified Income Fund (Forts.)

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	4,39 %	2,82 %
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	3,50 %
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	3,51 %
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 <sup>3</sup>	4,92 %	5,16 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2006)	5,99 %	6,73 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2006)	6,06 %	6,63 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	5,53 %	4,93 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	3,80 %
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	3,83 %
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 <sup>3</sup>	5,35 %	5,98 % <sup>2</sup>
<b>Auf MXN lautende Klassen</b>		
Institutional MXN (Hedged), thesaurierend (Auflegung 09. Dez. 2020)	—	1,12 %
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 <sup>3</sup>	—	1,09 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	5,68 %	6,15 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Dez. 2020)	—	0,07 %
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 <sup>3</sup>	4,90 %	5,43 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	7,06 %	7,63 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mai 2019)	6,52 %	7,66 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Okt. 2019)	6,21 %	5,99 %
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	4,13 %
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 <sup>3</sup>	6,00 %	7,33 % <sup>2</sup>

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

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

<sup>3</sup> 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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2011)	0,48 %	4,04 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	0,48 %	5,05 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,16 %	3,02 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2013)	(0,41 %)	2,64 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2011)	(0,39 %)	3,15 %
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 <sup>2</sup>	0,93 %	3,49 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2011)	(1,48 %)	3,11 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	(1,48 %)	1,93 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	(2,28 %)	2,33 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Mai 2013)	(2,39 %)	0,65 %
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 <sup>3</sup>	(0,70 %)	2,78 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2011)	(1,24 %)	3,90 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2013)	(1,25 %)	2,41 %
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 <sup>3</sup>	(0,38 %)	3,42 % <sup>2</sup>

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

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

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Diversified Income Duration Hedged Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 09. November 2015: Bogey 4309 (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) und 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).

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:

- » Makrostrategien und insbesondere ein Übergewichtetes Engagement in der US-Duration trugen zur Wertentwicklung bei, da die Renditen während des Berichtszeitraums zurückgingen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads während des Berichtszeitraums weiteten.
- » Ein Übergewichtetes Engagement im Investment-Grade- und Hochzins-Bereich bei Banken, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.
- » Das Engagement in verbrieften Schuldtiteln war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads für ausgewählte Positionen während des Berichtszeitraums weiteten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Hochzinsanleihen aus dem Telekommunikationssektor belastete die Wertentwicklung, da der Sektor während des Berichtszeitraums eine Outperformance aufwies.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2008)	5,67 %	3,26 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Feb. 2010)	5,67 %	2,93 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	5,29 %	2,22 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	5,27 %	2,21 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	5,05 %	2,39 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2010)	4,73 %	1,86 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2010)	4,72 %	1,87 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	5,53 %	5,08 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	—	5,06 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,53 %	2,31 %
1 Month USD LIBOR Index	0,63 %	0,68 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	5,79 %	4,58 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	0,37 %	1,78 %
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	5,18 %	4,11 %
1 Month LIBOR Index (CAD Hedged)	0,47 %	1,05 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2010)	3,81 %	1,07 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Apr. 2011)	2,84 %	0,15 %
1 Month CHF LIBOR Index	(0,78 %)	(0,44 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2009)	4,09 %	2,45 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Dez. 2009)	4,13 %	2,01 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2011)	3,75 %	1,28 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	3,55 %	1,42 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2009)	3,18 %	1,08 %
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Dez. 2010)	3,15 %	0,77 %
1 Month Euribor Index	(0,49 %)	0,06 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2009)	4,68 %	2,55 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	4,72 %	2,31 %
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 2010)	3,80 %	1,51 %
1 Month GBP LIBOR Index	0,25 %	0,51 % <sup>2</sup>
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Apr. 2011)	4,60 %	2,88 %
1 Month NIBOR Rate Index	0,61 %	1,35 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Mrz. 2018)	4,34 %	1,93 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2011)	3,83 %	1,52 %
1 Month SEK LIBOR Index	0,00 %	0,21 % <sup>2</sup>

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der 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 Fonds 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 Fonds 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:

- » Ein Long-Engagement in der US-Duration, hauptsächlich im 2- bis 10-jährigen Teil der Kurve, trug zur Wertentwicklung bei, da die US-Zinsen zurückgingen.
- » Ein Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere positive Renditen verbuchten.
- » Ein Long-Engagement in der italienischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen in Italien sanken.
- » Ein Short-Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen über den High Yield CDX (Credit Default Swap) Index schmälerte die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere positive Renditen verbuchten.
- » Ein Long-Engagement in mehreren Schwellenmarktwährungen, darunter Long-Engagements im brasilianischen Real und im peruanischen Sol, belasteten die Wertentwicklung, da diese Währungen an Wert verloren.
- » Ein Short-Engagement in der britischen Duration war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze im Vereinigten Königreich sanken.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	17,79 %	6,93 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 25. Feb. 2016)	17,77 %	6,93 %
Investor, thesaurierend (Auflegung 14. Aug. 2020)	—	8,80 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	16,67 %	5,83 %
Class E, ausschüttend (Auflegung 10. Sep. 2020)	—	9,40 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2016)	16,13 %	4,93 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Aug. 2019)	18,70 %	15,41 %
1 Month Euribor Index	(0,49 %)	(0,40 %) <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	17,35 %	6,86 %
1 Month CHF LIBOR Index	(0,78 %)	(0,79 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	17,87 %	7,78 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	17,87 %	13,40 %
1 Month GBP LIBOR Index	0,25 %	0,45 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung 18. Dez. 2020)	—	1,60 %
Compounded SG OvernightRate Avg SORA Index	—	0,01 %
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	19,43 %	9,27 %
Class E USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	18,21 %	7,67 %
H Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 05. Aug. 2020)	—	8,10 %
M Retail USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung 08. Jan. 2020)	—	17,19 %
1 Month USD LIBOR Index	0,63 %	1,32 % <sup>2</sup>

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Dynamic Multi-Asset Fund strebt bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung die maximal mögliche Gesamterträge 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 Fonds vorsieht.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Long-Engagement in chinesischen Aktien, insbesondere im Nicht-Basiskonsumgütersektor und im Gesundheitssektor, verstärkte die Renditen, da die Kurse stiegen.
- » Ein Long-Engagement in US-Aktien, insbesondere im Informationstechnologiesektor, verstärkte die Renditen, da die Kurse stiegen.
- » Ein Long-Engagement in japanischen Aktien verstärkte die Rendite, da die Kurse stiegen.
- » Ein Long-Engagement in U.S.-amerikanischer und kanadischer Duration verstärkte die Rendite, da die Renditen auf U.S.-amerikanische und kanadische Staatsanleihen zurückgingen.
- » Ein Long-Engagement in Aktien europäischer Banken belastete die Wertentwicklung, da die Kurse fielen.
- » Ein Long-Engagement in USD und HKD schmälerte die Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem EUR nachgaben.

# Emerging Local Bond Fund

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 11. Dez. 2007)	3,38 %	2,99 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	3,45 %	2,77 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2010)	3,05 %	1,06 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	2,35 %	4,17 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2010)	2,25 %	0,83 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	4,32 %	6,04 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	2,69 %	3,32 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Okt. 2012)	(5,72 %)	(0,55 %)
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (CHF Unhedged)	6,26 %	0,10 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	(5,15 %)	2,66 %
Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Jun. 2010)	(5,25 %)	1,97 %
Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	(5,49 %)	(5,15 %)
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	(6,14 %)	3,40 %
Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	(6,04 %)	4,87 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	(5,79 %)	3,05 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	0,19 %	6,20 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	(0,48 %)	6,52 %

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Local Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds 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:

- » Ein übergewichtetes Engagement in der lokalen peruanischen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen Renditen in Peru sanken.
- » Ein übergewichtetes Engagement in der lokalen dominikanischen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen Renditen in der Dominikanischen Republik sanken.
- » Die Positionierung entlang der Zinsstrukturkurve und die Titelauswahl in Brasilien trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die brasilianische Zinsstrukturkurve steiler wurde.
- » Eine Übergewichtung des dominikanischen Pesos schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Die taktische Positionierung im brasilianischen Real schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor und sich anschließend teilweise erholte.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2001)	7,21 %	9,25 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 13. Dez. 2001)	7,19 %	8,58 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2002)	6,85 %	7,82 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 29. Mai 2003)	6,69 %	6,73 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	6,25 %	5,60 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	6,26 %	5,73 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 17. Okt. 2002)	7,03 %	8,86 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung 03. Sep. 2020)	—	3,44 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	6,31 %	4,81 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	6,26 %	4,84 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	8,07 %	9,66 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	5,88 %	8,34 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012)	4,31 %	3,91 %
JPMorgan EMBI Global (AUD Hedged)	4,00 %	4,73 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2005)	4,63 %	4,60 %
JPMorgan EMBI Global (CHF Hedged)	3,94 %	4,77 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2002)	4,88 %	7,32 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Dez. 2010)	4,81 %	4,54 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	4,49 %	4,66 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	3,94 %	4,37 %
JPMorgan EMBI Global (Euro Hedged)	4,14 %	7,15 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2018)	(1,62 %)	6,85 %
JPMorgan EMBI Global (EUR Unhedged)	(2,86 %)	6,16 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	5,18 %	6,92 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	5,24 %	5,99 %
JPMorgan EMBI Global (GBP Hedged)	4,51 %	7,14 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2018)	6,44 %	8,39 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	5,44 %	4,71 %
JPMorgan EMBI Global (SGD Hedged)	5,23 %	6,01 % <sup>2</sup>

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Bond Fund versucht, seine Gesamterträge 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:

- » Ein untergewichtetes Engagement in libanesischen Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da das Land schlechter abschnitt als der Index.
- » Eine Untergewichtung der Spread-Duration in Schwellenländern auf Portfolioebene trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads in den Schwellenländern weiteten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Staatsanleihen aus Sri Lanka trug zur relativen Wertentwicklung bei, da das Land schlechter abschnitt als der Index, insbesondere im ersten Quartal.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Venezuela schmälerte die relative Wertentwicklung, da das Land schlechter abschnitt als der Index.
- » Die taktische Positionierung in Oman belastete die relative Wertentwicklung, da das Land im ersten Quartal hinter dem Index zurückblieb und diesen dann im zweiten bis vierten Quartal übertraf.

# Emerging Markets Bond ESG Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	7,48 %	5,70 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	7,53 %	7,46 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	6,98 %	6,93 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	6,98 %	6,91 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified <sup>3</sup>	5,78 %	6,20 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2013)	5,05 %	3,60 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2017)	5,09 %	2,88 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2018)	4,19 %	5,97 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (EUR Hedged) <sup>3</sup>	4,02 %	4,22 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2019)	5,47 %	6,49 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Hedged) <sup>3</sup>	4,40 %	5,09 %
<b>Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Dez. 2020)	—	(2,40 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Unhedged) <sup>3</sup>	—	(2,45 %)
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Mrz. 2014)	4,49 %	4,66 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (NOK Hedged) <sup>3</sup>	2,96 %	5,28 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Investor SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Feb. 2014)	4,69 %	3,40 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (SEK Hedged) <sup>3</sup>	3,88 %	4,34 %

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

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

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Emerging Markets Bond ESG Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 01. August 2019: JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter; seit dem 02. August 2019: JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Bond ESG Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den maximal möglichen Gesamtertrag erzielen, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in ein aktiv verwaltetes, diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, 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:

- » Eine Untergewichtung der Spread-Duration in Schwellenländern auf Portfolioebene trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads in den Schwellenländern weiteten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in libanesischen Staatsanleihen aufgrund von ESG-Aspekten trug zur relativen Wertentwicklung bei, da das Land schlechter abschnitt als der Index.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Staatsanleihen aus Sri Lanka trug zur relativen Wertentwicklung bei, da das Land schlechter abschnitt als der Index, insbesondere im ersten Quartal.
- » Die taktische Positionierung in Oman belastete die relative Wertentwicklung, da das Land im ersten Quartal hinter dem Index zurückblieb und diesen dann im zweiten bis vierten Quartal übertraf.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Staatsanleihen aus den Philippinen belastete die relative Wertentwicklung, da das Land die Wertentwicklung des Index übertraf.

# Emerging Markets Corporate Bond Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Nov. 2009)	5,08 %	5,43 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	4,13 %	3,76 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	7,35 %	6,74 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	1,98 %	1,99 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (CHF Hedged)	5,46 %	4,21 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Feb. 2010)	3,19 %	4,14 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mrz. 2010)	2,28 %	3,07 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (EUR Hedged)	5,73 %	5,41 % <sup>2</sup>

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der 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:

- » Ein übergewichtetes Engagement in der Spread-Duration von russischen Unternehmensanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die russische Spread-Duration den Index übertraf.
- » Positionen in ausgewählten nigerianischen Unternehmensanleihen trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Papiere den Index übertrafen.
- » Eine Untergewichtung der Spread-Duration in Schwellenländern auf Portfolioebene in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Die Titelauswahl bei südafrikanischen Unternehmensanleihen belastete die relative Wertentwicklung, da diese Emittenten schlechter abschnitten als der Index.
- » Ein übergewichtetes Engagement in kolumbianischen Unternehmensanleihen aus dem Energiesektor belastete die relative Wertentwicklung, da diese Emittenten schlechter abschnitten als der Index.

# PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	8,00 %	9,10 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged	4,32 %	7,70 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	4,45 %	6,36 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index (EUR Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	(0,87 %)	3,71 %

<sup>1</sup> 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 Gesamterträge 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:

- » Ein Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen auf US-Schatzpapiere sanken.
- » Ein Engagement in der lokalen Duration von Ländern wie Peru, Mexiko, Malaysia und Kolumbien trug zur Wertentwicklung bei, da die lokalen Renditen in Schwellenländern sanken.
- » Ein Engagement in der externen Spread-Duration von Schwellenländern belastete die Wertentwicklung, da sich die externen Spreads der Schwellenländer weiteten.
- » Ein Engagement in Schwellenmarktwährungen wie dem dominikanischen Peso, dem peruanischen Peso und dem russischen Rubel war der Wertentwicklung abträglich, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurden.

# Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Sep. 2006)	2,12 %	2,61 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	1,17 %	1,96 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	1,73 %	2,59 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2010)	(6,38 %)	2,58 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	(7,13 %)	2,14 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged)	(6,67 %)	3,01 % <sup>2</sup>

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der 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 Fonds 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 Fonds wird wahrscheinlich auf Asien, Afrika, dem Nahen Osten, Lateinamerika und den aufstrebenden Ländern Europas liegen. Der Fonds 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 Fonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaft. Unter normalen Marktbedingungen wird davon ausgegangen, dass sie nicht länger als zwei Jahre ist. Der Fonds 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:

- » Ein untergewichtetes Engagement in der türkischen Lira trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Währung gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurde.
- » Ein taktisches Engagement im südafrikanischen Rand trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor und sich anschließend teilweise erholte.
- » Ein nicht im Vergleichsindex enthaltenes Engagement in der lokalen dominikanischen Duration trug aufgrund des hohen Carry zur relativen Wertentwicklung bei.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Taiwan-Dollar schmälerte die relative Wertentwicklung aufgrund eines negativen Carry.
- » Die taktische Positionierung und die Titelauswahl in Brasilien schmälerten die relative Wertentwicklung, da die Währung im ersten Quartal an Wert verlor und sich anschließend teilweise erholte.

## Durchschnittliche jährliche Gesamttrendite für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	4,84 %	4,63 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Jan. 2003)	4,84 %	4,52 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2002)	4,49 %	4,44 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2002)	4,47 %	4,42 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2001)	4,31 %	4,28 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	3,91 %	3,41 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	3,90 %	3,11 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	4,09 %	4,37 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2006)	4,51 %	3,56 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade (CHF Hedged) Index	3,74 %	3,53 %

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamttrendite erzielen. Der Fonds 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 Übergewichtung der US-Duration, insbesondere am Bauch der Kurve, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen deutlich anstiegen.
- » Eine Übergewichtung verbriefteter Schuldtitel trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads im Laufe des Berichtszeitraums verengten.
- » Eine Übergewichtung der dänischen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen deutlich anstiegen.
- » Die Titelauswahl bei Investment-Grade-Schuldtiteln außerhalb des Finanzsektors, insbesondere bei Investment-Grade-CDX, schmälerte die relative Wertentwicklung, da es im ersten Quartal zu einem Spread-Abverkauf kam.
- » Ein Long-Engagement in einem Korb ausgewählter Schwellenmarktwährungen, insbesondere dem brasilianischen Real und dem russischen Rubel, beeinträchtigte die Wertentwicklung, da diese Währungen im ersten Quartal gegenüber dem EUR abwerteten.
- » Ein übergewichtetes Engagement in Spreads von Staatsanleihen des Peripheriestaats Italien im ersten Quartal schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads der Staatsanleihen weiteten.

## Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2008)	2,19 %	4,33 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	2,18 %	3,67 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2010)	1,25 %	3,10 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	2,26 %	2,53 %
H Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 07. Jun. 2019)	2,17 %	2,51 %
Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index	2,95 %	4,13 % <sup>2</sup>

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Credit Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtergebnisse erzielen. Der Fonds 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:

- » Ein übergewichtetes Engagement in Banken trug zur Wertentwicklung bei, da dieser Sektor während des Berichtszeitraums eine Outperformance aufwies.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Transportsektor in der zweiten Jahreshälfte trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor eine Outperformance aufwies.
- » Ein übergewichtetes Engagement in REITs trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor in der zweiten Jahreshälfte eine Outperformance verzeichnete.
- » Makrostrategien und insbesondere ein untergewichtetes Engagement in der Duration waren der Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen während des Berichtszeitraums sanken.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Energiesektor war der Wertentwicklung abträglich, da dieser Sektor während des Berichtszeitraums eine Outperformance aufwies.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	2,27 %	4,74 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	2,27 %	4,75 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2019)	2,00 %	1,91 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Mai 2012)	1,90 %	4,56 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	1,33 %	3,80 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	1,39 %	3,80 %
Class E, ausschüttend Q (Auflegung: 30. Sep. 2019)	1,43 %	1,48 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,99 %	1,83 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,98 %	1,83 %
Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index	1,94 %	3,24 % <sup>2</sup>

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Income Bond Fund beabsichtigt, seine laufenden Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Fonds 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 Fonds 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:

- » Ein Long-Engagement in der europäischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.
- » Ein Long-Engagement in Investment-Grade-Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, vornehmlich durch Carry und Titelauswahl.
- » Ein Long-Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.
- » Ein Long-Engagement in der dänischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.
- » Ein Long-Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Apr. 2006)	11,90 %	8,30 %
Bloomberg Barclays Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) over 15 Years Index <sup>2</sup>	11,03 %	7,07 %

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

<sup>2</sup> 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 Fonds 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 Fonds von Engagements bei auf Euro lautenden staatlichen und/oder regierungsnahen Rentenwerten ab.

Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 31. Januar 2020 auf.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Übergewichtung der europäischen Peripheriestaaten, insbesondere Spanien, Italien und Slowenien, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.
- » Eine Übergewichtung der nominalen US-Duration und der realen US-Duration (über TIPS) trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die nominalen und realen Renditen fielen.
- » Eine Übergewichtung von Agency-Hypotheken trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads für verbriefte Schuldtitel verengten.
- » Eine Übergewichtung von hochwertigen dänischen Hypotheken trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Eine Untergewichtung der Eurozonen-Kernländer-Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.
- » Ein Long-Engagement in einem Korb ausgewählter Schwellenmarktwährungen, insbesondere dem brasilianischen Real und dem russischen Rubel, beeinträchtigte die Wertentwicklung, da diese Währungen im ersten Quartal gegenüber dem EUR abwerteten.
- » Eine Übergewichtung von Unternehmensanleihen, insbesondere im ersten Quartal 2020, belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2006)	(0,50 %)	1,23 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(1,29 %)	0,46 %
1 Month Euribor Index	(0,49 %)	0,83 % <sup>2</sup>

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilklasse 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 Fonds 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 Long-Engagement in der europäischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.
- » Ein Long-Engagement in Investment-Grade-Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, hauptsächlich durch das Carry.
- » Ein Long-Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.
- » Die Positionen in verbrieften Schuldtiteln, vor allem Non-Agency-MBS, trugen zur Wertentwicklung bei.
- » Ein Engagement in negativen europäischen Barzinsen belastete die Wertentwicklung.
- » Ein moderates Long-Engagement in einem Korb von Schwellenmarktwährungen schmälerte die Wertentwicklung.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	—	4,60 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	—	5,10 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	—	2,18 %

<sup>1</sup> 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 eine maximale Gesamterträge bei 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.

Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 31. Januar 2020 auf.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl im Sektor für unterstützende Dienstleistungen trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Sektor für unterstützende Dienstleistungen besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Transportsektor trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Transportsektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Energiesektor wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Positionen des Fonds im Energiesektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl bei zyklischen Konsumgütern war der Wertentwicklung abträglich, da die Positionen des Fonds bei zyklischen Konsumgütern schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Gesundheitssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.
- » Die Titelauswahl im Einzelhandelssektor war der Wertentwicklung abträglich, da die Positionen des Fonds im Einzelhandelssektor schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.

# PIMCO European Short-Term Opportunities Fund

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Auf EUR lautende Klassen	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2011)	0,70 %	1,52 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mrz. 2013)	0,20 %	(0,01 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	—	0,50 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) <sup>3</sup>	(0,53 %)	1,25 % <sup>2</sup>

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

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

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 29. September 2012: PIMCO European Advantage Government 1-3 Year Bond Index; vom 30. September 2012 bis zum 16. Januar 2020: Bloomberg Barclays Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index; seit dem 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 (ehemals Euro Low Duration Fund) möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterträge 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 Fonds 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 dänischen gedeckten Anleihen trugen zur Wertentwicklung bei.
- » Ein Long-Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.
- » Positionen in inflationsgebundenen Anleihen, insbesondere in US TIPS (Treasury Inflation-Protected Securities) trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die US-Breakevens weiteten.
- » Positionen in U.S. Agency Mortgage-Backed Securities („MBS-Anleihen“) trugen zur Wertentwicklung bei.
- » Ein Long-Engagement in europäischen Peripherieländern im ersten Quartal schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads auf Staatsanleihen weiteten.
- » Ein moderates Long-Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.
- » Ein moderates Long-Engagement in einem Korb von Schwellenmarktwährungen schmälerte die Wertentwicklung.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 09. Jun. 2009)	9,56 %	4,04 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	7,89 %	3,53 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Aug. 2011)	3,48 %	2,73 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (CHF, Partially Hedged) (London Close)	1,99 %	2,21 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Mai 2010)	3,74 %	3,32 %
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mai 2010)	2,74 %	2,31 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (EUR, Partially Hedged) (London Close)	2,33 %	2,90 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jul. 2012)	5,57 %	3,56 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (GBP, Partially Hedged) (London Close)	3,97 %	3,11 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2012)	5,81 %	4,87 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (NOK, Partially Hedged) (London Close)	4,17 %	4,41 %

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der 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:

- » Die Titelauswahl bei hochwertigen U.S. Agency Mortgage Backed Securities („MBS“), insbesondere eine Vorliebe für niedrigere Kupons, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese ausgewählten Kupons besser abschnitten als US-Staatsanleihen mit gleicher Duration.
- » Ein übergewichtetes Engagement in der US-Duration vom 31.12.2019 bis 31.10.2020 trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen fielen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in der lokalen Duration der Schwellenländer, insbesondere eine Übergewichtung der peruanischen Duration, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen deutlich anstiegen.
- » Ein Long-Engagement in einem Korb ausgewählter Schwellenmarktwährungen mit hohem Carry, insbesondere dem brasilianischen Real und dem russischen Rubel, belastete die Wertentwicklung, da diese Währungen im ersten Quartal 2020 gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der britischen Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Renditen deutlich anstiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in GBP gegenüber USD in der ersten Jahreshälfte belastete die relative Wertentwicklung, da sich das GBP im Laufe des Berichtszeitraums gegenüber dem USD abschwächte.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 1998)	7,63 %	5,81 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2001)	7,63 %	5,58 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 1999)	7,28 %	5,32 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	7,27 %	5,21 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Jun. 2004)	7,12 %	5,07 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	6,70 %	4,67 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	6,65 %	4,59 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	7,45 %	5,32 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	—	5,54 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	6,61 %	4,46 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	6,31 %	3,61 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	6,39 %	3,61 %
Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	2,50 %
Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	2,38 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index <sup>3</sup>	5,58 %	4,99 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 13. Dez. 2002)	11,26 %	5,37 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 23. Mär. 2006)	11,30 %	5,23 %
Investor (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 31. Mär. 2005)	10,89 %	4,35 %
Class E (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 19. Mai 2010)	10,31 %	3,73 %
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 19. Mai 2010)	10,29 %	3,72 %
Class W (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	4,80 %
W Class (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	4,79 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index <sup>3</sup>	9,20 %	4,43 % <sup>2</sup>
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	7,31 %	6,74 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (CAD Hedged) Index <sup>3</sup>	5,33 %	6,30 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2003)	5,74 %	3,52 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	5,72 %	3,56 %
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Jun. 2011)	5,35 %	3,43 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Jun. -2018)	4,76 %	2,99 %
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	2,00 %
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	1,97 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (CHF Hedged) Index <sup>3</sup>	3,88 %	2,61 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2003)	6,03 %	4,55 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Apr. 2005)	6,00 %	4,53 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Feb. 2005)	5,64 %	4,15 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	5,05 %	3,81 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	5,03 %	2,18 %
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2012)	5,03 %	2,17 %
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,75 %	2,81 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	4,76 %	1,86 %
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	2,00 %
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	2,07 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (EUR Hedged) Index <sup>3</sup>	4,24 %	3,57 % <sup>2</sup>

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterträge erzielen. Der Fonds 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:

- » Ein Übergewichtetes Engagement in der US-Duration vom 31.12.2019 bis 31.10.2020 trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen fielen.
- » Die Titelauswahl bei hochwertigen U.S. Agency Mortgage Backed Securities („MBS“), insbesondere eine Vorliebe für niedrigere Kupons, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese ausgewählten Kupons besser abschnitten als US-Staatsanleihen mit gleicher Duration.
- » Eine taktische Erhöhung ausgewählter Positionen in Auslandsschulden von Schwellenländern nach dem Abverkauf im März trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads zwischen dem 31.03.2020 und dem 31.12.2020 verengten.
- » Ein Long-Engagement in einem Korb ausgewählter Schwellenmarktwährungen mit hohem Carry, insbesondere dem brasilianischen Real und dem russischen Rubel, belastete die Wertentwicklung, da diese Währungen im ersten Quartal 2020 gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der britischen Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Renditen deutlich anstiegen.
- » Eine taktische Untergewichtung von Hochzinsanleihen außerhalb des Finanzsektors durch CDX im vierten Quartal belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads gegenüber Schatztiteln mit gleicher Duration verengten.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	2,11 %	4,40 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (EUR Unhedged) Index <sup>3</sup>	0,18 %	3,76 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2003)	6,70 %	5,53 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2004)	6,76 %	5,62 %
Investor GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Apr. 2005)	6,35 %	5,00 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	2,30 %
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	2,28 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Hedged) Index <sup>3</sup>	4,96 %	4,62 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 09. Mrz. 2018)	7,80 %	5,90 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Unhedged) Index <sup>3</sup>	5,83 %	5,52 %
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	6,21 %	4,35 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (HKD Unhedged) Index <sup>3</sup>	8,66 %	5,12 %
<b>Auf ILS lautende Klassen</b>		
Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2010)	6,88 %	5,17 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (ILS Hedged) Index <sup>3</sup>	4,57 %	3,84 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	6,86 %	5,72 %
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Jul. 2006)	6,49 %	5,85 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (NOK Hedged) Index <sup>3</sup>	5,22 %	4,70 % <sup>2</sup>
<b>Auf NZD lautende Klassen</b>		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Nov. 2004)	7,21 %	7,79 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (NZD Hedged) Index <sup>3</sup>	5,41 %	6,76 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Nov. 2004)	6,35 %	4,80 %
Class R SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	6,06 %	4,86 %
Class W SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	2,20 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (SEK Hedged) Index <sup>3</sup>	4,62 %	3,73 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Aug. 2009)	7,26 %	6,10 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (SGD Hedged) Index <sup>3</sup>	5,40 %	4,30 %

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

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

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. November 2000: JPMorgan GBI Global Index Hedged in USD; seit dem 01. Dezember 2000: Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	7,51 %	5,07 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung 03. Apr. 2020)	—	7,85 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2018)	7,15 %	7,54 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2019)	6,98 %	7,16 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019)	7,02 %	7,15 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	6,60 %	6,67 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index	5,58 %	4,62 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	7,40 %	5,32 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (AUD Hedged)	5,09 %	4,38 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	5,50 %	2,29 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (CHF Hedged) Index	3,88 %	1,87 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	5,90 %	2,71 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	5,88 %	2,71 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 09. Feb. 2017)	4,98 %	1,90 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (EUR Hedged) Index	4,24 %	2,31 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2020)	—	4,80 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	6,56 %	3,70 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Hedged) Index	4,96 %	3,33 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Dez. 2020)	—	(3,00 %)
Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Unhedged) Index	—	(0,03 %)
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	6,74 %	4,08 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (NOK Hedged) Index	5,22 %	3,72 %
<b>Auf NZD lautende Klassen</b>		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Apr. 2017)	7,04 %	4,97 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (NZD Hedged) Index	5,41 %	4,72 %

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond ESG Fund beabsichtigt, einen höchstmöglichen 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) anlegt, die auf weltweit führende Währungen lauten.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Ein übergewichtetes Engagement in der US-Duration vom 31.12.2019 bis 31.10.2020 trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Renditen in diesem Zeitraum nach unten bewegten.
- » Die Titelauswahl bei hochwertigen U.S. Agency Mortgage Backed Securities („MBS“), insbesondere eine Vorliebe für niedrigere Kupons, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese ausgewählten Kupons besser abschnitten als US-Staatsanleihen mit gleicher Duration.
- » Eine taktische Erhöhung ausgewählter Positionen in Auslandsschulden von Schwellenländern nach dem Abverkauf im März trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads zwischen dem 31.03.2020 und dem 31.12.2020 verengten.
- » Ein Long-Engagement in einem Korb ausgewählter Schwellenmarktwährungen mit hohem Carry, insbesondere dem brasilianischen Real und dem russischen Rubel, belastete die relative Wertentwicklung, da diese Währungen im ersten Quartal 2020 gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der britischen Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Renditen deutlich anstiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in Finanztiteln, insbesondere über Bankkapitalpapiere, belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

## Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2003)	5,67 %	5,33 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 09. Nov. 2005)	5,69 %	5,57 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2006)	5,34 %	5,18 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Sep. 2004)	5,17 %	5,08 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	4,74 %	4,92 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	5,58 %	6,41 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Okt. 2019)	6,18 %	5,53 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index <sup>3</sup>	3,94 %	4,30 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 04. Okt. 2016)	10,88 %	2,88 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Unhedged) Index <sup>3</sup>	10,11 %	3,05 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2006)	4,22 %	4,92 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (EUR Hedged) Index <sup>3</sup>	2,65 %	3,62 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Feb. 2019)	4,84 %	4,89 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (GBP Hedged) Index <sup>3</sup>	3,34 %	4,37 %

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

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

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Ex-US Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 19. Januar 2016: FTSE World Government Bond Ex-U.S. Index (USD Hedged); seit dem 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 Fonds 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:

- » Ein übergewichtetes Engagement in der US-Duration vom 31.12.2019 bis 31.10.2020 trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen fielen.
- » Die Titelauswahl bei hochwertigen U.S. Agency Mortgage Backed Securities („MBS“), insbesondere eine Vorliebe für niedrigere Kupons, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese ausgewählten Kupons besser abschnitten als US-Staatsanleihen mit gleicher Duration.
- » Eine taktische Erhöhung ausgewählter Positionen in Auslandsschulden von Schwellenländern nach dem Abverkauf im März trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads zwischen dem 31.03.2020 und dem 31.12.2020 verengten.
- » Ein Long-Engagement in einem Korb ausgewählter Schwellenmarktwährungen mit hohem Carry, insbesondere dem brasilianischen Real und dem russischen Rubel, belastete die Wertentwicklung, da diese Währungen im ersten Quartal 2020 gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der britischen Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Renditen deutlich anstiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in GBP gegenüber USD in der ersten Jahreshälfte belastete die relative Wertentwicklung, da sich das GBP im Laufe des Berichtszeitraums gegenüber dem USD abschwächte.

# PIMCO Global Core Asset Allocation Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	14,59 %	6,73 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	14,20 %	4,68 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2009)	13,21 %	5,19 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Jan. 2011)	13,23 %	3,55 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 06. Jul. 2016)	15,63 %	10,54 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged	12,65 %	9,19 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	11,14 %	5,70 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Jun. 2009)	9,87 %	4,17 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	9,74 %	2,38 %
60 % MSCI All Country World Index EUR Hedged /40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate EUR Hedged	9,78 %	7,96 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2010)	11,04 %	4,68 %
60 % MSCI All Country World Index GBP Hedged /40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate GBP Hedged	10,01 %	7,38 %

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

- » Die Positionierung bei den Spreads auf Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf Investment Grade-Titel im ersten Quartal 2020 weiteten und sich vom zweiten bis zum vierten Quartal 2020 verengten.
- » Die Relative-Value-Strategien bei REITs trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da das Long-Engagement in bestimmten Einzeltiteln das Short-Engagement im breiten Index übertraf.
- » Die Durationspositionierung in den Schwellenmärkten kam der Wertentwicklung zugute, vornehmlich aufgrund der übergewichteten Engagements im April und Dezember, da diese Wertpapiere im ersten Quartal negative Renditen erbrachten, jedoch im April und Dezember eine positive Wertentwicklung verzeichneten.
- » Ein übergewichtetes Engagement in Schwellenmarktwährungen, insbesondere im mexikanischen Peso, dem russischen Rubel und der indischen Rupie, belastete die relative Wertentwicklung, da diese Währungen im Berichtszeitraum gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.
- » Ein übergewichtetes Engagement in US-Aktien schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Gewinne aus der Übergewichtung, solange diese Wertpapiere positive Renditen erzielten, durch Verluste aus der Übergewichtung, als diese Wertpapiere negative Renditen verbuchten, mehr als ausgeglichen wurden.
- » Ein übergewichtetes Engagement in britischen Aktien belastete die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere im Allgemeinen negative Renditen verzeichneten.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	4,69 %	6,84 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	4,69 %	6,89 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	4,34 %	6,34 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	4,17 %	6,62 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2015)	4,16 %	6,80 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	3,72 %	5,88 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	3,73 %	5,95 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	4,51 %	7,13 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2013)	4,54 %	5,32 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	3,76 %	5,62 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	3,78 %	4,57 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	4,47 %	5,50 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	3,29 %	4,54 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	3,33 %	4,53 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD <sup>3</sup>	5,70 %	7,16 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Feb. 2010)	2,36 %	5,44 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	2,34 %	4,11 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into CHF <sup>3</sup>	3,73 %	5,80 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2008)	2,54 %	5,75 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	2,55 %	5,83 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2011)	2,19 %	4,69 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Aug. 2010)	1,98 %	4,92 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,67 %	4,80 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2016)	1,64 %	3,34 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2016)	1,29 %	2,29 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into EUR <sup>3</sup>	3,92 %	5,95 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	2,62 %	5,65 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	2,56 %	6,50 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2010)	2,10 %	5,61 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009)	1,70 %	6,85 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into GBP <sup>3</sup>	4,26 %	6,66 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2016)	2,98 %	5,30 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into SGD <sup>3</sup>	5,04 %	6,68 %

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

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

<sup>3</sup> 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.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global High Yield Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds 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:

- » Eine Untergewichtung des Energiesektors trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Die Titelauswahl im Sektor für unterstützende Dienstleistungen trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Sektor für unterstützende Dienstleistungen besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Bankensektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Energiesektor war der Wertentwicklung abträglich, da die Positionen des Fonds im Energiesektor schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Die Titelauswahl im Transportsektor war der Wertentwicklung abträglich, da die Positionen des Fonds im Transportsektor schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Glücksspiel- und Hotelsektor schmälerte die Wertentwicklung, da dieser Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	5,93 %	6,19 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jul. 2003)	5,94 %	5,88 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2005)	5,56 %	5,35 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	5,61 %	6,70 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	5,41 %	6,53 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	5,40 %	6,54 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2008)	5,03 %	6,33 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	4,96 %	5,18 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	5,76 %	6,24 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	5,76 %	7,02 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	4,95 %	3,96 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	4,99 %	4,60 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,71 %	4,49 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,58 %	4,49 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	4,55 %	3,85 %
Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	—	3,20 %
Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	—	3,16 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (USD Hedged)	7,78 %	1,93 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 02. Aug. 2013)	8,12 %	4,46 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 06. Sep. 2016)	8,09 %	4,84 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (USD Unhedged)	10,03 %	4,18 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Apr. 2020)	—	12,50 %
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	4,40 %	6,24 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (AUD Hedged)	6,67 %	7,31 % <sup>2</sup>
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	5,00 %	6,48 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (CAD Hedged)	7,07 %	7,44 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2009)	3,77 %	4,27 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Feb. 2015)	3,76 %	2,51 %
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mai 2011)	3,34 %	3,24 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	3,37 %	5,13 %
Administrative CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2013)	3,27 %	2,34 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mrz. 2012)	2,80 %	2,56 %
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	—	2,70 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (CHF Hedged)	5,94 %	4,47 % <sup>2</sup>
<b>Auf CNH lautende Klassen</b>		
Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	7,07 %	8,32 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (CNH Hedged)	9,62 %	9,42 %
<b>Auf CZK lautende Klassen</b>		
Institutional CZK (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2015)	4,73 %	3,53 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (CZK Hedged)	6,72 %	3,54 %

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Investment Grade Credit Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterträge erzielen. Der Fonds 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:

- » Makrostrategien wie die Positionierung entlang der Zinsstrukturkurve in den USA und das Engagement in lokalen Schuldtiteln aus Schwellenländern trugen zur Wertentwicklung bei.
- » Eine Untergewichtung des Energiesektors (ohne Pipelines), der in diesem Jahr eine Underperformance aufwies, trug zur Wertentwicklung bei.
- » Das Engagement in Bankensektor, insbesondere bei nachrangigen Bankenschuldtiteln, die sich in diesem Jahr unterdurchschnittlich entwickelten, belastete die Wertentwicklung.
- » Eine Übergewichtung und die Titelauswahl bei REITs, in diesem Jahr eine Underperformance aufwiesen, war der Wertentwicklung abträglich.
- » Eine Übergewichtung des Transportsektors, insbesondere bei Fluggesellschaften, die sich in diesem Jahr unterdurchschnittlich entwickelten, belastete die Wertentwicklung.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2003)	4,05 %	5,03 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2008)	4,06 %	5,58 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2006)	3,67 %	4,75 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	3,64 %	5,71 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	3,54 %	5,42 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	3,53 %	5,42 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	3,11 %	4,11 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Sep. 2010)	3,12 %	3,37 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,85 %	2,97 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	2,72 %	2,03 %
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	2,80 %
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	2,75 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (EUR Hedged)	6,27 %	4,12 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2012)	(0,85 %)	4,13 %
Class E EUR (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	(1,73 %)	5,12 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (EUR Unhedged)	0,95 %	4,13 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Sep. 2005)	4,56 %	5,50 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Jul. 2008)	4,57 %	6,08 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	4,17 %	6,26 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jan. 2009)	4,02 %	6,07 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mrz. 2009)	3,60 %	5,80 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	4,26 %	3,78 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	3,00 %
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	—	3,07 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (GBP Hedged)	6,83 %	4,76 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	4,85 %	4,79 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	4,50 %	4,35 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (HKD Unhedged) Credit Index	9,50 %	5,35 %
<b>Auf HUF lautende Klassen</b>		
Institutional HUF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2015)	4,54 %	3,51 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (HUF Hedged)	6,73 %	3,45 %
<b>Auf ILS lautende Klassen</b>		
Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2010)	4,98 %	5,29 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (ILS Hedged)	6,55 %	4,84 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jan. 2012)	4,44 %	5,55 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (NOK Hedged)	6,52 %	5,15 %
<b>Auf PLN lautende Klassen</b>		
Institutional PLN (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Jun. 2015)	4,84 %	5,33 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (PLN Hedged)	7,09 %	5,36 %
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Dez. 2009)	4,20 %	5,25 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2012)	3,62 %	2,89 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (SEK Hedged)	6,46 %	4,63 % <sup>2</sup>

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	5,38 %	5,50 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	5,07 %	6,35 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Sept. 2017)	4,90 %	4,34 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jul. 2012)	4,42 %	3,92 %
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 13. Okt. 2020)	—	2,57 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (SGD Hedged)	7,40 %	5,33 % <sup>2</sup>

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

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

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	8,92 %	9,72 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 19. Jul. 2019)	8,87 %	8,36 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	—	4,70 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	—	4,76 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Jun. 2019)	9,59 %	9,12 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (USD Hedged)	7,78 %	8,81 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	6,73 %	6,67 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	—	3,89 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	—	3,10 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	—	3,04 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (CHF Hedged)	5,94 %	5,91 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	7,06 %	7,08 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	—	4,09 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	—	3,30 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	—	3,24 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (EUR Hedged)	6,27 %	6,33 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	7,59 %	8,01 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mai 2019)	7,71 %	7,95 %
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	—	3,70 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	—	3,66 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (GBP Hedged)	6,83 %	7,34 % <sup>2</sup>
<b>Auf SEK lautende Klassen</b>		
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Nov. 2019)	6,70 %	6,03 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (SEK Hedged)	6,46 %	5,82 %

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Investment Grade Credit ESG Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterträge erzielen. Der Fonds 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:

- » Makrostrategien und insbesondere die Positionierung entlang der Zinsstrukturkurve in den USA sowie eine taktische Short-Position im USD gegenüber einer Long-Position im Euro trugen zur Wertentwicklung bei.
- » Eine Untergewichtung des Versicherungssektors im ersten Quartal trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor während des Abverkaufs eine Underperformance aufwies.
- » Die Titelauswahl bei REITs trug zur Wertentwicklung bei, da die ausgewählten Emittenten eine Outperformance verzeichneten.
- » Die Titelauswahl im Telekommunikationssektor belastete die Wertentwicklung, da ein untergewichteter Emittent im Laufe des Jahre eine Outperformance aufwies.
- » Das Engagement in Bankensektor, insbesondere bei nachrangigen Bankenschuldtiteln, die sich in diesem Jahr unterdurchschnittlich entwickelten, belastete die Wertentwicklung.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	3,58 %	3,51 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019)	3,62 %	4,10 %
1 Month USD LIBOR Index	0,63 %	1,31 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	2,10 %	1,35 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Apr. 2018)	2,13 %	1,30 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2018)	1,80 %	0,68 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017)	1,42 %	0,03 %
1 Month Euribor Index	(0,49 %)	(0,39 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	2,75 %	2,33 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	2,69 %	2,95 %
1 Month GBP LIBOR Index	0,25 %	0,45 % <sup>2</sup>

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der 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 Fonds 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:

- » Ein Long-Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.
- » Die Positionen in Agency-MBS kamen der Wertentwicklung zugute, da der Fonds mit diesen Wertpapieren Carry erwirtschaftete.
- » Ein taktisches Engagement in der italienischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.
- » Ein Engagement in Schuldtiteln mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da der Fonds mit diesen Wertpapieren Carry erwirtschaftete.
- » Ein Long-Engagement in lokalen Schuldtiteln in ausgewählten Ländern kam der Wertentwicklung zugute, da die Renditen zurückgingen.
- » Ein moderates Long-Engagement in einem diversifizierten Korb von Schwellenmarktwährungen belastete die Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert einbüßten.
- » Ein Engagement in High Yield CDX schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads am Hochzinsmarkt verengten.
- » Ein Short-Engagement in der britischen Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Renditen zurückgingen.

# Global Low Duration Real Return Fund

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	5,14 %	2,00 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 05. Okt. 2016)	4,78 %	2,64 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	4,16 %	1,09 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	3,75 %	1,86 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	3,22 %	(0,10 %)
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (CHF Hedged)	2,05 %	(0,28 %)
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	3,54 %	0,36 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jan. 2017)	3,47 %	0,63 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	2,56 %	(0,55 %)
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (EUR Hedged)	2,37 %	0,23 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	4,20 %	1,63 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	4,23 %	1,21 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (GBP Hedged)	3,07 %	1,10 % <sup>2</sup>

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der 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:

- » Eine Übergewichtung US-amerikanischer Realzinsen für Staatsanleihen trug zur relativen Rendite bei, da die US-Realrenditen während des Berichtszeitraums sanken.
- » Eine Untergewichtung der britischen Breakevens trug zur relativen Rendite bei, da die britischen Breakevens während des Berichtszeitraums fielen.
- » Eine Übergewichtung italienischer Realzinsen für Staatsanleihen trug zur relativen Rendite bei, da die italienischen Realrenditen während des Berichtszeitraums sanken.
- » Eine Untergewichtung US-amerikanischer Nominalzinsen schmälerte die relative Rendite, da während des Berichtszeitraums bei US-Nominalrenditen eine Rallye verzeichnet wurde.
- » Eine Untergewichtung deutscher Nominalzinsen für Staatsanleihen beeinträchtigte die relative Rendite, da die deutschen Nominalrenditen während des Berichtszeitraums fielen.

Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	11,19 %	5,34 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	11,20 %	5,10 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mrz. 2004)	10,80 %	4,81 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	10,77 %	5,87 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2004)	10,65 %	4,59 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	10,23 %	4,36 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	10,25 %	4,21 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2004)	11,02 %	5,18 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	10,80 %	3,82 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	9,81 %	5,12 % <sup>2</sup>
<b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 01. Sep. 2017)	13,71 %	5,70 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Unhedged Index	12,54 %	5,46 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2008)	8,83 %	3,55 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	8,92 %	3,43 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	8,50 %	4,27 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond CHF Hedged Index	7,97 %	3,25 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	9,16 %	4,45 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	9,19 %	4,12 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2004)	8,80 %	4,00 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	8,16 %	3,42 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond EUR Hedged Index	8,34 %	4,20 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	9,61 %	5,43 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Apr. 2005)	9,69 %	5,02 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009)	8,66 %	4,54 %
Class R GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	9,45 %	3,16 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond GBP Hedged Index	9,05 %	5,26 % <sup>2</sup>
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Feb. 2008)	10,64 %	4,68 %
Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond SGD Hedged Index	9,55 %	4,56 %

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Real Return Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Realrendite erzielen. Der Fonds 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:

- » Eine Übergewichtung US-amerikanischer Realzinsen für Staatsanleihen trug zur relativen Rendite bei, da die US-Realrenditen während des Berichtszeitraums sanken.
- » Eine Übergewichtung verbriefter Schuldverschreibungen, vornehmlich U.S. Agency Mortgage-Backed Securities („MBS-Anleihen“), erwies sich als vorteilhaft, da diese Papiere eine Outperformance verzeichneten.
- » Eine Übergewichtung französischer Realzinsen für Staatsanleihen in einem Teil des Berichtszeitraums trug zur relativen Rendite bei, da die französischen Realrenditen während des Berichtszeitraums fielen.
- » Eine Untergewichtung US-amerikanischer Nominalzinsen schmälerte die relative Rendite, da während des Berichtszeitraums bei US-Nominalrenditen eine Rally verzeichnet wurde.
- » Eine Übergewichtung spanischer Realzinsen für Staatsanleihen in einem Teil des Berichtszeitraums schmälerte die relative Rendite, da die spanischen Realrenditen während des Berichtszeitraums anstiegen.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	6,53 %	6,51 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	6,52 %	6,52 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2015)	6,15 %	5,35 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2013)	6,16 %	5,12 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 13. Feb. 2017)	6,04 %	5,06 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,98 %	5,98 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,66 %	5,57 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,61 %	5,57 %
Class E, ausschüttend Q (Auflegung: 30. Sep. 2019)	5,58 %	6,19 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2018)	6,36 %	6,22 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	6,37 %	6,18 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	6,30 %	6,93 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2015)	6,23 %	5,23 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	5,17 %	4,08 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	5,14 %	4,10 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	7,15 %	7,08 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index	7,51 %	3,25 % <sup>2</sup>
<b>Auf AUD lautende Klassen</b>		
Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jan. 2018)	4,90 %	4,36 %
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	4,56 %	5,01 %
Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	4,42 %	5,12 %
Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Feb. 2017)	4,04 %	4,09 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Okt. 2015)	5,55 %	6,35 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	7,02 %	4,22 % <sup>2</sup>
<b>Auf BRL lautende Klassen</b>		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Feb. 2016)	(16,77 %)	5,49 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate (BRL Hedged) Index	7,26 %	9,72 %
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Apr. 2016)	5,79 %	5,64 %
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2018)	5,85 %	6,44 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index (CAD Hedged)	7,30 %	3,53 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Dez. 2014)	4,39 %	3,27 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	4,36 %	3,18 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	3,40 %	2,53 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	3,28 %	2,52 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	5,76 %	1,70 % <sup>2</sup>
<b>Auf CNH lautende Klassen</b>		
Investor RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2018)	7,61 %	6,01 %
Class E RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mai 2013)	7,02 %	6,55 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (CNH Hedged) Index	9,48 %	6,00 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	4,52 %	4,98 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	4,50 %	4,96 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	4,59 %	3,52 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2015)	4,23 %	2,99 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2015)	4,24 %	3,11 %

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Income Fund ist bestrebt, unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung hohe laufende Erträge zu erzielen, wobei das sekundäre Ziel der langfristige Kapitalzuwachs ist. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds 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:

- » Ein Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen in den USA zurückgingen.
- » Ein Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere positive Renditen verbuchten.
- » Das Engagement in ausgewählten lokalen Schuldtiteln aus Schwellenländern, darunter lokale Schuldtitel aus Mexiko und Peru, kam der Wertentwicklung zugute, da diese Wertpapiere positive Renditen verzeichneten.
- » Das Engagement in Schwellenmarktwährungen, darunter ein Engagement im brasilianischen Real und im russischen Rubel, belastete die Wertentwicklung, da diese Währungen an Wert einbüßten.
- » Ein Short-Engagement in der britischen Duration war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze im Vereinigten Königreich sanken.
- » Ein Short-Engagement in der japanischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Kurve für japanische Zinsswaps („IRSW“) im ersten Quartal leicht zurückging.

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Investor EUR (Hedged), ausschüttend A (Auflegung: 16. Dez. 2015)	4,18 %	3,53 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Aug. 2015)	4,06 %	3,12 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	4,00 %	3,09 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,61 %	4,04 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,69 %	4,04 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 31. Aug. 2018)	3,64 %	3,49 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II Q (Auflegung: 30. Sep. 2019)	3,61 %	4,03 %
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Aug. 2017)	3,61 %	1,55 %
H Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jun. 2017)	4,41 %	2,45 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	4,25 %	3,73 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	3,15 %	2,20 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	3,08 %	2,20 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	6,11 %	1,83 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
G Retail EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2019)	(3,05 %)	1,10 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (EUR Unhedged) Index	(1,37 %)	2,80 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2019)	4,95 %	5,31 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	4,84 %	4,77 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	—	4,04 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Sept. 2016)	4,34 %	3,67 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	3,90 %	2,96 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	4,60 %	5,45 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	6,88 %	2,68 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	6,00 %	5,88 %
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Apr. 2017)	5,51 %	4,75 %
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 04. Feb. 2013)	5,10 %	4,66 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	6,98 %	3,43 % <sup>2</sup>
<b>Auf JPY lautende Klassen</b>		
Institutional JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sep. 2017)	4,89 %	2,71 %
Class E JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung 01. Sep. 2017)	4,02 %	1,79 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index	6,38 %	2,57 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2017)	4,61 %	3,97 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index	7,17 %	3,81 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 14. Jul. 2020)	—	7,30 %
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2015)	5,93 %	5,83 %
Investor SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 07. Feb. 2020)	—	4,70 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	5,55 %	5,43 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,29 %	5,82 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Feb. 2013)	4,96 %	4,49 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	7,35 %	3,19 % <sup>2</sup>

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

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

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	4,04 %	0,68 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	2,68 %	(0,53 %)
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 <sup>2</sup>	1,14 %	0,49 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	(1,33 %)	(1,51 %)
Class E EUR (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	(1,28 %)	(1,51 %)
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 <sup>2</sup>	(2,28 %)	(0,12 %)
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Mai 2014)	1,33 %	1,00 %
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 <sup>2</sup>	(0,88 %)	0,66 %

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

<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Inflation Strategy Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 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 Fonds wird aktiv verwaltet und legt primär in ein diversifiziertes Portfolio an, das aus inflationsgekoppelten Anlagen besteht. Der Fonds 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 in solchen Anlagen können durch direkte Anlagen oder die Verwendung von Finanzderivaten erreicht werden, wie im Verkaufsprospekt näher erläutert. Der Fonds 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 in U.S. TIPS (Treasury Inflation-Protected Securities) kam der Wertentwicklung zugute, da die TIPS positive Renditen verzeichneten.
- » Ein Engagement in Master Limited Partnerships (MLPs) belastete die absolute Rendite, da MLPs negative Renditen verbuchten.
- » Die Positionierung bei Estate Investment Trusts (REITs), insbesondere eine Übergewichtung industrieller REITs und eine Untergewichtung von Einzelhandels-REITs, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da industrielle REITs und Einzelhandels-REITs gegenüber dem breiteren Markt jeweils eine über- bzw. unterdurchschnittliche Entwicklung verzeichneten.
- » Eine Übergewichtung von US-Zinssätzen wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da die US-Zinssätze während des Berichtszeitraums sanken.
- » Eine Übergewichtung von Schwellenmarktwährungen belastete die relative Wertentwicklung, da Schwellenmarktwährungen während des Berichtszeitraums abgewertet wurden.

# Low Average Duration Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	3,12 %	2,82 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	3,20 %	2,82 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2004)	2,76 %	2,56 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 03. Jul. 2003)	2,75 %	2,40 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2004)	2,56 %	2,36 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	2,20 %	1,83 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	2,22 %	2,09 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Nov. 2009)	2,89 %	1,99 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	2,98 %	3,66 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,77 %	1,34 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index	3,10 %	2,16 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2012)	1,73 %	0,66 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	1,79 %	2,11 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jul. 2009)	0,81 %	0,48 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (EUR Hedged)	1,83 %	1,34 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	2,46 %	1,02 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2010)	2,41 %	1,66 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (GBP Hedged)	2,66 %	0,96 % <sup>2</sup>

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Average Duration Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. Der Fonds 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:

- » Die Positionen in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da der Sektor insgesamt ein positives Carry und sich die Spreads während des Berichtszeitraums verengten.
- » Ein Übergewichtetes Engagement in Agency-MBS trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Gesamterträge dieser Wertpapiere positiv ausfielen.
- » Ein Übergewichtetes Engagement in der US-Duration im mittleren Bereich der Kurve zu Beginn des Berichtszeitraums war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da die Zinsen fielen.
- » Positionen in US Treasury Inflation-Protected Securities schmälerten die relative Wertentwicklung, da die Breakeven-Inflationsraten stiegen.
- » Ein Übergewichtetes Engagement in der Duration in Italien beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die lokalen Zinsen während des Berichtszeitraums stiegen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der Duration im Vereinigten Königreich belastete die relative Wertentwicklung, da die lokalen Zinsen während des Berichtszeitraums fielen.

# Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	3,31 %	2,93 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	4,36 %	2,98 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	1,87 %	1,30 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	0,88 %	0,38 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (EUR Hedged)	3,00 %	1,34 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	2,75 %	2,16 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (GBP Hedged)	3,68 %	2,22 %
<b>Auf NOK lautende Klassen</b>		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2017)	2,72 %	2,19 %
Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (NOK Hedged)	3,70 %	2,68 %

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

## 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:

- » Makrostrategien und insbesondere die Positionierung entlang der Zinsstrukturkurve in Form einer Übergewichtung in Bezug auf den Bauch der Kurve trugen zur Wertentwicklung bei, da die Rendite während des Berichtszeitraum zurückgingen.
- » Eine Untergewichtung des Energiesektors trug zur Wertentwicklung bei, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Banken- und Maklersektor, der während des Berichtszeitraums eine Outperformance verzeichnete.
- » Die Titelauswahl im Finanzsektor, da ein ausgewählter Emittent hinter dem breiteren Markt zurückblieb.
- » Die Titelauswahl im Luftfahrt- und Verteidigungssektor, da ein ausgewählter Emittent hinter dem breiteren Markt zurückblieb.

# Low Duration Income Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,17 %	4,05 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,16 %	4,06 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	2,26 %	3,20 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Sep. 2018)	2,28 %	3,40 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung 03. Sep. 2020)	—	3,30 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index	3,08 %	3,35 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,28 %	1,23 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,24 %	1,22 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	0,40 %	0,39 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	0,30 %	0,36 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (CHF Hedged)	1,46 %	0,60 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,56 %	1,60 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,18 %	1,23 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,14 %	1,22 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	0,59 %	0,69 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	0,63 %	0,73 %
Class Z EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2020)	—	5,90 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (EUR Hedged)	1,80 %	0,99 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	2,11 %	2,50 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,97 %	2,46 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (GBP Hedged)	2,58 %	2,06 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 14. Okt. 2020)	—	3,00 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,78 %	2,60 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (SGD Hedged)	2,95 %	2,92 % <sup>2</sup>

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Income Fund strebt unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung attraktive Erträge an. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Fonds 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:

- » Ein Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen in den USA zurückgingen.
- » Ein Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere positive Renditen verbuchten.
- » Ein Engagement in Agency-MBS trug zur Wertentwicklung bei, da die Kurse dieser Wertpapiere stiegen.
- » Das Engagement in Schwellenmarktwährungen, darunter ein Long-Engagement im brasilianischen Real und dem russischen Rubel, belastete die Wertentwicklung, da diese Währungen an Wert einbüßten.
- » Das Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern in ausgewählten Ländern, darunter Mexiko und Brasilien, belastete die Wertentwicklung, da die Kurse dieser Wertpapiere im ersten Quartal fielen.
- » Ein Engagement in CMBS schmälerte die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere negative Renditen verzeichneten.

## Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	(26,83 %)	(9,10 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	(26,74 %)	(9,09 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 21. Feb. 2018)	(27,08 %)	(11,73 %)
Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2018)	(27,04 %)	(12,00 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	(27,75 %)	(10,20 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	(26,09 %)	(20,79 %)
Alerian MLP Index	(28,69 %)	(12,34 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	(29,21 %)	(10,98 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	(29,02 %)	(10,93 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2018)	(29,27 %)	(14,58 %)
Alerian MLP Index EUR (Hedged)	(30,36 %)	(13,86 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	(31,05 %)	(10,95 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	(30,94 %)	(10,92 %)
Alerian MLP Index GBP (Hedged)	(32,33 %)	(13,93 %)

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Die vom Fonds angestrebte „Gesamtergebnisse“ besteht aus Ertrag und Kapitalzuwachs. Der Fonds 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) andere juristische 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 Fonds 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 in Aktien von Midstream-Energieunternehmen belastete die absolute Rendite, da der Sektor negative Renditen verzeichnete.
- » Die Titelauswahl und eine Übergewichtung des Sektors für Erdgasbeförderung in Pipelines trugen zur relativen Rendite bei, da die Beteiligungen des Fonds den Sektor übertrafen und der Sektor besser abschnitt als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl und eine Untergewichtung des Sektors für Erdölförderung in Pipelines trugen zur relativen Rendite bei, da die Beteiligungen des Fonds den Sektor übertrafen und der Sektor hinter dem Vergleichsindex zurückblieb.
- » Die Titelauswahl und eine Übergewichtung des Verflüssigungssektors trugen zur relativen Rendite bei, da die Beteiligungen des Fonds den Sektor übertrafen und der Sektor besser abschnitt als der Vergleichsindex.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Midstream-Energieunternehmen nach Volatilität im ersten Quartal 2020 schmälerte die relativen Renditen, da der Sektor positive Renditen verzeichnete.

# Mortgage Opportunities Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	4,07 %	3,62 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	4,15 %	3,64 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2017)	3,73 %	2,94 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	3,69 %	3,26 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	3,64 %	3,14 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	3,16 %	2,71 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	3,12 %	2,70 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mai 2020)	—	6,20 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 03. Sep. 2019)	4,83 %	4,79 %
3 Month USD LIBOR Index	0,98 %	1,73 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,37 %	0,93 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2017)	1,50 %	(0,59 %)
3 Month USD LIBOR (in CHF besichert)	(0,82 %)	(0,96 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,63 %	1,32 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,54 %	1,30 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,70 %	0,40 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Jun. 2017)	1,73 %	(0,01 %)
3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) Index	(0,44 %)	(0,55 %) <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	3,21 %	2,26 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	3,32 %	2,28 %
Class Z GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017)	3,95 %	2,44 % <sup>2</sup>
3 Month USD LIBOR (GBP Hedged) Index	0,25 %	0,42 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Class E SGD (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 07. Jun. 2017)	2,80 %	1,73 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,72 %	2,15 %
3 Month SGD LIBOR Index	0,62 %	1,26 % <sup>2</sup>

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:

- » Ein Long-Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen fielen.
- » Ein Engagement in Agency-Passthrough-MBS kam der Wertentwicklung zugute, da sich die Spreads von Agency-MBS verengten.
- » Ein Engagement in erstrangigen besicherten Darlehensobligationen (CLOs) trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor positive Renditen erzielte.
- » Ein Engagement in ausgewählten strukturierten Agency-MBS belastete die Wertentwicklung, da der Sektor hinter den Swaps zurückblieb.
- » Ein Engagement in Non-Agency-RMBS schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads der Non-Agency-RMBS weiteten.
- » Ein Engagement in erstrangigen forderungsbesicherten Wertpapieren (ABS) belastete die Wertentwicklung, da die sich die ABS-Spreads weiteten.

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	18,53 %	7,28 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2001)	18,54 %	8,68 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Jan. 1999)	18,13 %	6,76 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	17,50 %	9,14 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	—	17,50 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2017)	17,04 %	14,27 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	17,75 %	6,62 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	15,57 %	13,13 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	15,58 %	8,51 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 02. Aug. 2017)	14,46 %	10,93 %
S&P (EUR Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	15,12 %	7,51 % <sup>2</sup>

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der StocksPLUS™ Fund ist bestrebt, eine Rendite zu erzielen, die besser ist als die Entwicklung der Gesamtergebnisse von Standard & Poor's 500 Composite Stock Price Index („S&P 500“). Zu diesem Zweck wendet der Fonds 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 Fonds 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 Fonds bei mit dem S&P 500 verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich in den zwölf Monaten zum Dezember 2020 positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 eine Rendite von 17,75 % verbuchte.
- » Die Alpha-Anleihenstrategie des Portfolios trug zur Rendite bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
  - » US-Durationsstrategien trugen zur Wertentwicklung bei, da die Renditen auf breiter Front zurückgingen.
  - » Positionen in Investment-Grade-Unternehmensanleihen trugen zur Rendite bei, da sich die Spreads verengten.
  - » Die Positionen in Agency-MBS trugen zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen stieg.
  - » Schwellenmarktwährungsstrategien waren der Rendite abträglich, was vor allem Long-Positionen im brasilianischen Real, im südafrikanischen Rand und im russischen Rubel gegenüber dem US-Dollar zuzuschreiben war.
  - » Ein Short-Engagement im kanadischen Dollar gegenüber dem US-Dollar schmälerte die Rendite, da der kanadische Dollar während der Haltedauer gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019)	19,20 %	21,52 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019)	18,14 %	20,44 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	17,75 %	18,96 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 05. Mai 2020)	—	35,20 %
S&P (EUR Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	—	30,17 %

<sup>1</sup> 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 Gesamterträge bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er die unternehmenseigene Portfoliomanagementstrategie der Anlageberatungsgesellschaft verfolgt, die als „StocksPLUS“ bekannt ist (sie kombiniert ein aktiv verwaltetes, aus Renteninstrumenten bestehendes Portfolio mit Engagements in Aktienwerten). 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 Fonds bei mit dem S&P 500 verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich in den zwölf Monaten zum Dezember 2020 positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 eine Rendite von 17,75 % verbuchte.
- » Die Alpha-Anleihenstrategie des Portfolios trug zur Rendite bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
  - » US-Durationsstrategien trugen zur Wertentwicklung bei, da die Renditen auf breiter Front zurückgingen.
  - » Positionen in Investment-Grade-Unternehmensanleihen trugen zur Rendite bei, da sich die Spreads verengten.
  - » Die Positionen in Agency-MBS trugen zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen stieg.
  - » Schwellenmarktwährungsstrategien waren der Rendite abträglich, was vor allem Long-Positionen im brasilianischen Real und mexikanischen Peso gegenüber dem US-Dollar zuzuschreiben war.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	4,45 %	4,33 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	3,51 %	4,43 %
Class E, ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	3,55 %	4,43 %
75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Value Index <sup>3</sup>	8,68 %	5,81 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	1,71 %	3,90 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	0,82 %	2,95 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	0,76 %	2,94 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,45 %	1,60 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,35 %	1,60 %
75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate EUR Hedged/25 % MSCI World Value Index EUR Hedged <sup>3</sup>	6,62 %	4,44 % <sup>2</sup>

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

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

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Strategic Income Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 26. Juli 2016: 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate Index Hedged USD / 25 % MSCI All Country World Index; vom 27. Juli 2016 bis zum 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 Fonds 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:

### Rentenbereich:

- » Ein Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen in den USA zurückgingen.
- » Ein Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere positive Renditen verbuchten.
- » Ein Engagement in US-Barzinsen trug zur Wertentwicklung bei, da der 3-Monats-LIBOR positiv war.
- » Das Engagement in Schwellenmarktwährungen, darunter ein Engagement im brasilianischen Real und im russischen Rubel, belastete die Wertentwicklung, da diese Währungen an Wert einbüßten.
- » Ein Short-Engagement in der japanischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Kurve für japanische Zinsswaps („IRSW“) im ersten Quartal leicht zurückging.
- » Ein Short-Engagement in der britischen Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die Zinsen im Vereinigten Königreich fielen.

### Aktienbereich:

- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Immobiliensektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Fonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Informationstechnologiesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Fonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Finanzsektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Fonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Die Titelauswahl in den Sektoren Kommunikationsdienste, Nicht-Basiskonsumgüter, Gesundheitswesen und Industrie war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Fonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.
- » Das übergewichtete Engagement im Energiesektor war der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schlechter entwickelte als der Index.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 1998)	9,17 %	5,55 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2000)	9,17 %	5,65 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Jan. 1999)	8,80 %	5,02 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2000)	8,81 %	5,08 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2003)	8,63 %	4,29 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	8,16 %	4,31 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	8,20 %	4,16 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	8,97 %	4,92 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	9,02 %	7,15 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	7,84 %	2,94 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index	7,51 %	4,99 % <sup>2</sup>
<b>Auf CAD lautende Klassen</b>		
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Mai 2013)	8,83 %	3,29 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index (CAD Hedged)	7,30 %	3,26 %
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	7,14 %	2,08 %
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	6,81 %	1,73 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Sept. 2012)	6,24 %	0,65 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	5,76 %	1,91 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2003)	7,47 %	4,07 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	7,43 %	4,17 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2004)	7,12 %	3,66 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2009)	6,97 %	2,72 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	6,52 %	3,39 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	6,56 %	1,49 %
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	7,22 %	1,67 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	6,20 %	1,22 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	6,11 %	3,47 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2002)	0,14 %	3,62 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (EUR Unhedged) Index	(1,37 %)	3,13 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Mrz. 2010)	8,19 %	3,71 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	8,16 %	4,96 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	6,88 %	4,37 % <sup>2</sup>
<b>Auf HKD lautende Klassen</b>		
Class E HKD (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	7,64 %	2,63 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	7,68 %	2,59 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	6,98 %	3,45 %
<b>Auf ILS lautende Klassen</b>		
Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2010)	8,11 %	3,67 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (ILS Hedged) Index	6,47 %	3,65 %
<b>Auf SGD lautende Klassen</b>		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jan. 2011)	8,81 %	3,85 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	7,80 %	3,86 %
Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	7,35 %	4,17 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Total Return Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterträge erzielen. Der Fonds 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:

- » US-Zinsstrategien trugen zur relativen Wertentwicklung bei, vornehmlich durch eine Übergewichtung im ersten Quartal und eine Verteilung der Positionierung (Übergewichtung im mittleren Teil der Kurve und Untergewichtung an langen Ende) in der zweiten Jahreshälfte, als die Zinsen fielen und die Kurve steiler wurde.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Schuldtiteln mit Investment-Grade-Rating im ersten Quartal und Positionen in ausgewählten Investment-Grade-Schuldtiteln einschließlich Finanztiteln im zweiten bis vierten Quartal kamen der relativen Wertentwicklung zugute, da sich die Spreads im ersten Quartal weiteten und sich im zweiten bis vierten Quartal verengten.
- » Positionen in verbrieften Anlagen, insbesondere Non-Agency-MBS, im zweiten bis vierten Quartal trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein übergewichtetes Engagement in Agency-MBS, insbesondere eine Vorliebe für Kupons von 2 % und 2,5 %, kam der relativen Wertentwicklung zugute, da die Überschussrenditen für diese Wertpapiere positiv ausfielen.
- » Positionen in US Treasury Inflation-Protected Securities im ersten Quartal schmälerten die relative Wertentwicklung, da die Breakeven-Inflationsraten sanken.
- » Die Länderauswahl in der Eurozone, insbesondere eine Präferenz für Italien im ersten Quartal und zu Beginn des zweiten Quartals, beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.
- » Ein Short-Engagement in der britischen Duration war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen sanken.
- » Es gab keine weiteren wesentlichen Verlustbringer für diesen Fonds.

## Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	5,12 %	2,25 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	3,91 %	(1,12 %)
3 Month USD LIBOR Index	0,98 %	(1,40 %) <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	3,77 %	0,34 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Jun. 2015)	2,67 %	(0,74 %)
3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) Index	(0,44 %)	(0,35 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der 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 Fonds dargestellt), Schuldtitel, Aktienindizes, volatilitätsbezogene Instrumente (einschließlich u.a. Futures auf volatilitätsbezogene Indizes) und rohstoffbezogene Instrumente (wie im Verkaufsprospekt des Fonds dargestellt) investiert.

## Kommentare zum Fonds

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

- » Die Positionen in indischen und US-Aktien trugen zur Wertentwicklung bei.
- » Short-Positionen im brasilianischen Real und im neuseeländischen Dollar trugen zur Wertentwicklung bei.
- » Die Durationspositionierung in Brasilien schmälerte die Wertentwicklung.
- » Short-Positionen im japanischen Yen belasteten die Wertentwicklung.
- » Das Sicherheitenportfolio trug zur Rendite bei, was vor allem Zugewinnen bei kurzfristigen Unternehmensanleihen zu verdanken war.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2007)	5,98 %	6,55 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2016)	5,96 %	4,89 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 28. Aug. 2019)	5,85 %	4,22 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2019)	6,45 %	6,45 %
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	7,96 %	6,17 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der UK Corporate Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds 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:

- » Die Titelauswahl bei forderungsbesicherten Wertpapieren im Transportsektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte Emittenten eine Underperformance verzeichneten.
- » Die Übergewichtung des Mediensektors war der Wertentwicklung zuträglich, da der Mediensektor eine Outperformance erzielte.
- » Ein taktisches Engagement in Hochzinsanleihen belastete die Wertentwicklung, da die Anlageklasse im ersten Quartal einen Abverkauf verzeichnete.
- » Makrostrategien und insbesondere eine taktische Long-Position im GBP gegenüber einer Short-Position im USD belasteten die Wertentwicklung, da der USD im ersten Quartal einen Höhenflug erlebte.
- » Eine Untergewichtung der Wohnungsbaugesellschaften belastete die Wertentwicklung, da der Sektor im Laufe des Jahres eine überdurchschnittliche Performance zeigte.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	10,28 %	7,13 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Aug. 2008)	10,29 %	9,14 %
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index <sup>3</sup>	12,98 %	6,72 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ

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

<sup>3</sup> Die Benchmark-Wertentwicklung für den UK Long Term Corporate Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 31. 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 Fonds 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:

- » Makrostrategien und insbesondere eine Übergewichtung von Duration trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen während des Berichtszeitraums sanken.
- » Eine Übergewichtung des Banken- und Maklersektors trug zur Wertentwicklung bei, da diese Sektoren eine Outperformance erzielten.
- » Eine Untergewichtung des Telekommunikationssektors belastete die Wertentwicklung, da der Sektor eine Outperformance erzielte.
- » Eine Untergewichtung der Versorgungstitel belastete die Wertentwicklung, da der Sektor eine Outperformance erzielte.
- » Eine Untergewichtung des Versicherungssektors belastete die Wertentwicklung, da der Sektor eine Outperformance erzielte.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Mai 1998)	5,37 %	6,22 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	5,37 %	6,67 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 1999)	5,02 %	5,89 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 14. Jan. 1999)	5,04 %	5,86 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	4,42 %	5,29 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	4,39 %	5,41 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	5,21 %	7,60 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	—	4,23 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 11. Jan. 2012)	4,39 %	5,60 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,14 %	5,60 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 29. Jun. 2016)	5,93 %	7,63 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index <sup>3</sup>	6,07 %	6,35 % <sup>2</sup>
<b>Auf CHF lautende Klassen</b>		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2020)	—	19,30 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (CHF Hedged) <sup>3</sup>	—	21,62 %
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	3,19 %	5,93 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	3,20 %	5,24 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Feb. 2003)	2,84 %	5,89 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	2,28 %	4,25 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>	4,22 %	6,33 % <sup>2</sup>
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	3,29 %	6,51 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	3,25 %	5,28 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>	4,57 %	6,96 % <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ

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

<sup>3</sup> 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 Gesamterträge erzielen. Der Fonds 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 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:

- » Ein untergewichtetes Engagement im Energiesektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Die Titelauswahl im Gesundheitssektor kam der Wertentwicklung zugute, da die Positionen des Fonds im Gesundheitssektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor den Gesamtmarkt übertraf.
- » Die Titelauswahl im Energiesektor war der Wertentwicklung abträglich, da die Positionen des Fonds im Energiesektor schlechter abschnitten als der Markt insgesamt.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Automobilssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.
- » Ein untergewichtetes Engagement im Technologiesektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	7,60 %	6,09 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	7,68 %	6,10 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	6,69 %	7,37 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	6,73 %	9,52 %
Bloomberg Barclays U.S. Credit Index	9,35 %	5,67 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	5,63 %	3,60 %
Bloomberg Barclays U.S. Credit Index (EUR Hedged)	7,77 %	3,26 %
<b>Auf GBP lautende Klassen</b>		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 15. Sep. 2016)	6,00 %	4,55 %
Bloomberg Barclays U.S. Credit Index (GBP Hedged)	8,32 %	4,26 %

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US Investment Grade Corporate Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamterträge 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 Mobilfunksektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor besser abschnitt als der Investment-Grade-Markt insgesamt.
- » Ein übergewichtetes Engagement in Petroleos Mexicanos (PEMEX) nach dem Monat März 2020 trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Pharmazeutik schmälerte die Wertentwicklung, da der Sektor besser abschnitt als der Investment-Grade-Markt insgesamt.
- » Ein übergewichtetes Engagement im Bankensektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der Sektor schlechter abschnitt als der Investment-Grade-Markt insgesamt.
- » Ein übergewichtetes Engagement in Fluggesellschaften schmälerte die Wertentwicklung, da der Sektor schlechter abschnitt als der Investment-Grade-Markt insgesamt.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Eisenbahnen schmälerte die Wertentwicklung, da der Sektor besser abschnitt als der Investment-Grade-Markt insgesamt.

## Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2020 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
<b>Auf USD lautende Klassen</b>		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	2,25 %	1,99 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 11. Mrz. 2020)	—	1,99 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	1,83 %	1,63 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	1,84 %	1,60 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	2,05 %	2,26 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 07. Aug. 2014)	2,62 %	2,47 %
FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index	0,58 %	0,90 % <sup>2</sup>
<b>Auf EUR lautende Klassen</b>		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	0,99 %	0,40 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Jun. 2016)	0,61 %	(0,20 %)
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (EUR Hedged)	(0,58 %)	(0,86 %) <sup>2</sup>

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der US Short-Term Fund ist bestrebt, bei Kapitalerhaltung und täglicher Liquidität höchstmögliche laufende Erträge zu erzielen. Der Fonds 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 Fonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaften. Es wird nicht davon ausgegangen, dass sie länger als ein Jahr ist. Der Fonds 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:

- » Die Positionen in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da der Sektor insgesamt ein positives Carry erzielte und sich die Spreads während des Berichtszeitraums verengten.
- » Ein übergewichtetes Engagement in der kanadischen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen fielen.
- » Taktische Positionen in US-Zinsen trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da sich das übergewichtete Engagement als vorteilhaft erwies, als die Renditen auf US-Schatzpapiere sanken, und das untergewichtete Engagement günstig war, als die Renditen auf US-Schatzpapiere stiegen.
- » Ein Short-Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.
- » Positionen in US Treasury Inflation-Protected Securities schmälerten die relative Wertentwicklung, da die Breakeven-Inflationsraten während des Berichtszeitraums sanken.

## Beschreibungen der Vergleichsindizes

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
<b>1 Month CHF LIBOR Index</b>	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.
<b>1 Month Euribor Index</b>	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.
<b>1 Month GBP LIBOR Index</b>	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.
<b>1 Month NIBOR Rate Index</b>	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.
<b>1 Month SEK LIBOR Index</b>	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.
<b>1 Month USD LIBOR Index</b>	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.
<b>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).</b>	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 Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren 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 Gesamtkapitalisierung 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 verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>3 Month Euribor</b>	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.
<b>3 Month GBP LIBOR Index</b>	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.
<b>3 Month HIBOR Index</b>	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.
<b>3 Month SGD LIBOR Index</b>	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.
<b>3 Month USD LIBOR Index</b>	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
<b>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</b>	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend 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 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.
<b>50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged</b>	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 50 % JPMorgan EMBI Global Index/50 % 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 ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbrieft Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen und Eurobonds. 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.
<b>60 % MSCI All Country World Index/ 40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged)</b>	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 60 % MSCI All Country World Index/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.
<b>75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged)/25 % MSCI World Value Index</b>	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged)/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.
<b>Alerian MLP Index</b>	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.
<b>Bloomberg AusBond Bank Bills Index</b>	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.
<b>Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index</b>	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.
<b>Bloomberg Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index</b>	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
<b>Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index</b>	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.
<b>Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index</b>	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.
<b>Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)</b>	Bei dem 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 verbrieft Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade.
<b>Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)</b>	Bei dem 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 verbrieft Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. Es ist nicht möglich, direkt in einen nicht gemanagten Index anzulegen.
<b>Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index</b>	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 sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Der Index enthält auch Eurodollar- und Euro-Yen-Unternehmensanleihen, kanadische Staats-, Agency- und Unternehmenswertpapiere sowie auf USD lautende 144A-Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating.
<b>Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index</b>	Der Bloomberg Barclays MSCI Green Bond Index, USD Hedged bietet Anlegern ein objektives und robustes Maß für den globalen Markt für festverzinsliche Wertpapiere, die zur Finanzierung von Projekten mit direktem Umweltnutzen ausgegeben werden. Es wird eine unabhängige, analysegestützte Methodik verwendet, um indexfähige grüne Anleihen zu bewerten und sicherzustellen, dass sie die etablierten Green-Bond-Prinzipien einhalten, und um die Anleihen nach der umweltfreundlichen Verwendung ihrer Erlöse zu klassifizieren. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index</b>	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.
<b>Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index</b>	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 ein 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.
<b>Bloomberg Barclays U.S. Credit Index</b>	Bei dem 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.
<b>Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index</b>	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 Schuldtitle: Australien, Kanada, Frankreich, Schweden, das Vereinigte Königreich und die USA. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)</b>	Bei dem 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 von mindestens 1 Jahr und weniger als 5 Jahren misst. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>Bloomberg Commodity Index Total Return</b>	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
<b>Euro Short-Term Rate (ESTER)</b>	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.
<b>FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index</b>	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 US-Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>FTSE Euro Broad Investment- Grade Index</b>	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. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>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</b>	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 Unternehmensanleihen aus Industrieländern nach, die ein Rating von BB1 bis B3 aufweisen, basierend auf dem Durchschnitt aus Moody's, S&P und Fitch. 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 verbrieft 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.
<b>ICE BofAML 3 Month USD LIBOR Index Hedged BRL Denominated in USD</b>	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.
<b>ICE BofAML BB-B European Currency High Yield Constrained Index</b>	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.
<b>ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index</b>	Bei dem 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.
<b>ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (EUR Hedged)</b>	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.
<b>ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD</b>	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 enthält auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautende 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.
<b>ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index</b>	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
<b>ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index</b>	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 des Vereinigten Königreichs ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index</b>	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-Inlandmarkt 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.
<b>JPMorgan EMBI Global (EUR Unhedged)</b>	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 verbrieft Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. Vor dem 01. Dezember 2009 wurden die Indexrenditen von PIMCO abgesichert
<b>JPMorgan Asia Credit Index</b>	Der J.P. Morgan Asia Credit Index misst die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan. Der Index bietet einen Vergleichsindex für Anlagemöglichkeiten in lautenden festverzinslichen Instrumenten von staatlichen Emittenten, quasi-staatlichen Stellen und Unternehmen aus Asien (ohne Japan).
<b>JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)</b>	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.
<b>JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)</b>	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. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
<b>JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global</b>	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: Brady Bonds, Darlehen und Eurobonds.
<b>JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified</b>	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 verbrieft Forderungen, Darlehen, Euroanleihen und lokale Marktinstrumente; ausgeschlossen sind Emittenten, die der SRI-Berater nicht zulässt.
<b>JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)</b>	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.
<b>JP Morgan JACI Non-Investment Grade</b>	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.
<b>PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)</b>	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.
<b>S&amp;P 500 Index</b>	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 <sup>(1)</sup>	
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 799.818	\$ 207.178	\$ 148.688	\$ 34.275
Investmentfonds	71.640	14.115	16.097	3.494
Pensionsgeschäfte	1.302	448	1.299	284
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	3.644	896	381	133
Zahlungsmittel	5.029	0	13	70
Einlagen bei Kontrahenten	3.609	1.412	223	78
Forderungen aus Einkünften	12.886	3.010	1.741	374
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	1.640	198	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	4.072	100	288	43
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	588	233	180	77
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>902.588</b>	<b>229.032</b>	<b>169.108</b>	<b>38.828</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(2.294)	(1.222)	(249)	(237)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(5.643)	(336)	(1.064)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(198)	0	(16)	(30)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(305)	(56)	(61)	(48)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(1.523)	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(47)	(3)	(2)	0
Überziehungskredit	0	(1.035)	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(1.650)	0	0	0
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(11.660)</b>	<b>(2.652)</b>	<b>(1.392)</b>	<b>(315)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 890.928</b>	<b>\$ 226.380</b>	<b>\$ 167.716</b>	<b>\$ 38.513</b>

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

<sup>(1)</sup> Der Emerging Asia Bond Fund wurde am 28. August 2020 in Asia Strategic Interest Bond Fund umbenannt.

<sup>(2)</sup> Der PIMCO Climate Bond Fund wurde am 23. September 2020 aufgelegt.

PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund <sup>(2)</sup>		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2019
\$ 9.025.916	\$ 7.306.588	\$ 88.461	\$ 509.577	\$ 753.737	\$ 130.883	\$ 133.502	
777.569	773.196	0	18	24.077	8.981	12.948	
139.444	989.100	12.100	10.072	29.088	495	848	
0	0	0	0	0	0	0	
90.088	97.726	1.083	14.855	12.529	2.329	2.609	
1.690	6.488	976	1.805	1.583	225	157	
119.668	169.072	271	5.718	7.031	3.615	2.648	
76.842	70.013	639	1.332	2.122	1.219	1.299	
95.452	234.915	0	59	54	532	17	
0	0	0	89.032	143.515	2.394	3.641	
13.025	15.298	0	754	738	33	128	
3.175	1.203	0	0	19	249	0	
0	0	0	0	0	0	0	
10.342.869	9.663.599	103.530	633.222	974.493	150.955	157.797	
(102.466)	(109.777)	(640)	(7.441)	(9.352)	(677)	(1.130)	
0	0	0	0	0	(519)	0	
0	(404.020)	(207)	(297)	(40)	(511)	(1.195)	
0	0	0	(136.640)	(226.956)	(3.236)	(4.954)	
(10.448)	(8.528)	0	(245)	(281)	(17)	(150)	
(6.175)	(6.138)	(38)	(261)	(413)	(126)	(144)	
(2.130.472)	(1.158.210)	0	(153.550)	(163.961)	0	0	
0	0	0	0	0	0	0	
(696)	(670)	0	(3)	(4)	(7)	(7)	
0	0	0	0	0	0	0	
(1.655)	0	0	0	0	0	0	
0	0	(16)	(214)	0	0	(10)	
(132.635)	(31.773)	(760)	(9.462)	(9.085)	(1.350)	(860)	
0	0	0	0	0	0	0	
(2.384.547)	(1.719.116)	(1.661)	(308.113)	(410.092)	(6.443)	(8.450)	
\$ 7.958.322	\$ 7.944.483	\$ 101.869	\$ 325.109	\$ 564.401	\$ 144.512	\$ 149.347	

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 16.283.835	\$ 9.820.858	\$ 1.228.715	\$ 1.095.948
Investmentfonds	1.782.474	1.193.986	146.844	125.162
Pensionsgeschäfte	46.261	2.731.635	39.170	135.908
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	421.412	246.139	49.160	36.554
Zahlungsmittel	48.380	6.102	9.131	1.592
Einlagen bei Kontrahenten	515.061	254.903	52.976	31.267
Forderungen aus Einkünften	163.321	95.630	14.871	12.030
Forderungen aus verkauften Anlagen	1.261	5.773	63	633
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	1.431.037	2.197.310	147.221	147.066
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	42.168	43.232	281	1.170
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	0	306	0
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>20.735.210</b>	<b>16.595.568</b>	<b>1.688.738</b>	<b>1.587.330</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(136.455)	(97.919)	(24.375)	(12.657)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	(1.088.744)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(12.455)	(1.303.842)	(582)	(52.699)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(1.427.406)	(1.643.970)	(146.906)	(234.610)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(43.845)	(15.483)	(482)	(204)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(16.400)	(10.852)	(1.112)	(1.010)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(68.836)	(31.018)	(989)	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(328)	(551)	(24)	(192)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(8.806)	0	(2.245)	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(98.872)	(34.299)	0	(2.024)
Einlagen von Kontrahenten	(279.946)	(94.303)	(25.092)	(13.997)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(2.093.349)</b>	<b>(4.320.981)</b>	<b>(201.807)</b>	<b>(317.393)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 18.641.861</b>	<b>\$ 12.274.587</b>	<b>\$ 1.486.931</b>	<b>\$ 1.269.937</b>

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 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
\$ 3.984.661	\$ 4.440.875	€ 4.042.122	€ 1.410.598	\$ 3.172.822	\$ 3.592.844	\$ 4.949.737	\$ 4.039.102
310.368	381.672	688.135	147.132	204.721	189.274	381.348	242.079
49.813	221.289	271.399	11.570	0	0	3.386	0
0	0	0	0	0	0	0	0
69.574	95.782	64.096	28.105	298.287	180.714	58.738	66.834
9.369	4.325	5.885	84.812	12.592	17.814	1.468	1.664
59.256	64.641	66.364	39.373	20.848	24.772	20.624	14.517
18.791	21.149	3.080	2.959	54.506	53.172	61.707	57.764
131	13	0	0	45.650	105.428	0	0
1.096.877	1.364.974	0	0	0	256.337	40.878	357.268
5.870	6.522	59.522	4.175	4.822	22.097	30.896	6.942
48.533	0	8.434	4.673	0	0	5.864	7.530
0	0	0	0	48	0	0	0
5.653.243	6.601.242	5.209.037	1.733.397	3.814.296	4.442.452	5.554.646	4.793.700
(76.674)	(39.252)	(22.032)	(15.402)	(193.468)	(105.273)	(19.870)	(26.156)
0	0	0	0	0	0	0	(1.069)
(6.583)	(100.004)	(662)	(87.388)	(170.958)	(110.536)	(1.483)	0
(2.106.480)	(2.520.683)	0	0	0	(629.240)	(68.678)	(604.478)
(1.479)	(2.044)	(9.205)	(2.758)	(709)	(321)	(7.861)	(21.467)
(2.537)	(3.130)	(5.035)	(1.707)	(2.206)	(2.076)	(3.937)	(2.989)
(205.836)	(4.807)	0	(8.645)	(470.467)	(740.768)	(138.092)	(94.853)
0	0	0	0	0	0	0	0
(192)	(215)	(19)	(4)	(936)	(533)	(18)	(239)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.427)	0	0	0	0	0	(672)	0
0	(1.720)	0	0	(45.161)	(31.714)	0	0
(47.175)	(41.116)	(43.158)	(12.720)	(81.107)	(49.991)	(51.020)	(40.727)
0	0	0	0	0	0	0	0
(2.448.383)	(2.712.971)	(80.111)	(128.624)	(965.012)	(1.670.452)	(291.631)	(791.978)
\$ 3.204.860	\$ 3.888.271	€ 5.128.926	€ 1.604.773	\$ 2.849.284	\$ 2.772.000	\$ 5.263.015	\$ 4.001.722

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund	
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.413.297	\$ 734.931	\$ 262.961	\$ 211.797
Investmentfonds	0	0	821	8.495
Pensionsgeschäfte	138.321	56.153	921	1.022
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	17.638	11.493	5.453	3.379
Zahlungsmittel	361	265	84	926
Einlagen bei Kontrahenten	2.384	3.375	658	729
Forderungen aus Einkünften	16.995	10.282	3.196	2.608
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	4.104	70.821	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	3.547	1.133	54	271
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	317	721	744	278
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>1.596.964</b>	<b>889.174</b>	<b>274.892</b>	<b>229.505</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(4.724)	(3.971)	(1.805)	(975)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(608)	0	0	(800)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(7.531)	(119.234)	0	0
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(247)	(17)	(147)	(1)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(1.073)	(542)	(279)	(242)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(122.795)	(33.571)	(4.527)	(1.162)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	(2.338)	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(1)	(38)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(39)	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(18.489)	(7.681)	(4.560)	(1.893)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(155.507)</b>	<b>(165.054)</b>	<b>(13.656)</b>	<b>(5.073)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 1.441.457</b>	<b>\$ 724.120</b>	<b>\$ 261.236</b>	<b>\$ 224.432</b>

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

## Finanzstatus (Forts.)

PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
\$ 228.967	\$ 181.218	\$ 22.934	\$ 65.544	€ 3.233.815	€ 3.003.468	€ 1.080.854	€ 1.025.580
12.673	14.287	3.168	6.623	316.864	230.462	19.350	0
1.565	902	7.136	178	147.655	18.200	16.413	2.166
0	0	0	501	0	0	0	0
14.708	5.603	2.073	2.354	27.019	30.361	5.942	5.741
2.447	232	0	70	2.874	3.510	7.545	995
3.259	6.745	211	373	33.030	27.655	21.895	20.377
3.082	1.530	159	680	9.707	10.548	8.597	7.605
1.000	7.200	1.500	0	46	145	12	12
38.617	68.540	0	0	683.449	260.950	58.681	102.325
105	44	5	16	4.099	2.003	416	581
0	0	375	201	0	11.427	4.522	2.482
0	0	0	0	0	0	0	0
306.423	286.301	37.561	76.540	4.458.558	3.598.729	1.2	1.167.864
(8.990)	(2.696)	(1.751)	(1.317)	(11.468)	(29.937)	(3.779)	(5.950)
0	0	0	0	0	0	0	0
(3.224)	(4.607)	(2.223)	0	(18.385)	0	(6.091)	0
(61.775)	(100.232)	0	0	(1.161.584)	(535.292)	(58.534)	(195.335)
0	(15)	(104)	0	(1.679)	(1.846)	(318)	(987)
(155)	(104)	(42)	(73)	(1.392)	(1.306)	(453)	(420)
(3.770)	(19.490)	0	0	0	0	0	(2.129)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	0	0	0	(14)	(19)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(3.059)	(1.141)	0	0	(4.268)	0	0	0
(5.130)	(2.510)	(870)	(861)	(16.313)	(16.879)	(4.994)	(1.598)
(10)	0	0	0	0	0	0	0
(86.114)	(130.795)	(4.990)	(2.251)	(1.215.103)	(585.279)	(74.169)	(206.419)
\$ 220.309	\$ 155.506	\$ 32.571	\$ 74.289	€ 3.243.455	€ 3.013.450	€ 1.150.058	€ 961.445

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund	
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	€ 3.414.315	€ 3.146.858	€ 187.453	€ 169.614
Investmentfonds	127.470	306.749	10.189	3.000
Pensionsgeschäfte	2.872	4.241	168	0
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	36.039	26.779	1.692	1.237
Zahlungsmittel	14.065	10.566	9.251	2.008
Einlagen bei Kontrahenten	63.724	46.970	3.062	2.184
Forderungen aus Einkünften	24.723	22.425	960	1.136
Forderungen aus verkauften Anlagen	41.013	1.553	7	13
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	643.118	697.345	43.373	11.094
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	5.807	26.791	1	0
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	0	0	629
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>4.373.146</b>	<b>4.290.277</b>	<b>256.156</b>	<b>190.915</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(4.722)	(8.061)	(407)	(2.443)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	(143.243)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(17.166)	(49.741)	(5.637)	(1.301)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(1.122.848)	(889.196)	(64.278)	(22.182)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(3.738)	(1.774)	0	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(2.903)	(2.813)	(66)	(63)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(2.600)	(15.286)	(2.169)	(2.328)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(40)	(63)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(6.719)	(2.539)	(748)	0
Einlagen von Kontrahenten	(29.543)	(12.449)	(390)	(120)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(1.190.279)</b>	<b>(1.125.165)</b>	<b>(73.695)</b>	<b>(28.437)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>€ 3.182.867</b>	<b>€ 3.165.112</b>	<b>€ 182.461</b>	<b>€ 162.478</b>

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

<sup>(3)</sup> Der PIMCO European High Yield Bond Fund wurde am 31. Januar 2020 aufgelegt.

<sup>(4)</sup> Der Euro Low Duration Fund wurde am 17. Januar 2020 in PIMCO European Short-Term Opportunities Fund umbenannt.

Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund <sup>(3)</sup>		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund <sup>(4)</sup>		Global Advantage Fund	
Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	
€ 739.079	€ 697.702	€ 133.203	€ 359.007	€ 330.193	\$ 766.011	\$ 690.773	
0	0	10.121	34.027	32.873	19.995	21.516	
62.900	287	0	6.767	219	1.298	2.818	
0	1.517	0	0	892	0	0	
5.908	4.274	265	3.095	1.623	18.435	26.810	
2.436	11.891	20.473	786	1.939	2.132	2.638	
266	898	570	3.362	1.158	7.959	7.335	
4.843	3.053	1.321	1.251	2.128	3.290	3.396	
0	0	0	1.408	0	8.457	18.184	
0	0	0	81.579	0	445.605	331.613	
44.259	3.838	0	1.440	19	80	113	
219	1.139	0	0	73	1.094	3.883	
0	0	0	0	0	0	0	
859.910	724.599	165.953	492.722	371.117	1.274.356	1.109.079	
(3.904)	(2.936)	(48)	(3.725)	(1.068)	(10.701)	(21.216)	
0	0	0	0	0	(44.384)	0	
(42.651)	(9.410)	(3.374)	(1.772)	(600)	(15.685)	(18.367)	
0	0	0	(133.809)	0	(609.061)	(491.691)	
(691)	(844)	0	(10)	0	(157)	0	
(269)	(443)	0	(98)	(143)	(314)	(298)	
(1.583)	0	0	(1.020)	(16.062)	(47.469)	(81.574)	
0	0	0	0	0	(12.495)	(17.611)	
0	0	0	0	0	(78)	(86)	
0	0	0	0	0	0	0	
0	0	0	0	0	0	0	
0	0	(20)	(1.054)	0	0	0	
(3.274)	(940)	(450)	(485)	(9)	(9.728)	(10.738)	
0	0	0	0	0	0	0	
(52.372)	(14.573)	(3.892)	(141.973)	(17.882)	(750.072)	(641.581)	
€ 807.538	€ 710.026	€ 162.061	€ 350.749	€ 353.235	\$ 524.284	\$ 467.498	

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global Advantage Real Return Fund <sup>(5)</sup>		Global Bond Fund	
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 55.191	\$ 23.548.213	\$ 19.178.565
Investmentfonds	0	1.407	1.349.256	1.448.325
Pensionsgeschäfte	0	383	19.238	147.907
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	28.364
Finanzderivate	0	2.754	394.868	357.902
Zahlungsmittel	32	0	27.106	46.884
Einlagen bei Kontrahenten	0	1.174	223.417	232.357
Forderungen aus Einkünften	0	185	95.785	86.108
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	832	270.079	343.350
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	13.481	10.837.484	3.451.519
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	0	0	55.993	12.426
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	1	0	0	38.797
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>33</b>	<b>75.407</b>	<b>36.821.439</b>	<b>25.372.504</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	0	(1.148)	(266.336)	(330.860)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	(1.765.552)	(68.108)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	(462)	(400.814)	(338.712)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	(18.347)	(16.129.756)	(8.644.600)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(33)	(253)	(63.436)	(55.903)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	0	(35)	(8.526)	(7.580)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	(17.368)	(1.587.112)	(768.374)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	(88.111)	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	(7)	(235)	(292)
Überziehungskredit	0	(8)	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(1.477)	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	(1.254)	(48.386)	0
Einlagen von Kontrahenten	0	(290)	(159.389)	(157.500)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(33)</b>	<b>(39.172)</b>	<b>(20.519.130)</b>	<b>(10.371.929)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 36.235</b>	<b>\$ 16.302.309</b>	<b>\$ 15.000.575</b>

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

<sup>(5)</sup> Der Global Advantage Real Return Fund wurde am 31. Januar 2020 geschlossen.

Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund		PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		Global High Yield Bond Fund	
Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
\$ 2.052.641	\$ 967.152	\$ 1.449.661	\$ 1.558.442	\$ 421.912	\$ 583.934	\$ 4.866.996	\$ 3.742.031
6.629	6.049	5.862	5.394	230.921	245.043	471.018	423.105
50.741	25.880	1.069	5.606	981	0	0	233.300
0	0	0	0	0	0	0	0
46.890	27.830	15.382	17.528	27.605	31.267	100.388	55.548
3.492	2.651	3.511	5.580	8.681	5.415	1.821	2.128
18.942	7.082	23.267	20.528	39.252	16.076	27.005	11.613
7.646	4.870	6.879	8.020	2.020	1.372	62.695	51.103
34.716	19.485	15.641	23.794	2.218	15.136	51	1.770
943.062	280.137	751.400	361.392	209	394.913	0	0
4.649	595	533	587	408	216	19.078	13.536
0	1.449	2.330	7.883	0	3.887	0	0
15	0	0	0	0	0	0	0
3.169.423	1.343.180	2.275.535	2.014.754	734.207	1.297.259	5.549.052	4.534.134
(22.497)	(12.250)	(22.358)	(30.722)	(8.356)	(19.712)	(30.292)	(9.342)
(123.927)	(5.957)	(101.358)	0	0	(165.996)	0	0
(44.562)	(19.632)	(23.116)	(22.437)	(519)	(3.566)	(7.951)	(109.982)
(1.403.943)	(491.360)	(1.040.528)	(669.400)	(313)	(229.160)	0	0
(1.925)	(103)	(722)	(66.827)	(608)	(513)	(11.462)	(8.913)
(642)	(330)	(420)	(582)	(764)	(837)	(3.087)	(2.531)
(25.562)	(34.081)	(145.327)	(122.790)	0	(33.077)	(7.478)	(13.703)
(5.461)	0	(7.510)	(6.110)	0	0	0	(13.909)
(5)	0	(13)	(19)	(3)	(9)	(155)	(146)
0	0	0	0	0	0	0	0
(231)	0	0	0	(55)	0	(8.379)	0
(2.111)	0	0	0	(7.733)	0	(2.781)	(4.658)
(28.963)	(17.033)	(4.203)	(3.569)	(13.426)	(30.035)	(73.924)	(29.642)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.659.829)	(580.746)	(1.345.555)	(922.456)	(31.777)	(482.905)	(145.509)	(192.826)
\$ 1.509.594	\$ 762.434	\$ 929.980	\$ 1.092.298	\$ 702.430	\$ 814.354	\$ 5.403.543	\$ 4.341.308

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund	
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 27.439.093	\$ 24.658.992	\$ 366.476	\$ 88.325
Investmentfonds	2.719.020	971.503	0	0
Pensionsgeschäfte	30.802	448.225	111	1.600
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	491.396	404.334	5.472	1.352
Zahlungsmittel	75.541	35.430	637	0
Einlagen bei Kontrahenten	357.452	373.208	3.488	1.540
Forderungen aus Einkünften	218.831	204.968	1.896	644
Forderungen aus verkauften Anlagen	997	9.381	0	146
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	1.194.059	2.743.937	21.087	6.721
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	37.411	48.180	1.578	14
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	28.559	926	254
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>32.564.602</b>	<b>29.926.717</b>	<b>401.671</b>	<b>100.596</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(180.805)	(208.825)	(3.824)	(751)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(13.586)	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(19.302)	(30.731)	0	(230)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(3.623.792)	(5.659.469)	(42.892)	(13.423)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(34.066)	(38.885)	(95)	(1)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(14.489)	(11.402)	(157)	(34)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(69.409)	(1.306.075)	(1.276)	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(66.740)	(509.422)	(18.658)	(1.277)
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(1.009)	(813)	(18)	0
Überziehungskredit	0	0	0	(220)
Zu zahlende Dividende	(33.718)	0	(50)	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(15.140)	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(314.376)	(222.699)	(2.683)	(860)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	(8)	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(4.386.432)</b>	<b>(7.988.321)</b>	<b>(69.661)</b>	<b>(16.796)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 28.178.170</b>	<b>\$ 21.938.396</b>	<b>\$ 332.010</b>	<b>\$ 83.800</b>

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 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
\$ 2.936.209	\$ 2.348.462	\$ 1.119.289	\$ 1.329.557	\$ 3.634.557	\$ 2.725.490	\$ 94.258.066	\$ 97.569.130
113.341	194.207	41.757	1.023	43.486	15.104	2.527.206	1.769.800
20.967	14.117	1.551	1.884	906	1.277	14.587	204.048
0	0	0	0	0	0	0	0
65.981	54.118	19.143	26.037	46.975	37.308	2.511.526	1.633.764
4.753	4.322	4.568	5.171	5.835	6.639	74.966	124.928
27.726	36.665	9.522	11.022	29.865	30.834	1.445.737	991.379
11.305	9.466	2.037	2.842	5.620	6.650	459.399	476.315
29	1.901	73	88	389	396	82.733	546.701
554.369	645.723	179.347	164.060	432.340	406.309	24.805.267	14.719.707
604	2.836	2.475	944	11.313	2.923	182.247	252.147
25.254	6.439	0	1.955	1.557	8.259	0	127.101
0	0	0	0	0	0	0	0
3.760.538	3.318.256	1.379.762	1.544.583	4.212.843	3.241.189	126.361.734	118.415.020
(44.595)	(22.451)	(13.857)	(16.282)	(50.731)	(50.769)	(603.512)	(1.153.389)
0	0	(1.840)	0	0	0	(318.991)	(670.959)
(33.093)	(1.094)	0	0	0	0	(234.747)	(437.546)
(990.426)	(1.226.302)	(284.186)	(289.367)	(784.177)	(663.781)	(43.288.331)	(31.706.849)
(171)	(298)	(691)	(710)	(2.544)	(6.496)	(105.878)	(115.074)
(1.045)	(756)	(374)	(489)	(1.388)	(1.039)	(56.071)	(62.254)
0	(31.167)	0	(231.159)	(769.368)	(667.025)	(8.273.723)	(2.382.273)
0	0	(279.761)	0	(1.770)	0	(44.153)	(172.189)
(4)	(6)	(1)	(1)	(58)	(46)	(5.749)	(7.764)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.905)	0	(68)	0	0	0	(1.786)	0
0	0	(768)	0	0	0	(952.576)	0
(44.698)	(24.967)	(10.345)	(9.106)	(24.745)	(20.725)	(1.200.906)	(626.264)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.115.937)	(1.307.041)	(591.891)	(547.114)	(1.634.781)	(1.409.881)	(55.086.423)	(37.334.561)
\$ 2.644.601	\$ 2.011.215	\$ 787.871	\$ 997.469	\$ 2.578.062	\$ 1.831.308	\$ 71.275.311	\$ 81.080.459

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Inflation Strategy Fund		Low Average Duration Fund	
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 94.181	\$ 94.777	\$ 1.204.487	\$ 1.199.063
Investmentfonds	5.897	5.051	116.497	116.884
Pensionsgeschäfte	571	584	8.275	52.556
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	3.307
Finanzderivate	3.413	3.038	4.387	8.061
Zahlungsmittel	310	256	965	8.521
Einlagen bei Kontrahenten	1.439	1.453	6.360	10.122
Forderungen aus Einkünften	177	228	3.128	4.665
Forderungen aus verkauften Anlagen	42	51	1	2.488
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	32.011	24.129	738.561	405.773
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	67	9	966	6.123
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	0	315	2.191
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>138.108</b>	<b>129.576</b>	<b>2.083.942</b>	<b>1.819.754</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(1.791)	(1.477)	(6.199)	(8.595)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	(236.203)	(156.316)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(60)	(681)	(5.827)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(48.931)	(38.506)	(647.980)	(290.881)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(3)	(1)	(717)	(6.030)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(64)	(66)	(550)	(516)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(15.360)	(17.058)	0	(156.061)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	(5)	(18)	(261)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(33)	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(1.807)	(1.477)	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(60)	(290)	(3.002)	(11.174)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(68.076)</b>	<b>(59.561)</b>	<b>(900.529)</b>	<b>(629.834)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 70.032</b>	<b>\$ 70.015</b>	<b>\$ 1.183.413</b>	<b>\$ 1.189.920</b>

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

Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		Mortgage Opportunities Fund	
Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
\$ 623.281	\$ 540.651	\$ 1.264.313	\$ 558.414	\$ 79.241	\$ 214.612	\$ 3.629.137	\$ 2.857.658
43.112	32.319	93.313	46.349	325	22.045	94.493	164.187
2.680	12.600	27.569	55.829	0	0	1.590	50.440
0	0	0	0	0	0	0	0
13.218	10.861	27.557	12.430	320	4.238	48.504	48.342
1.177	570	1.381	0	835	0	1.548	7.029
3.285	4.191	26.639	4.560	440	0	13.408	20.947
4.255	3.905	5.384	2.588	30	80	4.294	4.621
1	10	130	344	685	1.711	7.237	4.171
67.252	56.084	658.051	162.226	0	0	3.436.975	2.206.965
3.184	216	17	15	43	24	310	1.418
491	184	8.392	3.322	0	0	950	0
0	0	0	0	0	0	0	0
761.936	661.591	2.112.746	846.077	81.919	242.710	7.238.446	5.365.778
(4.578)	(2.917)	(20.924)	(6.672)	(3.448)	(1.486)	(27.245)	(24.908)
(2.489)	0	0	0	0	0	(199.988)	(262.313)
0	(1.294)	(326)	(1.435)	(170)	0	(62.712)	(21.372)
(111.999)	(88.118)	(1.102.965)	(349.285)	0	0	(4.928.820)	(2.878.763)
(414)	(262)	0	0	(597)	(181)	(232)	(10.174)
(275)	(219)	(445)	(222)	(70)	(185)	(884)	(897)
0	(39.385)	0	0	0	0	0	(469.323)
0	(11.922)	0	0	0	0	(2.224)	0
(1)	0	(15)	0	0	(2)	(25)	(16)
0	0	0	(1.907)	0	(582)	0	0
0	0	0	0	(3)	0	(32)	0
0	0	0	0	0	0	0	(7.274)
(9.661)	(7.140)	(27.408)	(7.731)	0	(2.103)	(39.277)	(15.627)
0	0	(24)	(20)	0	0	0	0
(129.417)	(151.257)	(1.152.107)	(367.272)	(4.288)	(4.539)	(5.261.439)	(3.690.667)
\$ 632.519	\$ 510.334	\$ 960.639	\$ 478.805	\$ 77.631	\$ 238.171	\$ 1.977.007	\$ 1.675.111

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO RAE Emerging Markets Fund <sup>(6)</sup>		PIMCO RAE Europe Fund <sup>(7)</sup>	
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 114.587	€ 0	€ 23.378
Investmentfonds	0	0	0	0
Pensionsgeschäfte	0	0	0	0
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	0	1	0	0
Zahlungsmittel	51	365	0	113
Einlagen bei Kontrahenten	0	0	0	0
Forderungen aus Einkünften	13	415	0	23
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	155	0	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	0	39	0	0
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	0	0	0
Sonstige Aktiva	2	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>67</b>	<b>115.562</b>	<b>0</b>	<b>23.514</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	0	0	0	0
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(66)	(77)	0	(33)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	0	(50)	0	(11)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	(205)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	0	0	0	0
Sonstige Verbindlichkeiten	(1)	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(67)</b>	<b>(332)</b>	<b>0</b>	<b>(44)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 115.230</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 23.470</b>

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

<sup>(6)</sup> Der PIMCO RAE Emerging Markets Fund wurde am 23. November 2020 geschlossen. Nähere Einzelheiten zu den am Ende des Geschäftsjahres gehaltenen übertragbaren Wertpapieren sind Erläuterung 2 und Erläuterung 16 zu entnehmen.

<sup>(7)</sup> Der PIMCO RAE Europe Fund wurde am 23. November 2020 geschlossen.

<sup>(8)</sup> Der PIMCO RAE Global Developed Fund wurde am 23. November 2020 geschlossen.

<sup>(9)</sup> Der PIMCO RAE US Fund wurde am 23. November 2020 geschlossen.

<sup>(10)</sup> Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund wurde am 20. November 2020 geschlossen.

<sup>(11)</sup> Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund terminated wurde am 20. November 2020 geschlossen.

PIMCO RAE Global Developed Fund <sup>(8)</sup>		PIMCO RAE US Fund <sup>(9)</sup>		PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund <sup>(10)</sup>		PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund <sup>(11)</sup>	
Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
\$ 0	\$ 55.358	\$ 0	\$ 14.122	\$ 0	\$ 11.245	€ 0	€ 5.111
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	0	0	0	0	0	0	0
0	411	0	54	6	94	0	9
0	0	0	0	0	0	0	0
0	59	0	13	1	49	1	7
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	1	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
2	0	8	0	0	0	0	0
2	55.829	8	14.189	7	11.388	1	5.127
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	0	0	0	0	0	0	0
0	(6)	0	0	(6)	0	0	0
0	(53)	0	(6)	0	(5)	0	(2)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	(1)	0	0	0	(36)	0	0
(2)	0	(8)	0	0	0	(1)	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
0	0	0	0	(1)	0	0	0
(2)	(60)	(8)	(6)	(7)	(41)	(1)	(2)
\$ 0	\$ 55.769	\$ 0	\$ 14.183	\$ 0	\$ 11.347	€ 0	€ 5.125

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund <sup>(12)</sup>		PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund <sup>(13)</sup>	
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.646	\$ 0	\$ 3.404
Investmentfonds	0	0	0	0
Pensionsgeschäfte	0	0	0	0
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	0	0	0	0
Zahlungsmittel	0	47	2	17
Einlagen bei Kontrahenten	0	0	0	0
Forderungen aus Einkünften	0	7	0	4
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	0	0	0	0
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	0	0	0
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>0</b>	<b>5.700</b>	<b>2</b>	<b>3.425</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	0	0	0	0
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	(32)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	0	(2)	0	(1)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	0	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	0	0	0	0
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	(2)	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>0</b>	<b>(34)</b>	<b>(2)</b>	<b>(1)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 5.666</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 3.424</b>

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

<sup>(12)</sup> Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund wurde am 20. November 2020 geschlossen.

<sup>(13)</sup> Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund wurde am 20. November 2020 geschlossen.

StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund	
Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
\$ 2.725.827	\$ 2.291.240	\$ 5.839	\$ 5.886	\$ 1.262.487	\$ 1.289.088	\$ 6.926.141	\$ 7.381.456
317.877	296.063	804	503	4.768	84.639	625.562	500.721
928.169	1.110.926	3.039	969	528	3.161	136.163	94.132
0	8.820	0	0	0	0	0	0
180.556	100.814	145	371	32.307	26.856	75.731	73.282
1.225	2.263	112	2	4.985	4.368	9.305	5.656
87.471	47.096	55	73	11.904	9.636	72.128	78.835
4.322	8.911	16	17	5.803	4.873	28.989	29.835
71.942	35.798	598	0	401	710	1	14.426
286.520	512.549	1.553	2.882	387.767	299.612	2.976.253	2.286.123
13.695	2.641	0	3	1.235	2.709	10.639	3.791
0	0	20	3	11.635	4.588	3.403	10.098
0	0	0	0	0	0	0	0
4.617.604	4.417.121	12.181	10.709	1.723.820	1.730.240	10.864.315	10.478.355
(20.180)	(26.231)	(83)	(17)	(23.836)	(14.718)	(53.882)	(74.093)
0	(222.667)	0	(148)	0	0	(34.311)	(304.023)
(400.000)	(500.000)	0	0	(203)	(1.688)	(88.180)	(528)
(431.918)	(505.016)	(3.072)	(4.274)	(643.263)	(526.037)	(4.196.335)	(3.858.903)
(14.921)	(22.505)	(97)	0	(1.594)	(1.770)	(13.981)	(4.533)
(1.727)	(1.668)	(5)	(3)	(995)	(1.191)	(4.233)	(3.462)
0	(3.313)	0	0	(52.542)	0	0	(1.063.175)
0	0	0	0	(2.866)	0	0	0
(6)	(2)	0	0	(26)	(42)	(309)	(277)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	(199)	0
(23.258)	(3.550)	0	0	0	0	0	0
(186.761)	(122.318)	(507)	(290)	(23.830)	(14.873)	(48.832)	(29.973)
0	0	0	0	(1)	(1)	0	0
(1.078.771)	(1.407.270)	(3.764)	(4.732)	(749.156)	(560.320)	(4.440.262)	(5.338.967)
\$ 3.538.833	\$ 3.009.851	\$ 8.417	\$ 5.977	\$ 974.664	\$ 1.169.920	\$ 6.424.053	\$ 5.139.388

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund	
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Aktiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 26.952	\$ 16.984	£ 712.455	£ 476.700
Investmentfonds	3.877	2.560	38.188	54.664
Pensionsgeschäfte	13.645	5.141	46.150	27.875
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	5.012	4.694	4.631	4.438
Zahlungsmittel	363	332	2.811	4.866
Einlagen bei Kontrahenten	1.327	1.250	11.310	13.270
Forderungen aus Einkünften	24	54	7.478	5.151
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	11	49	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	0	3	316	408
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	0	0	2.853	1.212
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
<b>Summe Aktiva</b>	<b>51.200</b>	<b>31.029</b>	<b>826.241</b>	<b>588.584</b>
<b>Passiva:</b>				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(2.093)	(3.532)	(3.041)	(2.686)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(31)	0	(2.038)	(786)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(12)	(93)	(257)	(94)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(53)	(40)	(256)	(147)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	(50.468)	(26.669)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	(1)	(2)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(3.105)	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(650)	(816)	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(1.140)	(831)	(2.716)	(1.132)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(3.979)</b>	<b>(5.312)</b>	<b>(61.882)</b>	<b>(31.516)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 47.221</b>	<b>\$ 25.717</b>	<b>£ 764.359</b>	<b>£ 557.068</b>

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

UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund									
Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum								
31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019								
£	409.471	£	483.964	\$	3.573.957	\$	2.518.163	\$	1.261.305	\$	834.512	\$	3.068.243	\$	2.537.382
	6.808		4.929		393.709		276.321		13.289		22.513		378.292		212.140
	5.260		1.319		30.800		21.768		2.887		51.949		213.234		1.457
	0		0		0		0		0		0		0		6.715
	3.448		3.503		27.563		15.305		21.022		17.150		11.282		5.652
	2.121		5.681		420		796		1.487		1.832		2.444		1.887
	8.610		9.891		23.823		5.774		9.334		14.050		26.464		15.192
	4.029		5.432		51.464		40.402		10.309		7.135		8.452		12.418
	0		0		1.597		528		49		97		984		371
	0		0		0		0		141.154		101.750		0		0
	15		3		20.430		6.362		2.704		457		5.501		4.955
	0		1.248		0		0		1.077		0		5.236		13.437
	0		0		123		90		0		0		0		0
	439.762		515.970		4.123.886		2.885.509		1.464.617		1.051.445		3.720.132		2.811.606
	(410)		(2.431)		(2.025)		(503)		(2.552)		(1.554)		(16.685)		(19.228)
	0		0		0		0		0		0		0		0
	(892)		(170)		(16.243)		(2.222)		(2.422)		(1.841)		(35.639)		(22)
	0		0		0		0		(213.835)		(189.428)		0		0
	0		0		(7.824)		(44.254)		(1.382)		(87)		(4.409)		(1.022)
	(138)		(158)		(2.184)		(1.570)		(526)		(326)		(1.174)		(786)
	(70.444)		(105.361)		(15.262)		(9.294)		0		0		0		(426.129)
	0		0		0		(18.876)		(42.596)		(51.383)		0		0
	(2)		(4)		(135)		(109)		0		0		(6)		(13)
	0		0		0		0		0		0		0		0
	(117)		0		(108)		0		(3.593)		0		0		0
	(694)		0		(2.666)		(1.433)		0		(2.190)		0		0
	(2.434)		(902)		(22.512)		(9.132)		(17.563)		(8.211)		(8.034)		(3.364)
	0		0		0		0		0		(5)		0		0
	(75.131)		(109.026)		(68.959)		(87.393)		(284.469)		(255.025)		(65.947)		(450.564)
£	364.631	£	406.944	\$	4.054.927	\$	2.798.116	\$	1.180.148	\$	796.420	\$	3.654.185	\$	2.361.042

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Summe der Gesellschaft*	
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019**
<b>Aktiva:</b>		
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:		
Übertragbare Wertpapiere	\$ 248.527.843	\$ 222.945.863
Investmentfonds	12.955.358	9.478.261
Pensionsgeschäfte	2.654.737	6.795.263
Einlagen bei Kreditinstituten	0	50.411
Finanzderivate	5.431.804	3.891.052
Zahlungsmittel	441.352	495.409
Einlagen bei Kontrahenten	3.568.575	2.721.833
Forderungen aus Einkünften	1.517.743	1.377.896
Forderungen aus verkauften Anlagen	696.948	1.399.642
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	53.588.291	35.390.076
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	602.922	495.362
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	143.032	298.735
Sonstige Aktiva	198	90
<b>Summe Aktiva</b>	<b>330.128.803</b>	<b>285.339.893</b>
<b>Passiva:</b>		
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:		
Finanzderivate	(2.091.263)	(2.556.218)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(2.843.148)	(3.107.090)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(1.718.585)	(3.659.843)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(87.594.280)	(66.760.468)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(357.237)	(463.603)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(148.207)	(135.410)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(14.485.046)	(10.345.046)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(574.683)	(802.699)
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(9.755)	(12.135)
Überziehungskredit	(11)	(3.752)
Zu zahlende Dividende	(71.336)	(5.504)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(1.221.819)	(96.410)
Einlagen von Kontrahenten	(3.062.909)	(1.734.169)
Sonstige Verbindlichkeiten	(47)	(26)
<b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>(114.178.326)</b>	<b>(89.682.373)</b>
<b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>	<b>\$ 215.950.477</b>	<b>\$ 195.657.520</b>

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

\* Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 14 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

\*\* Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2019 wurde nicht angepasst, um die Schließung des PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund, des PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund und des PIMCO RAE PLUS US Fund zu berücksichtigen.

Für den Verwaltungsrat:

Verwaltungsratsmitglied: Craig A. Dawson

Verwaltungsratsmitglied: David M. Kennedy

Datum: 28. April 2021

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

## Betriebsergebnisrechnung

(Angaben in Tausend)

	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund <sup>(1)</sup>	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Berichtszeitraum vom 14. Feb. 2019 bis 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 23.493	\$ 7.261	\$ 1.997	\$ 1.632
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(12.949)	966	983	760
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	1.047	39	482	345
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	79	64	(26)	(28)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	16.680	3.368	849	2.060
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	549	239	36	(22)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	30	2	0	1
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	28.929	11.939	4.321	4.748
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(1.374)	(255)	(624)	(540)
Servicegebühr	(30)	0	0	0
Bestandspflegegebühr	(37)	(6)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(19)	0	0	0
Gesamtaufwendungen	(1.460)	(261)	(624)	(540)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	17	7	4	4
Betriebskosten, netto	(1.443)	(254)	(620)	(536)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>27.486</b>	<b>11.685</b>	<b>3.701</b>	<b>4.212</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(2)	(34)	(1)	(8)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(4.206)	(794)	(1.137)	(1.111)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	616	95	39	(15)
Summe Finanzierungskosten	(3.592)	(733)	(1.099)	(1.134)
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern</b>	<b>23.894</b>	<b>10.952</b>	<b>2.602</b>	<b>3.078</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(79)	(6)	(15)	(1)
Kapitalertragsteuer	(5)	(6)	(2)	(1)
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern</b>	<b>23.810</b>	<b>10.940</b>	<b>2.585</b>	<b>3.076</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ 23.810</b>	<b>\$ 10.940</b>	<b>\$ 2.585</b>	<b>\$ 3.076</b>

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

<sup>(1)</sup> Der Emerging Asia Bond Fund wurde am 28. August 2020 in Asia Strategic Interest Bond Fund umbenannt.

PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Berichtszeitraum vom 23. Sep. 2020 bis 31. Dez. 2020		Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 334.347	\$ 339.878	\$ 106		\$ 4.523	\$ 14.528	\$ 5.810	\$ 7.091
21	46	0		0	0	0	0
(90.724)	51.095	(12)		11.578	3.126	(4.188)	2.035
(103.180)	(34.741)	273		(66.527)	(5.252)	5.627	(6.369)
127.835	(87.664)	47		494	(2.054)	(51)	(102)
476.087	729.107	1.131		19.501	17.790	4.076	4.985
(11.817)	4.367	443		3.769	33.271	215	1.420
(40.469)	2.361	6		(29)	22	(12)	24
692.100	1.004.449	1.994		(26.691)	61.431	11.477	9.084
(69.870)	(66.503)	(48)		(3.575)	(5.021)	(1.543)	(1.686)
(1.611)	(1.650)	0		(25)	(55)	0	0
(1.741)	(1.698)	0		0	0	0	0
(754)	(657)	0		0	(1)	(7)	(11)
(73.976)	(70.508)	(48)		(3.600)	(5.077)	(1.550)	(1.697)
2.287	2.073	0		18	84	1	1
(71.689)	(68.435)	(48)		(3.582)	(4.993)	(1.549)	(1.696)
620.411	936.014	1.946		(30.273)	56.438	9.928	7.388
(10.631)	(24.113)	0		(1.009)	(4.833)	(9)	(59)
0	0	0		0	0	0	0
(76.776)	(86.775)	0		0	0	0	(34)
(2.855)	3.348	4		0	7	0	1
(90.262)	(107.540)	4		(1.009)	(4.826)	(9)	(92)
530.149	828.474	1.950		(31.282)	51.612	9.919	7.296
(202)	536	(1)		(1)	(17)	(10)	(10)
0	0	0		0	0	0	0
529.947	829.010	1.949		(31.283)	51.595	9.909	7.286
\$ 529.947	\$ 829.010	\$ 1.949		\$ (31.283)	\$ 51.595	\$ 9.909	\$ 7.286

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 486.819	\$ 347.596	\$ 47.108	\$ 54.436
Sonstige Erträge	67	16	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	76.173	64.734	8.750	15.245
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	376.348	131.050	4.119	(46.394)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	92.719	(62.307)	563	(5.524)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	713.742	448.868	49.567	68.062
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	133.382	125.756	420	38.147
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(2.576)	169	34	205
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	1.876.674	1.055.882	110.561	124.177
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(163.119)	(93.848)	(12.185)	(12.680)
Servicegebühr	(372)	(187)	(26)	(55)
Bestandspflegegebühr	(1.044)	(251)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(631)	(614)	(22)	(64)
Gesamtaufwendungen	(165.166)	(94.900)	(12.233)	(12.799)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	1.781	1.034	197	185
Betriebskosten, netto	(163.385)	(93.866)	(12.036)	(12.614)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>1.713.289</b>	<b>962.016</b>	<b>98.525</b>	<b>111.563</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(7.790)	(1.970)	(36)	(214)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(186.086)	(145.342)	(10.836)	(11.172)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	4.741	10.945	825	(315)
Summe Finanzierungskosten	(189.135)	(136.367)	(10.047)	(11.701)
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern</b>	<b>1.524.154</b>	<b>825.649</b>	<b>88.478</b>	<b>99.862</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(69)	11	(5)	2
Kapitalertragsteuer	140	206	134	98
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern</b>	<b>1.524.225</b>	<b>825.866</b>	<b>88.607</b>	<b>99.962</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ 1.524.225</b>	<b>\$ 825.866</b>	<b>\$ 88.607</b>	<b>\$ 99.962</b>

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	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 98.471 0	\$ 127.251 0	€ 16.100 0	€ 14.738 0	\$ 156.275 0	\$ 182.876 14	\$ 196.851 0	\$ 183.098 0
113.599	34.490	83.743	6.499	(144.196)	(52.061)	(55.182)	19.837
25.727	(135.665)	(36.558)	(16.645)	(74.911)	3.668	135.548	(80.649)
(7.318)	(7.131)	(1.866)	7.214	(31.382)	(8.043)	(630)	(7.886)
76.223	85.762	412.066	110.594	80.220	212.092	120.400	267.694
(63.442)	67.272	28.701	14.906	25.443	71.094	1.233	24.372
71	(320)	574	(285)	(6.723)	(12.915)	71	516
243.331	171.659	502.760	137.021	4.726	396.725	398.291	406.982
(30.865)	(35.541)	(31.298)	(17.181)	(22.926)	(23.476)	(37.254)	(31.693)
(219)	(269)	(3)	0	(66)	(98)	(38)	(37)
(225)	(277)	0	0	0	0	(153)	(133)
(156)	(175)	(71)	(42)	(4)	(4)	(4)	(5)
(31.465)	(36.262)	(31.372)	(17.223)	(22.996)	(23.578)	(37.449)	(31.868)
471	470	476	160	28	39	0	0
(30.994)	(35.792)	(30.896)	(17.063)	(22.968)	(23.539)	(37.449)	(31.868)
212.337	135.867	471.864	119.958	(18.242)	373.186	360.842	375.114
(458)	(1.081)	(486)	(305)	(13.829)	(7.465)	(1.638)	(747)
0	0	0	0	0	0	0	0
(10.639)	(11.649)	(3.598)	(417)	(28.658)	(60.763)	(55.491)	(79.291)
(200)	1.278	(2.517)	1	(3.172)	(709)	(1.225)	3.739
(11.297)	(11.452)	(6.601)	(721)	(45.659)	(68.937)	(58.354)	(76.299)
201.040	124.415	465.263	119.237	(63.901)	304.249	302.488	298.815
0	(28)	(2.702)	(1.185)	(983)	(1.178)	(99)	(89)
0	1	0	0	(702)	(649)	222	7.719
201.040	124.388	462.561	118.052	(65.586)	302.422	302.611	306.445
\$ 201.040	\$ 124.388	€ 462.561	€ 118.052	\$ (65.586)	\$ 302.422	\$ 302.611	\$ 306.445

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 38.838	\$ 33.505	\$ 12.017	\$ 12.015
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	3.134	1.801	(13.857)	4.109
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	39.595	(14.214)	13.592	(7.180)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	206	(1.094)	(48)	(164)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	44.826	51.685	14.537	9.782
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	7.618	3.276	1.323	1.084
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	62	11	9	(20)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	134.279	74.970	27.573	19.626
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(7.968)	(5.813)	(2.976)	(2.714)
Servicegebühr	(8)	(9)	0	0
Bestandspflegegebühr	(3)	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)	0	0
Gesamtaufwendungen	(7.980)	(5.823)	(2.976)	(2.714)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	12	0	0
Betriebskosten, netto	(7.980)	(5.811)	(2.976)	(2.714)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	126.299	69.159	24.597	16.912
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(655)	(255)	(25)	(141)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(5.105)	(7.607)	(1)	(332)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	289	402	0	(47)
Summe Finanzierungskosten	(5.471)	(7.460)	(26)	(520)
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern</b>	120.828	61.699	24.571	16.392
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(17)	(9)	(5)	(14)
Kapitalertragsteuer	38	141	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern</b>	120.849	61.831	24.566	16.378
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 120.849	\$ 61.831	\$ 24.566	\$ 16.378

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		Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Berichtszeitraum vom 04. Jun. 2019 bis 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 7.723	\$ 4.187	\$ 2.417	\$ 3.039	€ 24.941	€ 27.306	€ 16.366	€ 15.616
0	0	0	0	4	9	0	0
550	(1.129)	(3.558)	(595)	(12.375)	39.172	1.285	10.632
10.791	(373)	(1.316)	270	78.143	45.727	11.517	(1.470)
(1.207)	(220)	(30)	(87)	32.517	1.189	10.644	2.735
7.101	2.762	370	893	9.705	42.822	(6.989)	30.479
2.695	2.926	(785)	1.083	14.556	(2.829)	2.278	(716)
21	(154)	17	10	11.408	3.637	(3.014)	1.108
27.674	7.999	(2.885)	4.613	158.899	157.033	32.087	58.384
(1.528)	(650)	(806)	(844)	(16.475)	(13.623)	(4.933)	(4.679)
0	0	0	0	(119)	(100)	0	0
0	0	0	0	(26)	(23)	0	0
(9)	0	0	0	(3)	(10)	(1)	(1)
(1.537)	(650)	(806)	(844)	(16.623)	(13.756)	(4.934)	(4.680)
12	17	5	13	824	854	166	183
(1.525)	(633)	(801)	(831)	(15.799)	(12.902)	(4.768)	(4.497)
26.149	7.366	(3.686)	3.782	143.100	144.131	27.319	53.887
(250)	(95)	(7)	(29)	(192)	(485)	(127)	(65)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	(71)	(1.929)	(1.297)	(1.528)	(2.014)
0	0	0	0	(10)	21	63	97
(250)	(95)	(7)	(100)	(2.131)	(1.761)	(1.592)	(1.982)
25.899	7.271	(3.693)	3.682	140.969	142.370	25.727	51.905
(10)	(6)	(10)	(16)	(22)	(223)	(2)	8
(1)	0	(2)	0	0	0	0	0
25.888	7.265	(3.705)	3.666	140.947	142.147	25.725	51.913
\$ 25.888	\$ 7.265	\$ (3.705)	\$ 3.666	€ 140.947	€ 142.147	€ 25.725	€ 51.913

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	€ 65.928	€ 49.362	€ 1.395	€ 3.473
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(20.167)	32.935	4.355	23.430
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(2.864)	(42.579)	4.627	20.040
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	48.153	1.256	919	(681)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(35.771)	72.596	4.232	5.291
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	11.965	19.500	2.514	(3.952)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	13.389	2.731	626	118
<b>Gesamtanlageertrag/(-verlust)</b>	<b>80.633</b>	<b>135.801</b>	<b>18.668</b>	<b>47.719</b>
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(34.504)	(25.762)	(779)	(1.204)
Servicegebühr	(85)	(54)	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	(246)	(205)	0	0
<b>Gesamtaufwendungen</b>	<b>(34.835)</b>	<b>(26.021)</b>	<b>(779)</b>	<b>(1.204)</b>
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	477	676	29	52
<b>Betriebskosten, netto</b>	<b>(34.358)</b>	<b>(25.345)</b>	<b>(750)</b>	<b>(1.152)</b>
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>46.275</b>	<b>110.456</b>	<b>17.918</b>	<b>46.567</b>
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(251)	(778)	(1)	(42)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(21.810)	(28.177)	0	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(571)	26	0	0
<b>Summe Finanzierungskosten</b>	<b>(22.632)</b>	<b>(28.929)</b>	<b>(1)</b>	<b>(42)</b>
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern</b>	<b>23.643</b>	<b>81.527</b>	<b>17.917</b>	<b>46.525</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(49)	(4)	6	(7)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern</b>	<b>23.594</b>	<b>81.523</b>	<b>17.923</b>	<b>46.518</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	<b>€ 23.594</b>	<b>€ 81.523</b>	<b>€ 17.923</b>	<b>€ 46.518</b>

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

<sup>(2)</sup> Der Euro Low Duration Fund wurde am 17. Januar 2020 in PIMCO European Short-Term Opportunities Fund umbenannt.

Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund <sup>(2)</sup>		Global Advantage Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Berichtszeitraum vom 31. Jan. 2020 bis 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	
€ 1.720	€ 2.141	€ 3.729	€ 2.447	€ 1.388	\$ 12.626	\$ 24.752	
0	0	0	0	0	0	0	
9	(1.349)	(2.460)	(7.434)	1.226	8.648	13.812	
1.672	(4.056)	2.031	(987)	1.443	11.701	(24.384)	
(344)	872	(95)	2.417	320	1.140	(2.059)	
(4.174)	3.698	3.794	2.830	165	24.867	26.118	
824	2.514	238	215	325	1.287	9.576	
(142)	(40)	4	1.485	(29)	(883)	(1.071)	
(435)	3.780	7.241	973	4.838	59.386	46.744	
(3.498)	(5.375)	(23)	(1.184)	(1.704)	(3.361)	(5.307)	
0	0	0	0	0	0	0	
0	0	0	0	0	0	0	
(1)	(1)	0	0	0	(16)	(35)	
(3.499)	(5.376)	(23)	(1.184)	(1.704)	(3.377)	(5.342)	
0	0	29	43	87	0	7	
(3.499)	(5.376)	6	(1.141)	(1.617)	(3.377)	(5.335)	
(3.934)	(1.596)	7.247	(168)	3.221	56.009	41.409	
(270)	(218)	(59)	(34)	(15)	(294)	(1.885)	
0	0	0	0	0	0	0	
0	0	0	0	0	(2.943)	(3.285)	
0	0	0	0	0	1	211	
(270)	(218)	(59)	(34)	(15)	(3.236)	(4.959)	
(4.204)	(1.814)	7.188	(202)	3.206	52.773	36.450	
0	0	0	0	1	(35)	(159)	
0	0	0	0	0	(32)	(50)	
(4.204)	(1.814)	7.188	(202)	3.207	52.706	36.241	
€ (4.204)	€ (1.814)	€ 7.188	€ (202)	€ 3.207	\$ 52.706	\$ 36.241	

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global Advantage Real Return Fund		Global Bond Fund	
	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 31. Jan. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 20	\$ 2.327	\$ 331.037	\$ 332.610
Sonstige Erträge	25	0	861	240
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(7)	(3.872)	310.931	96.542
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	1.811	(905)	167.162	98.587
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	55	76	92.172	(154.031)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	14	7.515	765.012	437.408
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(2.120)	1.546	96.678	71.969
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	78	(173)	(32.265)	(6.912)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(124)	6.514	1.731.588	876.413
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(29)	(549)	(96.720)	(82.776)
Servicegebühr	0	0	(2.082)	(2.692)
Bestandspflegegebühr	0	0	(71)	(61)
Sonstige Aufwendungen	0	0	(228)	(188)
Gesamtaufwendungen	(29)	(549)	(99.101)	(85.717)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	3.296	2.830
Betriebskosten, netto	(29)	(549)	(95.805)	(82.887)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	(153)	5.965	1.635.783	793.526
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(7)	(414)	(4.261)	(7.803)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	(313)	(36.822)	(46.993)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	(44)	(820)	1.225
Summe Finanzierungskosten	(7)	(771)	(41.903)	(53.571)
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern</b>	(160)	5.194	1.593.880	739.955
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	1	(7)	(1.268)	(297)
Kapitalertragsteuer	7	5	0	1
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern</b>	(152)	5.192	1.592.612	739.659
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ (152)	\$ 5.192	\$ 1.592.612	\$ 739.659

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	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 20.064	\$ 15.659	\$ 23.339	\$ 26.275	\$ 14.018	\$ 22.482	\$ 216.026	\$ 193.920
0	0	0	1	0	0	0	0
28.256	3.918	23.206	12.967	(3.487)	40.372	(57.660)	(28.099)
41.449	(24.709)	(37.195)	16.074	80.749	16.031	98.829	(48.616)
1.249	(5.727)	3.462	(8.103)	(2.133)	(1.468)	(2.168)	(9.825)
60.561	24.001	44.915	35.285	1.353	14.519	239.558	322.931
8.436	23.923	5.899	(5.314)	8.685	20.540	23.673	48.826
(1.032)	(876)	(3.618)	(2.675)	(625)	91	416	(123)
158.983	36.189	60.008	74.510	98.560	112.567	518.674	479.014
(5.439)	(3.325)	(5.756)	(6.879)	(8.586)	(10.401)	(34.472)	(28.312)
(10)	(2)	(63)	(46)	(29)	(28)	(53)	(63)
0	0	(50)	(51)	0	0	(352)	(381)
(1)	(9)	(3)	(11)	(1)	(2)	(192)	(153)
(5.450)	(3.336)	(5.872)	(6.987)	(8.616)	(10.431)	(35.069)	(28.909)
0	0	2	10	214	504	156	553
(5.450)	(3.336)	(5.870)	(6.977)	(8.402)	(9.927)	(34.913)	(28.356)
153.533	32.853	54.138	67.533	90.158	102.640	483.761	450.658
(109)	(437)	(358)	(1.479)	(269)	(2.477)	(180)	(845)
0	0	0	0	0	0	(815)	(747)
(5.045)	(4.279)	(2.266)	(3.791)	(2.267)	(2.398)	(65.193)	(73.880)
163	373	(90)	7	134	(44)	603	2.995
(4.991)	(4.343)	(2.714)	(5.263)	(2.402)	(4.919)	(65.585)	(72.477)
148.542	28.510	51.424	62.270	87.756	97.721	418.176	378.181
(31)	0	27	(100)	(1.734)	(825)	2	(33)
0	0	0	0	1	20	0	34
148.511	28.510	51.451	62.170	86.023	96.916	418.178	378.182
\$ 148.511	\$ 28.510	\$ 51.451	\$ 62.170	\$ 86.023	\$ 96.916	\$ 418.178	\$ 378.182

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenerträge	\$ 746.267	\$ 744.242	\$ 4.047	\$ 2.060
Sonstige Erträge	7	11	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	297.558	177.109	3.305	1.677
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	383.419	(58.277)	4.209	(1.333)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	77.801	(65.229)	1.404	(64)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	980.863	1.249.382	17.394	3.566
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	117.948	155.894	1.103	533
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(10.096)	1.730	19	9
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	2.593.767	2.204.862	31.481	6.448
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(151.210)	(120.238)	(995)	(320)
Servicegebühr	(6.716)	(6.308)	0	0
Bestandspflegegebühr	(3.048)	(1.757)	(62)	0
Sonstige Aufwendungen	(300)	(177)	(9)	(3)
Gesamtaufwendungen	(161.274)	(128.480)	(1.066)	(323)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	918	916	0	0
Betriebskosten, netto	(160.356)	(127.564)	(1.066)	(323)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	2.433.411	2.077.298	30.415	6.125
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(11.017)	(29.847)	(15)	(21)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(236.204)	(220.701)	(827)	(232)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	8.249	5.627	130	(10)
Summe Finanzierungskosten	(238.972)	(244.921)	(712)	(263)
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern</b>	2.194.439	1.832.377	29.703	5.862
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(482)	(86)	(9)	(5)
Kapitalertragsteuer	0	10	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern</b>	2.193.957	1.832.301	29.694	5.857
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 2.193.957	\$ 1.832.301	\$ 29.694	\$ 5.857

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	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 42.203	\$ 44.572	\$ 8.820	\$ 26.390	\$ 15.600	\$ 41.406	\$ 2.599.466	\$ 2.928.883
0	0	14	0	0	0	3.293	219
48.901	13.545	16.928	(11.688)	38.667	15.691	863.444	509.816
24.111	(25.799)	(1.010)	(22.517)	(42.539)	(15.905)	(1.778.308)	(844.935)
1.234	(2.323)	1.282	(13.305)	28.630	(15.655)	107.594	(188.340)
61.806	43.045	43.959	47.355	250.859	136.630	2.079.871	2.240.244
(10.775)	40.792	(5.077)	14.367	9.303	(6.525)	1.346.849	485.316
(89)	89	1.279	(1.233)	2.010	(2.729)	(40.667)	(16.994)
167.391	113.921	66.195	39.369	302.530	152.913	5.181.542	5.114.209
(10.264)	(7.631)	(4.362)	(6.460)	(13.320)	(13.125)	(644.992)	(656.858)
(44)	(36)	(15)	(22)	(259)	(257)	(17.765)	(16.676)
0	0	0	0	(294)	(329)	(32.437)	(34.238)
(3)	(3)	(1)	(1)	(2)	(2)	(5.467)	(6.065)
(10.311)	(7.670)	(4.378)	(6.483)	(13.875)	(13.713)	(700.661)	(713.837)
218	218	0	0	0	0	1.030	1.028
(10.093)	(7.452)	(4.378)	(6.483)	(13.875)	(13.713)	(699.631)	(712.809)
157.298	106.469	61.817	32.886	288.655	139.200	4.481.911	4.401.400
(162)	(331)	(1.578)	(8.938)	(3.248)	(11.983)	(82.611)	(108.303)
0	0	0	0	0	0	0	0
(7.677)	(9.369)	(715)	(2.204)	(61)	(2.693)	(1.340.040)	(1.350.659)
120	1.060	121	5	(208)	(8)	(4.923)	30.640
(7.719)	(8.640)	(2.172)	(11.137)	(3.517)	(14.684)	(1.427.574)	(1.428.322)
149.579	97.829	59.645	21.749	285.138	124.516	3.054.337	2.973.078
3	(3)	0	0	(6)	(17)	(12.846)	(3.394)
0	1	0	0	0	1	269	401
149.582	97.827	59.645	21.749	285.132	124.500	3.041.760	2.970.085
\$ 49.582	\$ 97.827	\$ 59.645	\$ 21.749	\$ 285.132	\$ 124.500	\$ 3.041.760	\$ 2.970.085

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Inflation Strategy Fund		Low Average Duration Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenerträge	\$ 1.174	\$ 2.224	\$ 21.021	\$ 44.406
Sonstige Erträge	0	0	448	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	1.774	514	7.979	(3.983)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(2.087)	(1.103)	7.076	(15.585)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	46	56	414	873
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	3.039	5.716	3.359	25.055
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	53	1.959	(1.276)	7.682
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(6)	(4)	(60)	197
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	3.993	9.362	38.961	58.645
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(718)	(860)	(6.098)	(6.168)
Servicegebühr	0	0	(135)	(231)
Bestandspflegegebühr	0	0	(80)	(81)
Sonstige Aufwendungen	0	(1)	(1)	(1)
Gesamtaufwendungen	(718)	(861)	(6.314)	(6.481)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	191	260
Betriebskosten, netto	(718)	(861)	(6.123)	(6.221)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	3.275	8.501	32.838	52.424
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(115)	(386)	(433)	(6.064)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(8)	(15)	(1.377)	(2.459)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	1	5	28	(557)
Summe Finanzierungskosten	(122)	(396)	(1.782)	(9.080)
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern</b>	3.153	8.105	31.056	43.344
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(150)	(156)	0	(4)
Kapitalertragsteuer	4	1	238	4
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern</b>	3.007	7.950	31.294	43.344
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 3.007	\$ 7.950	\$ 31.294	\$ 43.344

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

Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund		PIMCO MLP & EnergyInfrastructure Fund		Mortgage Opportunities Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 12.574	\$ 17.824	\$ 19.687	\$ 16.861	\$ 2.655	\$ 6.881	\$ 55.603	\$ 83.220
0	0	0	0	0	0	0	0
986	1.635	14.255	5.378	(23.554)	(4.861)	77.253	12.968
28.146	(24.983)	52.997	(14.070)	(30.970)	(1.482)	24.593	(77.940)
(682)	(1.347)	475	(412)	403	424	1.189	168
20.768	13.792	31.298	4.716	(3.819)	8.027	(906)	34.495
591	8.200	1.315	5.908	(5.879)	12.864	(6.735)	41.864
(99)	68	(107)	(58)	4	1	53	52
62.284	15.189	119.920	18.323	(61.160)	21.854	151.050	94.827
(2.959)	(2.627)	(4.018)	(2.340)	(1.124)	(2.358)	(9.799)	(11.692)
0	0	0	0	(12)	(25)	(138)	(91)
0	0	0	0	0	0	(3)	(4)
(1)	(1)	(20)	(21)	0	0	(12)	(11)
(2.960)	(2.628)	(4.038)	(2.361)	(1.136)	(2.383)	(9.952)	(11.798)
0	0	0	0	0	0	0	0
(2.960)	(2.628)	(4.038)	(2.361)	(1.136)	(2.383)	(9.952)	(11.798)
59.324	12.561	115.882	15.962	(62.296)	19.471	141.098	83.029
(54)	(1.622)	(44)	(96)	(8)	(28)	(1.748)	(14.975)
0	0	(20)	0	0	0	0	0
0	0	(80)	(129)	(4.690)	(6.944)	(9.084)	(15.698)
0	0	5	(1)	(603)	293	633	36
(54)	(1.622)	(139)	(226)	(5.301)	(6.679)	(10.199)	(30.637)
59.270	10.939	115.743	15.736	(67.597)	12.792	130.899	52.392
3	(5)	(13)	(2)	(296)	(554)	0	(3)
0	0	0	0	0	0	0	0
59.273	10.934	115.730	15.734	(67.893)	12.238	130.899	52.389
\$ 59.273	\$ 10.934	\$ 115.730	\$ 15.734	\$ (67.893)	\$ 12.238	\$ 130.899	\$ 52.389

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	PIMCO RAE Emerging Markets Fund		PIMCO RAE Europe Fund	
	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 23. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 23. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 2.608	\$ 4.607	€ 528	€ 460
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(18.846)	(7.863)	(5.176)	(345)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	1	14	(2)	3
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(209)	(66)	3	(2)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(5.037)	15.136	(973)	2.223
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(1)	1	0	0
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(5)	1	0	0
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(21.489)	11.830	(5.620)	2.339
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(314)	(551)	(99)	(78)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	(1)	0	0
Gesamtaufwendungen	(314)	(552)	(99)	(78)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(314)	(552)	(99)	(78)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	(21.803)	11.278	(5.719)	2.261
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	0	0	0	0
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	0	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	0	0	0
Summe Finanzierungskosten	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern</b>	(21.803)	11.278	(5.719)	2.261
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(291)	(648)	(63)	(32)
Kapitalertragsteuer	188	(210)	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern</b>	(21.906)	10.420	(5.782)	2.229
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ (21.906)	\$ 10.420	€ (5.782)	€ 2.229

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

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	
Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 23. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 23. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 20. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 20. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 1.165	\$ 1.830	\$ 522	\$ 367	\$ 225	\$ 395	€ 112	€ 177
0	0	0	0	0	0	0	0
(2.500)	(1.126)	2.830	296	1.208	(5)	128	110
(6)	(9)	0	0	0	0	0	0
46	2	3	(1)	(27)	(11)	0	1
(3.250)	7.770	(1.745)	2.254	(1.092)	1.226	(535)	768
0	0	0	0	0	0	0	0
(3)	3	0	0	6	0	0	0
(4.548)	8.470	1.610	2.916	320	1.605	(295)	1.056
(319)	(544)	(80)	(66)	(44)	(52)	(16)	(18)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	(1)	0	0	0	(1)	0	0
(319)	(545)	(80)	(66)	(44)	(53)	(16)	(18)
0	0	0	0	0	0	0	0
(319)	(545)	(80)	(66)	(44)	(53)	(16)	(18)
(4.867)	7.925	1.530	2.850	276	1.552	(311)	1.038
0	(1)	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	0	0	0	0	0
0	(1)	0	0	0	0	0	0
(4.867)	7.924	1.530	2.850	276	1.552	(311)	1.038
(227)	(316)	(154)	(101)	(25)	(54)	(14)	(17)
0	0	0	0	1	(40)	0	0
(5.094)	7.608	1.376	2.749	252	1.458	(325)	1.021
\$ (5.094)	\$ 7.608	\$ 1.376	\$ 2.749	\$ 252	\$ 1.458	€ (325)	€ 1.021

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund		PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund	
	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 20. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 20. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 114	\$ 156	\$ 101	\$ 79
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	645	96	411	39
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(2)	0	0	0
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(472)	841	(364)	612
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	0	0	0	0
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	0	0	0	0
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	285	1.093	148	730
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(18)	(20)	(13)	(9)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	0	0
Gesamtaufwendungen	(18)	(20)	(13)	(9)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(18)	(20)	(13)	(9)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	267	1.073	135	721
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	0	0	0	0
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	0	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	0	0	0
Summe Finanzierungskosten	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern</b>	267	1.073	135	721
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(23)	(30)	(28)	(24)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern</b>	244	1.043	107	697
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 244	\$ 1.043	\$ 107	\$ 697

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

StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Berichtszeitraum vom 29. März 2019 bis 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 39.662	\$ 77.543	\$ 97	\$ 119	\$ 36.598	\$ 42.710	\$ 141.210	\$ 174.827
0	0	0	0	0	0	0	0
33.203	11.856	74	61	(32.711)	2.230	156.487	61.991
323.372	391.409	1.462	341	48.820	(42.117)	109.168	3.069
466	(1.654)	3	0	(1.640)	(788)	19.179	(12.649)
15.105	45.401	119	63	44.472	58.288	202.206	144.667
87.847	237.175	(284)	355	(4.023)	11.615	14.862	1.816
(38)	(26)	0	0	(617)	(289)	1.658	(1.240)
499.617	761.704	1.471	939	90.899	71.649	644.770	372.481
(18.413)	(17.857)	(48)	(28)	(12.088)	(12.798)	(46.123)	(41.194)
(38)	(28)	0	0	0	0	(2.345)	(1.973)
0	0	0	0	0	0	(950)	(1.028)
(10)	(7)	0	0	(148)	(181)	(57)	(52)
(18.461)	(17.892)	(48)	(28)	(12.236)	(12.979)	(49.475)	(44.247)
0	0	1	1	0	0	1.157	1.155
(18.461)	(17.892)	(47)	(27)	(12.236)	(12.979)	(48.318)	(43.092)
481.156	743.812	1.424	912	78.663	58.670	596.452	329.389
(254)	(1.301)	0	(2)	(163)	(374)	(2.493)	(12.377)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	(121)	0	0	(5.339)	(6.858)	(16.080)	(20.563)
4	0	0	0	(157)	243	202	(216)
(250)	(1.422)	0	(2)	(5.659)	(6.989)	(18.371)	(33.156)
480.906	742.390	1.424	910	73.004	51.681	578.081	296.233
(1)	3	0	0	(2.127)	(1.782)	(204)	(116)
0	0	0	0	2	(2)	0	3
480.905	742.393	1.424	910	70.879	49.897	577.877	296.120
\$ 480.905	\$ 742.393	\$ 1.424	\$ 910	\$ 70.879	\$ 49.897	\$ 577.877	\$ 296.120

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Erträge</b>				
Zins- und Dividenderträge	\$ 312	\$ 978	£ 16.380	£ 12.674
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(34)	7	7.763	4.046
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	1.481	(22)	(6.406)	5.175
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(39)	(102)	368	(2)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	12	189	30.806	22.271
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	1.744	(1.589)	(110)	3.110
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(24)	15	(74)	(25)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	3.452	(524)	48.727	47.249
<b>Betriebskosten</b>				
Verwaltungsgebühr	(457)	(574)	(2.730)	(1.737)
Servicegebühr	0	(1)	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	(2)	(3)
Gesamtaufwendungen	(457)	(575)	(2.732)	(1.740)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	8	2	150	119
Betriebskosten, netto	(449)	(573)	(2.582)	(1.621)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	3.003	(1.097)	46.145	45.628
<b>Finanzierungskosten</b>				
Zinsaufwendungen	(15)	(25)	(143)	(314)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	(19)	(10.605)	(6.553)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	(2)	105	224
Summe Finanzierungskosten	(15)	(46)	(10.643)	(6.643)
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern</b>	2.988	(1.143)	35.502	38.985
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	(1)	(19)	(1)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern</b>	2.988	(1.144)	35.483	38.984
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	\$ 2.988	\$ (1.144)	£ 35.483	£ 38.984

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

UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
£ 11.594	£ 15.622	\$ 169.318	\$ 166.848	\$ 33.728	\$ 14.566	\$ 47.822	\$ 83.045
0	0	4	0	0	0	0	0
22.716	10.308	(54.842)	(5.764)	20.610	7.394	29.542	7.835
(10.183)	2.064	23.676	(26.488)	36.806	(568)	(22.594)	(51.518)
71	(70)	1.031	(195)	(2.616)	(437)	2.929	(3.712)
2.001	33.998	110.239	210.037	59.012	18.163	19.250	26.995
1.948	1.830	10.561	16.345	3.383	16.703	8.248	(1.607)
(115)	(67)	50	(2)	(224)	22	(877)	110
28.032	63.685	260.037	360.781	150.699	55.843	84.320	61.148
(1.618)	(1.883)	(21.120)	(18.180)	(5.725)	(1.850)	(11.218)	(9.495)
0	0	(714)	(990)	0	0	(118)	(132)
0	0	0	0	0	0	0	0
(2)	(5)	(71)	(38)	(1)	(5)	(3)	(3)
(1.620)	(1.888)	(21.905)	(19.208)	(5.726)	(1.855)	(11.339)	(9.630)
9	20	0	0	0	0	542	139
(1.611)	(1.868)	(21.905)	(19.208)	(5.726)	(1.855)	(10.797)	(9.491)
26.421	61.817	238.132	341.573	144.973	53.988	73.523	51.657
(506)	(985)	(137)	(752)	(175)	(1.015)	(1.224)	(5.057)
0	0	(556)	(528)	0	0	0	0
(1.638)	(4.248)	(27.175)	(39.418)	(18.260)	(5.903)	(13.489)	(22.348)
(384)	(91)	(393)	800	(360)	772	130	(9)
(2.528)	(5.324)	(28.261)	(39.898)	(18.795)	(6.146)	(14.583)	(27.414)
23.893	56.493	209.871	301.675	126.178	47.842	58.940	24.243
(1)	0	3	(11)	(24)	(2)	(141)	(13)
0	0	0	0	0	0	0	0
23.892	56.493	209.874	301.664	126.154	47.840	58.799	24.230
£ 23.892	£ 56.493	\$ 209.874	\$ 301.664	\$ 126.154	\$ 47.840	\$ 58.799	\$ 24.230

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Summe der Gesellschaft*	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019**
<b>Erträge</b>		
Zins- und Dividenderträge	\$ 6.210.760	\$ 6.611.145
Sonstige Erträge	4.745	561
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	1.765.446	1.191.753
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(32.120)	(976.027)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	619.719	(653.703)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	7.124.888	7.492.295
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	1.885.563	1.645.594
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(107.773)	(34.108)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	17.471.228	15.277.510
<b>Betriebskosten</b>		
Verwaltungsgebühr	(1.588.176)	(1.437.934)
Servicegebühr	(33.167)	(32.133)
Bestandspflegegebühr	(40.580)	(40.321)
Sonstige Aufwendungen	(8.526)	(8.805)
Gesamtaufwendungen	(1.670.449)	(1.519.193)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	15.087	14.025
Betriebskosten, netto	(1.655.362)	(1.505.168)
<b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>	<b>15.815.866</b>	<b>13.772.342</b>
<b>Finanzierungskosten</b>		
Zinsaufwendungen	(149.762)	(264.202)
Aufwand für Kreditfazilitäten	(1.391)	(1.275)
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(2.209.701)	(2.274.758)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(1.783)	62.462
Summe Finanzierungskosten	(2.362.637)	(2.477.773)
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern</b>	<b>13.453.229</b>	<b>11.294.569</b>
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(24.850)	(11.736)
Kapitalertragsteuer	500	7.688
<b>Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern</b>	<b>13.428.879</b>	<b>11.290.521</b>
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>	<b>\$ 13.428.879</b>	<b>\$ 11.290.521</b>

\* Die Summe der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 14 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

\*\* Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2019 wurde nicht angepasst, um die Schließung des PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund, des PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund und des PIMCO RAE PLUS US Fund zu berücksichtigen.

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

## Ausweis der Nettovermögensänderungen

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund <sup>(1)</sup>		PIMCO Capital Securities Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Berichtszeitraum vom 14. Feb. 2019 bis 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	\$ 226.380	\$ 0	\$ 38.513	\$ 33.569	\$ 7.944.483	\$ 5.998.728
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	763.905	223.896	138.510	14.869	3.718.289	3.256.642
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	541	71	18	14	8.179	8.565
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(123.708)	(8.527)	(11.910)	(13.015)	(4.242.576)	(2.148.462)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	23.810	10.940	2.585	3.076	529.947	829.010
<b>Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	\$ 890.928	\$ 226.380	\$ 167.716	\$ 38.513	\$ 7.958.322	\$ 7.944.483
	Diversified Income Duration Hedged Fund		Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	\$ 1.269.937	\$ 1.273.910	\$ 3.888.271	\$ 3.087.145	€ 1.604.773	€ 1.187.964
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	572.597	359.502	705.926	1.606.244	4.377.411	749.651
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	110	204	2.421	4.484	2	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(444.320)	(463.641)	(1.592.798)	(933.990)	(1.315.821)	(450.894)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	88.607	99.962	201.040	124.388	462.561	118.052
<b>Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	\$ 1.486.931	\$ 1.269.937	\$ 3.204.860	\$ 3.888.271	€ 5.128.926	€ 1.604.773
	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		Euro Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Berichtszeitraum vom 04. Jun. 2019 bis 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	\$ 155.506	\$ 0	\$ 74.289	\$ 51.799	€ 3.013.450	€ 1.978.440
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	52.040	149.286	39.689	41.145	1.017.745	1.489.942
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	0	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(13.125)	(1.045)	(77.702)	(22.321)	(928.687)	(597.079)
Nominalwechsellkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	25.888	7.265	(3.705)	3.666	140.947	142.147
<b>Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	\$ 220.309	\$ 155.506	\$ 32.571	\$ 74.289	€ 3.243.455	€ 3.013.450

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

<sup>(1)</sup> Der Emerging Asia Bond Fund wurde am 28. August 2020 in Asia Strategic Interest Bond Fund umbenannt.

PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		Diversified Income Fund	
Berichtszeitraum vom 23. Sep. 2020 bis 31. Dez. 2020		Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$	0	\$ 564.401	\$ 521.092	\$ 149.347	\$ 141.586	\$ 12.274.587	\$ 6.819.035
	99.920	195.580	168.516	30.799	23.527	10.147.417	7.263.889
	0	0	0	0	9	15.866	18.041
	0	(403.589)	(176.802)	(45.543)	(23.061)	(5.320.234)	(2.652.244)
	0	0	0	0	0	0	0
	1.949	(31.283)	51.595	9.909	7.286	1.524.225	825.866
\$	101.869	\$ 325.109	\$ 564.401	\$ 144.512	\$ 149.347	\$ 18.641.861	\$ 12.274.587
Emerging Local Bond Fund		Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 2.772.000	\$ 2.281.384	\$ 4.001.722	\$ 2.428.290	\$ 724.120	\$ 548.383	\$ 224.432	\$ 194.608
1.908.965	1.195.523	4.133.234	3.055.096	983.631	217.765	148.458	105.222
3.122	4.081	7.602	8.258	11	1	0	161
(1.769.217)	(1.011.410)	(3.182.154)	(1.796.367)	(387.154)	(103.860)	(136.220)	(91.937)
0	0	0	0	0	0	0	0
(65.586)	302.422	302.611	306.445	120.849	61.831	24.566	16.378
\$ 2.849.284	\$ 2.772.000	\$ 5.263.015	\$ 4.001.722	\$ 1.441.457	\$ 724.120	\$ 261.236	\$ 224.432
Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
€ 961.445	€ 742.058	€ 3.165.112	€ 1.487.943	€ 162.478	€ 253.994	€ 710.026	€ 775.039
760.807	780.669	1.143.868	2.483.351	64.816	74.766	787.047	312.218
272	0	1.561	1.014	0	0	0	0
(598.191)	(613.195)	(1.151.268)	(888.719)	(62.756)	(212.800)	(685.331)	(375.417)
0	0	0	0	0	0	0	0
25.725	51.913	23.594	81.523	17.923	46.518	(4.204)	(1.814)
€ 1.150.058	€ 961.445	€ 3.182.867	€ 3.165.112	€ 182.461	€ 162.478	€ 807.538	€ 710.026

## Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund <sup>(2)</sup>		Global Advantage Fund							
	Berichtszeitraum vom 31. Jan. 2020 bis 31. Dez. 2020		Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019						
<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	€	0	€	353.235	€	313.942	\$	467.498	\$	731.946		
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen		154.873		222.450		159.855		71.609		161.338		
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen		0		0		0		1.519		3.284		
Zahlungen für zurückgenommene Anteile		0		(224.734)		(123.769)		(69.048)		(465.311)		
Nominalwechsellkursanpassungen		0		0		0		0		0		
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit		7.188		(202)		3.207		52.706		36.241		
<b>Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	€	162.061	€	350.749	€	353.235	\$	524.284	\$	467.498		
	PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		Global High Yield Bond Fund		Global Investment Grade Credit Fund							
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019						
<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	\$	814.354	\$	850.423	\$	4.341.308	\$	3.153.872	\$	21.938.396	\$	17.244.136
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen		127.045		116.390		4.113.590		2.571.732		18.616.390		12.920.278
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen		11		13		2.894		6.266		13.032		20.891
Zahlungen für zurückgenommene Anteile		(325.003)		(249.388)		(3.472.427)		(1.768.744)		(14.583.605)		(10.079.210)
Nominalwechsellkursanpassungen		0		0		0		0		0		0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit		86.023		96.916		418.178		378.182		2.193.957		1.832.301
<b>Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	\$	702.430	\$	814.354	\$	5.403.543	\$	4.341.308	\$	28.178.170	\$	21.938.396
	Income Fund		Inflation Strategy Fund		Low Average Duration Fund							
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019						
<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	\$	81.080.459	\$	55.918.429	\$	70.015	\$	76.181	\$	1.189.920	\$	1.221.290
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen		40.097.349		51.733.270		8.650		24.639		907.546		698.811
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen		87.566		71.948		0		0		178		319
Zahlungen für zurückgenommene Anteile		(53.031.823)		(29.613.273)		(11.640)		(38.755)		(945.525)		(773.844)
Nominalwechsellkursanpassungen		0		0		0		0		0		0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit		3.041.760		2.970.085		3.007		7.950		31.294		43.344
<b>Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	\$	71.275.311	\$	81.080.459	\$	70.032	\$	70.015	\$	1.183.413	\$	1.189.920

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

<sup>(2)</sup> Der Euro Low Duration Fund wurde am 17. Januar 2020 in PIMCO European Short-Term Opportunities Fund umbenannt.

Global Advantage Real Return Fund		Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund	
Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 31. Jan. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 36.235	\$ 87.854	\$ 15.000.575	\$ 10.900.009	\$ 762.434	\$ 506.382	\$ 1.092.298	\$ 963.225
0	27.333	7.042.866	7.472.073	1.007.096	325.270	279.153	535.863
0	172	7.935	11.056	1.488	1.122	1.561	2.306
(36.083)	(84.316)	(7.341.679)	(4.122.222)	(409.935)	(98.850)	(494.483)	(471.266)
0	0	0	0	0	0	0	0
(152)	5.192	1.592.612	739.659	148.511	28.510	51.451	62.170
\$ 0	\$ 36.235	\$ 16.302.309	\$ 15.000.575	\$ 1.509.594	\$ 762.434	\$ 929.980	\$ 1.092.298
Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Libor Plus Bond Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 83.800	\$ 42.731	\$ 2.011.215	\$ 1.039.498	\$ 997.469	\$ 1.154.274	\$ 1.831.308	\$ 1.947.570
261.663	55.470	786.571	1.453.550	302.368	368.112	1.585.912	729.707
1	0	312	1.206	0	61	15	661
(43.148)	(20.258)	(303.079)	(580.866)	(571.611)	(546.727)	(1.124.305)	(971.130)
0	0	0	0	0	0	0	0
29.694	5.857	149.582	97.827	59.645	21.749	285.132	124.500
\$ 332.010	\$ 83.800	\$ 2.644.601	\$ 2.011.215	\$ 787.871	\$ 997.469	\$ 2.578.062	\$ 1.831.308
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		Mortgage Opportunities Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 510.334	\$ 526.200	\$ 478.805	\$ 377.768	\$ 238.171	\$ 246.190	\$ 1.675.111	\$ 2.183.029
257.854	91.751	384.256	144.082	41.302	182.660	1.215.655	879.327
0	0	17	24	4	523	2.691	3.140
(194.942)	(118.551)	(18.169)	(58.803)	(133.953)	(203.440)	(1.047.349)	(1.442.774)
0	0	0	0	0	0	0	0
59.273	10.934	115.730	15.734	(67.893 )	12.238	130.899	52.389
\$ 632.519	\$ 510.334	\$ 960.639	\$ 478.805	\$ 77.631	\$ 238.171	\$ 1.977.007	\$ 1.675.111

## Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO RAE Emerging Markets Fund		PIMCO RAE Europe Fund		PIMCO RAE Global Developed Fund	
	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 23. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 23. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 23. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	\$ 115.230	\$ 94.740	€ 23.470	€ 8.125	\$ 55.769	\$ 31.939
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	35.350	112.066	16.977	18.891	31.133	40.276
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	0	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(128.674)	(101.996)	(34.665)	(5.775)	(81.808)	(24.054)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(21.906)	10.420	(5.782)	2.229	(5.094)	7.608
<b>Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	\$ 0	\$ 115.230	€ 0	€ 23.470	\$ 0	\$ 55.769

  

	PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	
	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 20. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Berichtszeitraum vom 29. März 2019 bis 31. Dez. 2019
<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	\$ 3.424	\$ 2.727	\$ 3.009.851	\$ 2.299.203	\$ 5.977	\$ 0
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	2.894	0	2.756.611	1.758.922	1.175	5.067
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	110	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(6.425)	0	(2.708.534)	(1.790.777)	(159)	0
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	107	697	480.905	742.393	1.424	910
<b>Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	\$ 0	\$ 3.424	\$ 3.538.833	\$ 3.009.851	\$ 8.417	\$ 5.977

  

	UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
<b>Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres</b>	£ 406.944	£ 372.63	\$ 2.798.116	\$ 2.496.388	\$ 796.420	\$ 178.732
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen	35.327	51.28	3.430.232	1.393.851	835.044	682.740
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.168	1.33	7.645	11.468	10.196	3.090
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(102.700)	(74.79)	(2.390.940)	(1.405.255)	(587.666)	(115.982)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	23.892	56.49	209.874	301.664	126.154	47.840
<b>Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres</b>	£ 364.631	£ 406.94	\$ 4.054.927	\$ 2.798.116	\$ 1.180.148	\$ 796.420

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

\* Die Summe der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 14 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

\*\* Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2019 wurde nicht angepasst, um die Schließung des PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund, des PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund und des PIMCO RAE PLUS US Fund zu berücksichtigen.

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	
Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 23. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 20. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 20. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2020 bis 20. Nov. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 14.183	\$ 11.525	\$ 11.347	\$ 9.889	€ 5.125	€ 4.104	\$ 5.666	\$ 4.623
18.074	969	7	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(33.633)	(1.060)	(11.606)	0	(4.800)	0	(5.910)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
1.376	2.749	252	1.458	(325)	1.021	244	1.043
\$ 0	\$ 14.183	\$ 0	\$ 11.347	€ 0	€ 5.125	\$ 0	\$ 5.666
Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019
\$ 1.169.920	\$ 899.132	\$ 5.139.388	\$ 4.899.730	\$ 25.717	\$ 51.842	£ 557.068	£ 386.886
113.016	376.180	2.734.701	1.468.272	38.750	9.698	338.934	376.530
9	11	8.407	10.367	0	11	70	3
(379.160)	(155.300)	(2.036.320)	(1.535.101)	(20.234)	(34.690)	(167.196)	(245.335)
0	0	0	0	0	0	0	0
70.879	49.897	577.877	296.120	2.988	(1.144)	35.483	38.984
\$ 974.664	\$ 1.169.920	\$ 6.424.053	\$ 5.139.388	\$ 47.221	\$ 25.717	£ 764.359	£ 557.068
US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*					
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2020	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2019**				
\$ 2.361.042	\$ 2.650.419	\$ 195.657.520	\$ 144.323.640				
3.273.122	1.758.162	123.338.417	112.567.021				
12.658	22.348	199.687	217.133				
(2.051.436)	(2.094.117)	(118.078.323)	(72.662.689)				
0	0	1.404.297	(78.106)				
58.799	24.230	13.428.879	11.290.521				
\$ 3.654.185	\$ 2.361.042	\$ 215.950.477	\$ 195.657.520				

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield 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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>AUSTRALIEN</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
Mineral Resources Ltd. 8,125 % fällig am 01.05.2027	1.700	\$ 1.885	0,21	VLL International, Inc. 5,750 % fällig am 28.11.2024 7,250 % fällig am 20.07.2027	4.125 1.600	4.156 1.662	0,47 0,19	Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030 5,875 % fällig am 24.04.2025	5.700 2.800	5.998 3.229	0,67 0,36
Santos Finance Ltd. 5,250 % fällig am 13.03.2029	8.100	9.114	1,02	Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 15.01.2026 5,625 % fällig am 26.08.2028	14.500 5.900	15.098 6.221	1,69 0,70	Yanlord Land HK Co. Ltd. 6,800 % fällig am 27.02.2024	8.500	8.978	1,01
Summe Australien		13.984	1,57	Yingde Gases Investment Ltd. 6,250 % fällig am 19.01.2023	3.000	3.101	0,35			44.726	5,02
<b>BERMUDAS</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
Star Energy Geothermal Darajat 4,850 % fällig am 14.10.2038	4.300	4.811	0,54	Yuzhou Group Holdings Co. Ltd. 5,375 % fällig am 29.09.2022 (d)	4.000 8.700 1.750	3.948 9.363 1.873	0,44 1,05 0,21	Airport Authority Hong Kong 2,400 % fällig am 08.03.2028 (d)	300	307	0,03
				7,375 % fällig am 13.01.2026 7,850 % fällig am 12.08.2026				Summe Hongkong		45.033	5,05
<b>BRASILIEN</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
BRF S.A. 5,750 % fällig am 21.09.2050	2.100	2.340	0,26	Zhenro Properties Group Ltd. 8,350 % fällig am 10.03.2024 8,700 % fällig am 03.08.2022 9,150 % fällig am 08.03.2022 9,150 % fällig am 06.05.2023	2.000 7.000 1.300 1.200	2.115 7.359 1.349 1.281	0,24 0,83 0,15 0,14				
<b>CAYMAN INSELN</b>											
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>											
China Evergrande Group 4,250 % fällig am 14.02.2023	HK 63.000	8.011	0,90	Summe Cayman Inseln		255.853	28,72				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
21Vianet Group, Inc. 7,875 % fällig am 15.10.2021	2.800	2.866	0,32			263.864	29,62				
Agile Group Holdings Ltd. 6,875 % fällig am 07.03.2023 (d) 7,875 % fällig am 31.07.2024 (d)	4.600 10.487	4.738 11.093	0,53 1,25	<b>CHINA</b>							
Champion Sincerity Holdings Ltd. 8,125 % fällig am 08.02.2022 (d)	2.400	2.506	0,28	<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>							
China Evergrande Group 8,250 % fällig am 23.03.2022 8,750 % fällig am 28.06.2025 9,500 % fällig am 11.04.2022	6.900 9.600 6.200	6.495 7.968 5.921	0,73 0,89 0,66	China Yangtze Power International BVI Ltd. 0,000 % fällig am 09.11.2021 (b)	€ 3.400	4.127	0,46	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
China SCE Group Holdings Ltd. 5,875 % fällig am 10.03.2022 7,000 % fällig am 02.05.2025 7,250 % fällig am 19.04.2023	1.600 2.200 600	1.628 2.298 630	0,18 0,26 0,07	Amipeace Ltd. 2,250 % fällig am 22.10.2030	\$ 4.300	4.311	0,48	Adani Renewable Energy RJ Ltd. 4,625 % fällig am 15.10.2039	959	997	0,11
CIFI Holdings Group Co. Ltd. 5,250 % fällig am 13.05.2026 5,375 % fällig am 28.02.2021 (d)	3.000 1.700	3.125 1.704	0,35 0,19	CFLD Cayman Investment Ltd. 8,050 % fällig am 13.01.2025 8,600 % fällig am 08.04.2024	5.700 4.000	4.745 3.468	0,53 0,39	Future Retail Ltd. 5,600 % fällig am 22.01.2025	4.700	3.977	0,45
5,375 % fällig am 24.08.2022 (d)	1.700	1.730	0,19	Chalico Hong Kong Corp. Ltd. 5,000 % fällig am 21.05.2023 (d)	1.700	1.733	0,19	JSW Steel Ltd. 5,250 % fällig am 13.04.2022	4.100	4.195	0,47
5,500 % fällig am 23.01.2022 (g)	1.100	1.117	0,13	China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd. 3,080 % fällig am 09.12.2025 (d)	8.200	8.262	0,93	Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023	3.300	3.369	0,38
6,450 % fällig am 07.11.2024 6,550 % fällig am 28.03.2024	6.800 800	7.352 856	0,83 0,10	Contemporary Ruiding Development Ltd. 2,625 % fällig am 17.09.2030	4.000	4.070	0,46	Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	12.600	13.429	1,51
Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,875 % fällig am 22.10.2030 7,250 % fällig am 08.04.2026	4.300 1.900	4.446 2.141	0,50 0,24	Greenland Global Investment Ltd. 6,250 % fällig am 16.12.2022 6,750 % fällig am 25.06.2022 7,250 % fällig am 22.01.2025	5.600 3.000 8.500	5.516 2.918 7.969	0,62 0,33 0,89	ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027 6,450 % fällig am 27.09.2022	900 6.550	957 6.820	0,11 0,77
Fantasia Holdings Group Co. Ltd. 9,250 % fällig am 28.07.2023 15,000 % fällig am 18.12.2021	6.700 1.400	6.784 1.502	0,76 0,17	Huaxin Cement International Finance Co. Ltd. 2,250 % fällig am 19.11.2025	4.500	4.507	0,51	ReNew Power Synthetic 6,670 % fällig am 12.03.2024	800	844	0,09
Greentown China Holdings Ltd. 4,700 % fällig am 29.04.2025 5,650 % fällig am 13.07.2025	4.600 300	4.619 312	0,52 0,03	New Metro Global Ltd. 4,800 % fällig am 15.12.2024	6.200	6.309	0,71	Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,700 % fällig am 27.02.2022	10.200	10.378	1,16
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd. 5,625 % fällig am 24.10.2024	2.600	2.724	0,31	Overseas Chinese Town Asia Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.07.2023 (d)	3.600	3.656	0,41	TML Holdings Pte. Ltd. 5,500 % fällig am 03.06.2024	9.200	9.396	1,05
Kaissa Group Holdings Ltd. 8,500 % fällig am 30.06.2022 9,375 % fällig am 30.06.2024 10,500 % fällig am 15.01.2025	4.400 7.000 10.000	4.510 6.803 10.028	0,51 0,76 1,13	Radiance Capital Investments Ltd. 11,750 % fällig am 31.10.2021	700	734	0,08	Yes Bank Ifsc Banking Unit Branch 3,750 % fällig am 06.02.2023	600	593	0,07
11,950 % fällig am 22.10.2022 11,950 % fällig am 12.11.2023	3.700 7.600	3.942 8.075	0,44 0,91	Wens Foodstuffs Group Co. Ltd. 3,258 % fällig am 29.10.2030	2.100	2.052	0,23	Summe Indien		54.955	6,17
KWG Group Holdings Ltd. 5,875 % fällig am 10.11.2024 6,000 % fällig am 11.01.2022 6,300 % fällig am 13.02.2026 7,400 % fällig am 05.03.2024	4.000 3.700 5.500 3.100	4.120 3.758 5.600 3.332	0,46 0,42 0,63 0,37	Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 15.04.2024 8,250 % fällig am 25.11.2023 9,250 % fällig am 15.04.2023	2.900 6.700 900	2.994 7.077 957	0,34 0,79 0,11	58.314	6,54		
Melco Resorts Finance Ltd. 5,250 % fällig am 26.04.2026 5,625 % fällig am 17.07.2027 5,750 % fällig am 21.07.2028	3.500 2.450 2.000	3.666 2.585 2.134	0,41 0,29 0,24	Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	5.300	5.297	0,60	Minejesa Capital BV 5,625 % fällig am 10.08.2037	2.400	2.645	0,30
MGM China Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 18.06.2025	\$ 3.000	\$ 3.127	0,35	Zoomlion HK SPV Co. Ltd. 6,125 % fällig am 20.12.2022	\$ 2.500	\$ 2.625	0,29	5.366	0,60		
Powerlong Real Estate Holdings Ltd. 4,875 % fällig am 15.09.2021 5,950 % fällig am 30.04.2025 6,250 % fällig am 10.08.2024	800 5.000 6.100	804 5.083 6.390	0,09 0,57 0,72	Summe China		83.327	9,35				
Seazen Group Ltd. 6,000 % fällig am 12.08.2024 6,450 % fällig am 11.06.2022	2.900 5.500	3.038 5.672	0,34 0,64	<b>HONGKONG</b>							
Sunac China Holdings Ltd. 6,500 % fällig am 09.07.2023 6,500 % fällig am 10.01.2025 6,650 % fällig am 03.08.2024 7,000 % fällig am 09.07.2025 7,250 % fällig am 14.06.2022 7,950 % fällig am 11.10.2023	7.500 1.000 6.200 4.500 3.900 1.500	7.786 1.035 6.471 4.702 4.031 1.598	0,87 0,12 0,73 0,53 0,45 0,18	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
				AIA Group Ltd. 3,200 % fällig am 16.09.2040	2.400	2.520	0,28	<b>INDONESIEN</b>			
				CMB International Leasing Management Ltd. 2,750 % fällig am 12.08.2030	3.600	3.533	0,40	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				Far East Horizon Ltd. 4,350 % fällig am 14.06.2022 (d)	2.000	2.001	0,23	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			

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
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>PHILIPPINEN</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>			
Indonesia Government International Bond				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Kasikornbank PCL			
8,125 % fällig am				JGSH Philippines Ltd.				5,275 % fällig am			
15.05.2024	IDR 65.261.000	\$ 5.105	0,57	4,125 % fällig am				14.10.2025 (d)(f)	\$	4.000	\$ 4.133 0,47
8,375 % fällig am				09.07.2030	\$	2.350	\$ 2.476 0,28	PTT Treasury Center Co. Ltd.			
15.09.2026	144.400.000	11.801	1,33	Jollibee Worldwide Pte. Ltd.				3,700 % fällig am		2.400	2.519 0,28
		16.906	1,90	3,900 % fällig am 23.01.2025 (d)	400	385	0,04	16.07.2070			
Summe Indonesien		22.272	2,50	4,750 % fällig am 24.06.2030	3.300	3.346	0,38	Summe Thailand			9.261 1,04
<b>ISRAEL</b>				<b>MEGAWORLD CORP.</b>				<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,125 % fällig am 30.07.2027				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Leviathan Bond Ltd.				Royal Capital BV				DAE Sukuk Dfc Ltd.			
6,125 % fällig am 30.06.2025	\$	2.000	2,205 0,25	4,875 % fällig am 05.05.2024 (d)	2.000	2.045	0,23	3,750 % fällig am 15.02.2026		4.000	4.120 0,46
<b>ITALIEN</b>				5,000 % fällig am 05.02.2026 (d)				<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,500 % fällig am 05.05.2021 (d)				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UniCredit SpA				5,875 % fällig am 05.05.2022 (d)				Barclays PLC			
7,500 % fällig am 03.06.2026 (d)(f)	€	1.400	1,993 0,22	7,000 % fällig am 21.10.2025 (d)	6.190	6.360	0,71	6,125 % fällig am 15.12.2025(d)(f)		2.500	2.700 0,30
<b>JAPAN</b>				SMC Global Power Holdings Corp.				HSBC Holdings PLC			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,500 % fällig am 25.04.2024 (d)				6,000 % fällig am 22.05.2027(d)(f)			
Asahi Mutual Life Insurance Co.				7,000 % fällig am 21.10.2025 (d)				6,000 % fällig am 22.05.2027(d)(f)			
6,500 % fällig am 05.09.2023 (d)	\$	900	968 0,11	Summe Philippinen		24.605	2,76	Jaguar Land Rover Automotive PLC			
Nissan Motor Co. Ltd.								7,750 % fällig am 15.10.2025		3.000	3.238 0,37
4,810 % fällig am 17.09.2030		1.000	1.128 0,13	<b>RUMANIEN</b>				Lloyds Banking Group PLC			
Summe Japan		2.096	0,24	STAATSEMISSIONEN				7,875 % fällig am 27.06.2029 (d)(f)			
<b>MALAYSIA</b>				Romania Government International Bond				£			
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				2,625 % fällig am 02.12.2040				€			
Cerah Capital Ltd.				4,500 % fällig am 02.12.2040				\$			
0,000 % fällig am 08.08.2024 (b)		7.000	6.991 0,78	SAUDI-ARABIEN				5,880 0,66			
<b>MAURITIUS</b>				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				ABJA Investment Co. Pte. Ltd.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Azure Power Energy Ltd.				4,450 % fällig am 24.07.2023				3,265 % fällig am 18.02.2036			
5,500 % fällig am 03.11.2022		1.700	1.747 0,20	5,450 % fällig am 24.01.2028	9.700	10.357	1,16	Vedanta Resources Finance PLC			
Greenko Investment Co.				Alam Synergy Pte. Ltd.				8,000 % fällig am 23.04.2023		13.605	11.469 1,29
4,875 % fällig am 16.08.2023		3.600	3.690 0,41	6,625 % fällig am 24.04.2022	2.300	1.944	0,22	Vedanta Resources Ltd.			
Greenko Solar Mauritius Ltd.				Eterna Capital Pte. Ltd. (8,000% bar oder 8,000% PIK)	1.349	634	0,07	6,125 % fällig am 09.08.2024		1.960	1.416 0,16
5,950 % fällig am 29.07.2026		1.700	1.844 0,21	Global Prime Capital Pte. Ltd.				Summe Großbritannien			31.331 3,52
India Green Energy Holdings				5,950 % fällig am 23.01.2025	4.300	4.402	0,49	<b>USA</b>			
5,375 % fällig am 29.04.2024		8.400	8.901 1,00	Indika Energy Capital Pte. Ltd.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Summe Mauritius		16.18	1,82	5,875 % fällig am 09.11.2024	1.300	1.339	0,15	Aviation Capital Group LLC			
<b>MONGOLEI</b>				8,250 % fällig am 22.10.2025				5,500 % fällig am 15.12.2024			
STAATSEMISSIONEN				LMIRT Capital Pte. Ltd.				900 997 0,11			
Mongolia Government International Bond				7,250 % fällig am 19.06.2024				Nissan Motor Acceptance Corp.			
5,125 % fällig am 05.12.2022		7.137	7.441 0,83	Medco Bell Pte. Ltd.				3,875 % fällig am 21.09.2023		1.100	1.175 0,13
5,625 % fällig am 01.05.2023		3.600	3.807 0,43	6,375 % fällig am 30.01.2027	1.300	1.333	0,15	Summe USA			2.172 0,24
Summe Mongolei		11.248	1,26	Temasek Financial Ltd.				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>			
<b>NIEDERLANDE</b>				2,500 % fällig am 06.10.2070				U.S. Treasury Notes			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Singapur				2,500 % fällig am 15.02.2022			
Prosus NV				2.100				1.000			
3,832 % fällig am 08.02.2051		8.400	8.265 0,93	28.146 3,16				Summe USA			
<b>PAKISTAN</b>				<b>SÜDKOREA</b>				<b>VIETNAM</b>			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN			
Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd.				KDB Life Insurance Co. Ltd.				Vietnam Debt & Asset Trading Corp.			
5,625 % fällig am 05.12.2022		5.900	6.062 0,68	7,500 % fällig am 21.05.2023 (d)	1.000	996	0,11	1,000 % fällig am 10.10.2025		3.800	3.306 0,37
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Kookmin Bank				<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>			
Pakistan Government International Bond				2,500 % fällig am 04.11.2030 (f)				WANDELANLEIHEN & WECHSEL			
6,875 % fällig am 05.12.2027		200	209 0,02	Tongyang Life Insurance Co. Ltd.				Link CB Ltd.			
8,250 % fällig am 15.04.2024		6.500	7.107 0,80	5,250 % fällig am 22.09.2025 (d)	4.200	4.338	0,49	1,600 % fällig am 03.04.2024	HKD	28.000	3.633 0,41
8,250 % fällig am 30.09.2025		700	773 0,09	Summe Südkorea		9.921	1,11	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Summe Pakistan		14.151	1,59	<b>SRI LANKA</b>				1MDB Global Investments Ltd.			
<b>THAILAND</b>				STAATSEMISSIONEN				4,400 % fällig am 09.03.2023			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Sri Lanka Government International Bond				Baixin Auto Finance Ltd.			
Bangkok Bank PCL				5,750 % fällig am 18.04.2023				9,109 % fällig am 30.04.2021 (d)			
3,733 % fällig am 25.09.2034 (f)		2.500	2.609 0,29	6,200 % fällig am 11.05.2027	17.700	10.169	1,14	Celestial Miles Ltd.			
<b>THAILAND</b>				6,850 % fällig am 03.11.2025				5,750 % fällig am 31.01.2024 (d)			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,550 % fällig am 28.03.2030				Easy Tactic Ltd.			
Bangkok Bank PCL				Summe Sri Lanka				5,750 % fällig am 13.01.2022			
3,733 % fällig am 25.09.2034 (f)		2.500	2.609 0,29	23.249 2,61				5,875 % fällig am 13.02.2023			
<b>THAILAND</b>				<b>THAILAND</b>				9,125 % fällig am 28.07.2022			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				12,375 % fällig am 18.11.2022 (h)			
Bangkok Bank PCL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				NWD Finance BVI Ltd.			
3,733 % fällig am 25.09.2034 (f)		2.500	2.609 0,29	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,800 % fällig am 09.09.2023 (d)			
<b>THAILAND</b>				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,250 % fällig am 07.03.2024 (d)			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				NWD MTN Ltd.			
Bangkok Bank PCL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,125 % fällig am 18.07.2029			
3,733 % fällig am 25.09.2034 (f)		2.500	2.609 0,29	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Peak RE BVI Holding Ltd.			
<b>THAILAND</b>				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,350 % fällig am 28.10.2025 (d)			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4.500 4.684 0,53			

# Aufstellung der Wertpapieranlagen 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
RKPF Overseas Ltd. 6,700 % fällig am 30.09.2024	\$ 1.800	\$ 1.904	0,21	<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
Scenery Journey Ltd. 11,500 % fällig am 24.10.2022	9.400	8.804	0,99	0,079 % fällig am 14.01.2021			
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	3.719	4.218	0,47	(b)(c)	\$ 2.900	\$ 2.900	0,33
Studio City Finance Ltd. 7,250 % fällig am 11.02.2024	9.600	10.048	1,13	Summe kurzfristige Instrumente		6.418	0,72
Wanda Properties International Co. Ltd. 7,250 % fällig am 29.01.2024	900	928	0,10	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 799.818	89,77
Wanda Properties Overseas Ltd. 6,950 % fällig am 05.12.2022	400	409	0,05				
		79.631	8,94				
Summe Jungferninseln (Britisch)		83.264	9,35				
				<b>AKTIEN</b>			
				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	6.694.243	66.688	7,48
				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	48.700	4.952	0,56
				Summe Investmentfonds		\$ 71.640	8,04

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 1.302	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021	\$ (1.328)	\$ 1.302	\$ 1.302	0,15
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.328)	\$ 1.302	\$ 1.302	0,15

<sup>(1)</sup> 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-Bobl March Futures	Short	03.2021	20	\$ 2	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	47	1	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	19	(10)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	8	3	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	136	(8)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	54	100	0,01
				\$ 88	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 88	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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Atlantia SpA	1,000 %	20.06.2025	€ 200	\$ 6	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,803 %	17.03.2026	CNY 48.600	\$ 44	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	\$ 15.500	86	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	8.200	(7)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	2.200	(167)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,230	15.05.2024	100	(7)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	13.01.2050	100	(22)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	12.03.2050	3.700	27	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,270	06.06.2024	200	(14)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,290	15.05.2024	100	(7)	0,00

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,300 %	22.05.2024	\$ 100	\$ (7)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,310	24.05.2024	100	(7)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,320	21.05.2024	100	(7)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,330	20.05.2024	100	(7)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,410	28.03.2024	100	(8)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,750	18.12.2029	2.300	(231)	(0,03)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,500	16.06.2026	€ 1.700	5	0,00
						\$ (329)	(0,04)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ (323)</b>	<b>(0,04)</b>

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### 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

#### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC USD versus INR	INR 69,000	03.09.2021	2.250	\$ 180	\$ 107	0,01
	Put - OTC USD versus INR	69,000	03.12.2021	6.000	330	334	0,04
					\$ 510	\$ 441	0,05

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

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Alibaba Group Holding Ltd.	(1,000) %	20.12.2021	\$ 22.900	\$ (625)	\$ (26)	\$ (651)	(0,07)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	China Government International Bond	1,000 %	20.12.2025	\$ 22.900	\$ 744	\$ 78	\$ 822	0,09
BRC	Baidu, Inc.	1,000	20.12.2025	3.800	57	10	67	0,01
	China Cinda Finance Ltd.	1,000	20.12.2025	3.800	34	0	34	0,01
	Huarong Finance Co. Ltd.	1,000	20.12.2025	4.500	(58)	13	(45)	(0,01)
	Indonesia Asahan Aluminium PT	1,000	20.12.2025	3.300	(65)	60	(5)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2025	500	8	0	8	0,00
	Joy Treasure Assets Holdings Inc.	1,000	20.12.2025	3.800	10	14	24	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2025	3.800	(3)	40	37	0,01
	PT Perusahaan Listrik Negara	1,000	20.12.2025	3.800	(8)	40	32	0,00
GST	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.	1,000	20.12.2025	3.800	8	13	21	0,00
	Country Garden Holdings Co. Ltd.	1,000	20.12.2021	4.500	(50)	7	(43)	0,00
					\$ 677	\$ 275	\$ 952	0,11

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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 PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

### 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 CNY-CNREPOFIX	2,933 %	17.01.2025	CNY 4.900	\$ 0	\$ 10	\$ 10	0,00
NGF	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,920	14.01.2025	5.000	0	9	9	0,00
SCX	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,650	05.03.2025	18.200	0	(70)	(70)	(0,01)
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,000	13.02.2025	8.000	0	(13)	(13)	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,250	23.09.2024	7.000	0	1	1	0,00
						\$ 0	\$ (63)	\$ (63)	(0,01)

### 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
DBL	Zahlung	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 7.329	08.03.2021	\$ 0	\$ 103	\$ 103	0,01

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	03.2021	HKD 7.705	\$ 994	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	01.2021	\$ 445	¥ 46.409	4	0	4	0,00
	02.2021	€ 309	\$ 377	0	(2)	(2)	0,00
	03.2021	HKD 138.860	¥ 17.913	1	0	1	0,00
BPS	02.2021	\$ 895	¥ 93.416	10	0	10	0,00
	02.2021	€ 1.593	RUB 117.642	0	(8)	(8)	0,00
	03.2021	HKD 16.013	\$ 2.066	0	0	0	0,00
BRC	03.2021	TWD 124.942	4.462	14	0	14	0,00
	03.2021	CNH 47.990	7.309	0	(42)	(42)	(0,01)
	03.2021	\$ 991	CNH 6.563	14	0	14	0,00
CBK	01.2021	¥ 46.409	\$ 448	0	(2)	(2)	0,00
	02.2021	€ 15.107	18.105	8	(407)	(399)	(0,04)
	02.2021	\$ 448	¥ 46.409	2	0	2	0,00
	03.2021	8.489	CNH 56.693	196	0	196	0,02
	03.2021	344	INR 25.520	3	0	3	0,00
GLM	02.2021	1.351	RUB 102.990	37	0	37	0,00
	03.2021	CNH 61.687	\$ 9.346	0	(107)	(107)	(0,01)
	03.2021	THB 164.152	5.406	0	(73)	(73)	(0,01)
	03.2021	\$ 7.298	CNH 48.000	55	0	55	0,01
	03.2021	1.116	CNY 7.341	1	0	1	0,00
HUS	02.2021	€ 3.480	\$ 4.145	0	(117)	(117)	(0,01)
	02.2021	£ 1.134	1.527	0	(24)	(24)	0,00
	02.2021	\$ 2.591	¥ 271.896	44	0	44	0,01
	02.2021	4.320	RUB 321.876	26	(10)	16	0,00
	03.2021	2.048	TWD 57.313	0	(8)	(8)	0,00
IND	02.2021	1.315	¥ 136.989	13	0	13	0,00
MYI	01.2021	€ 430	\$ 526	0	0	0	0,00
	01.2021	SGD 13	10	0	0	0	0,00
	02.2021	£ 1.254	1.688	0	(27)	(27)	0,00
	03.2021	THB 23.486	781	0	(3)	(3)	0,00
RYL	03.2021	HKD 18.000	2.322	0	0	0	0,00
	03.2021	\$ 1.941	CNH 12.807	21	0	21	0,00
SCX	02.2021	1.007	¥ 105.000	10	0	10	0,00
	03.2021	129	IDR 1.856.313	2	0	2	0,00
SSB	02.2021	6.544	¥ 673.965	0	(13)	(13)	0,00
UAG	02.2021	2.979	RUB 226.733	75	0	75	0,01
	03.2021	HKD 6.867	\$ 886	0	0	0	0,00
	03.2021	TWD 19.086	689	10	0	10	0,00
				\$ 546	\$ (843)	\$ (297)	(0,03)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die ausschüttende Investor AUD (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	01.2021	\$ 88	AUD 119	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
BPS	01.2021	5	7	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	64	87	3	0	3	0,00
SCX	01.2021	19	26	1	0	1	0,00
UAG	01.2021	88	120	4	0	4	0,00
				\$ 12	\$ 0	\$ 12	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2021	\$ 129	CHF 114	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	01.2021	1.541	1.363	1	0	1	0,00
GLM	01.2021	786	700	7	0	7	0,00
MYI	01.2021	635	571	10	0	10	0,00
SCX	01.2021	478	428	7	0	7	0,00
SSB	01.2021	2.373	2.107	11	0	11	0,00
UAG	01.2021	1.878	1.659	1	(2)	(1)	0,00
				\$ 37	\$ (2)	\$ 35	0,00

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E 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	01.2021	\$ 23.798	€ 19.488	\$ 49	\$ 0	\$ 49	0,01
BPS	01.2021	€ 9.152	\$ 11.208	9	0	9	0,00
	01.2021	\$ 22.929	€ 18.910	225	(15)	210	0,02
BRC	01.2021	8.117	6.775	173	0	173	0,02
CBK	01.2021	725	603	13	0	13	0,00
HUS	01.2021	€ 1.945	\$ 2.385	5	0	5	0,00
	01.2021	\$ 4.888	€ 4.029	43	0	43	0,01
MYI	01.2021	28.340	23.228	83	0	83	0,01
SCX	01.2021	9.944	8.303	215	0	215	0,02
	02.2021	27.906	22.792	0	0	0	0,00
				\$ 815	\$ (15)	\$ 800	0,09

Zum 31. Dezember 2020 standen für die ausschüttende Investor RMB (Hedged) Class 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	01.2021	CNH 3.344	\$ 513	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	01.2021	\$ 50	CNH 331	1	0	1	0,00
	02.2021	513	3.351	2	0	2	0,00
BPS	01.2021	CNH 3.334	\$ 511	0	(2)	(2)	0,00
	02.2021	28	4	0	0	0	0,00
	02.2021	\$ 511	CNH 3.340	2	0	2	0,00
HUS	01.2021	CNH 1.561	\$ 239	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 104	CNH 688	2	0	2	0,00
	02.2021	239	1.564	1	0	1	0,00
MYI	01.2021	105	690	1	0	1	0,00
SSB	01.2021	992	6.531	13	0	13	0,00
				\$ 22	\$ (5)	\$ 17	0,00

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Investor SGD (Hedged) ausschüttend II, Class E 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
BPS	01.2021	SGD 8.238	\$ 6.210	\$ 0	\$ (23)	\$ (23)	0,00
	02.2021	\$ 6.210	SGD 8.238	23	0	23	0,00
BRC	01.2021	3	5	0	0	0	0,00
	02.2021	20	27	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	5.114	6.886	96	0	96	0,01
GLM	02.2021	SGD 61	\$ 46	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	\$ 112	SGD 150	1	0	1	0,00
	02.2021	165	219	1	0	1	0,00
MYI	01.2021	SGD 3.534	\$ 2.655	0	(18)	(18)	0,00
	02.2021	\$ 2.656	SGD 3.534	18	0	18	0,00
NGF	01.2021	SGD 8.276	\$ 6.211	0	(52)	(52)	(0,01)
	01.2021	\$ 5.014	SGD 6.721	71	0	71	0,01
	02.2021	6.211	8.276	51	0	51	0,01
SCX	01.2021	2.053	2.755	32	0	32	0,01
SSB	01.2021	1.838	2.461	24	0	24	0,00
	02.2021	20	26	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	SGD 10	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 806	SGD 1.080	11	0	11	0,00
	02.2021	53	70	1	0	1	0,00
				\$ 329	\$ (93)	\$ 236	0,03

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 1.585 0,18

Summe Anlagen

\$ 874.110 98,11

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 16.818 1,89

Nettovermögen

\$ 890.928 100,00

**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 mit Sachwertausschüttung.

(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
CIFI Holdings Group Co. Ltd.	5,500 %	23.01.2022	20.09.2019 - 09.12.2019	\$ 1.106	\$ 1.117	0,13

(h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 31. Dezember 2020 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.526 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 3.447 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 162 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	88	1.262	0	1.350
<b>Summen</b>	<b>\$ 66.776</b>	<b>\$ 807.334</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 874.110</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 207.178	\$ 0	\$ 207.178
Investmentfonds	14.115	0	0	14.115
Pensionsgeschäfte	0	448	0	448
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(8)	(318)	0	(326)
<b>Summen</b>	<b>\$ 14.107</b>	<b>\$ 207.308</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 221.415</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	(0,500) %	18.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (1.523)	\$ (1.523)	(0,17)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (1.523)</b>	<b>(0,17)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 508	\$ (590)	\$ (82)
BPS	406	(270)	136
BRC	318	(370)	(52)
CBK	(90)	0	(90)
DBL	103	0	103
DUB	0	(180)	(180)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
GLM	\$ (80)	\$ 160	\$ 80
GST	(43)	0	(43)
HUS	(34)	0	(34)
IND	13	0	13
MYI	64	2	66
NGF	79	0	79
RYL	21	0	21
SCX	185	(240)	(55)
SSB	35	0	35
UAG	100	0	100

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	59,57	66,60
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	30,20	24,91
Investmentfonds	8,04	6,24
Pensionsgeschäfte	0,15	0,20
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,04)	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate	0,18	(0,16)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,17)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Australien	1,57	1,78
Bermuda	0,54	k. A.
Brasilien	0,26	k. A.
Cayman-Inseln	29,62	32,35
China	9,35	8,88
Frankreich	k. A.	0,93
Deutschland	k. A.	0,26
Hongkong	5,05	5,57
Ungarn	0,56	k. A.
Indien	6,54	5,35
Indonesien	2,50	4,64
Israel	0,25	k. A.
Italien	0,22	k. A.
Japan	0,24	0,43
Luxemburg	k. A.	0,85
Malaysia	0,78	k. A.
Mauritius	1,82	2,27
Mongolei	1,26	1,09
Niederlande	0,93	0,70
Pakistan	1,59	1,71
Philippinen	2,76	1,35
Rumänien	0,66	k. A.
Saudi-Arabien	0,57	k. A.
Singapur	3,16	2,44
Südkorea	1,11	1,20
Spanien	k. A.	0,60
Sri Lanka	2,61	5,58
Thailand	1,04	0,85
Vereinigte Arabische Emirate	0,46	0,18
Großbritannien	3,52	1,99
USA	0,36	0,18
Vietnam	0,37	0,88
Jungfernseln (Britisch)	9,35	9,45
Kurzfristige Instrumente	0,72	k. A.
Investmentfonds	8,04	6,24
Pensionsgeschäfte	0,15	0,20
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,03
Zinsswaps	(0,04)	(0,01)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,05	0,02
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	(0,01)
Zinsswapoptionen	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,07)	(0,29)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,11	0,09

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Zinsswaps	(0,01)	(0,02)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	0,01	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,03)	0,00
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,12	0,05
Sonstige Aktiva und Passiva	1,89	2,19
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
GAFI Bond Issuer Pty. Ltd. 1,900 % fällig am 14.12.2028	AUD 300	\$ 233	0,14
Lendlease Finance Ltd. 3,400 % fällig am 27.10.2027	1.800	1.467	0,87
Mineral Resources Ltd. 8,125 % fällig am 01.05.2027	\$ 100	111	0,07
Perenti Finance Pty. Ltd. 6,500 % fällig am 07.10.2025	600	640	0,38
Santos Finance Ltd. 5,250 % fällig am 13.03.2029	1.500	1.688	1,01
Summe Australien		4.139	2,47
<b>BAHAMAS</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Competition Team Technologies Ltd. 4,250 % fällig am 12.03.2029	500	580	0,35
<b>BERMUDAS</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Star Energy Geothermal Darajat 4,850 % fällig am 14.10.2038	400	447	0,27
<b>CAYMAN INSELN</b>			
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>			
China Evergrande Group 4,250 % fällig am 14.02.2023	HKD 11.000	1.399	0,83
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
21Vianet Group, Inc. 7,875 % fällig am 15.10.2021	\$ 1.200	1.228	0,73
Agile Group Holdings Ltd. 6,875 % fällig am 07.03.2023 (c)	500	515	0,31
7,875 % fällig am 31.07.2024 (c)	1.200	1.269	0,76
China Evergrande Group 8,250 % fällig am 23.03.2022	500	471	0,28
China SCE Group Holdings Ltd. 5,875 % fällig am 10.03.2022	200	203	0,12
7,000 % fällig am 02.05.2025	300	313	0,19
7,375 % fällig am 09.04.2024	1.100	1.172	0,70
CIFI Holdings Group Co. Ltd. 5,250 % fällig am 13.05.2026	400	417	0,25
5,375 % fällig am 28.02.2021 (c)	300	301	0,18
5,375 % fällig am 24.08.2022 (c)	300	305	0,18
5,500 % fällig am 23.01.2022 (f)	800	812	0,48
Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,875 % fällig am 22.10.2030	400	414	0,25
7,250 % fällig am 08.04.2026	1.100	1.240	0,74
Fantasia Holdings Group Co. Ltd. 9,250 % fällig am 28.07.2023	400	405	0,24
Geely Automobile Holdings Ltd. 3,625 % fällig am 25.01.2023	500	516	0,31
4,000 % fällig am 09.12.2024 (c)	1.600	1.629	0,97
Goodman HK Finance 3,000 % fällig am 22.07.2030	500	525	0,31
Greentown China Holdings Ltd. 4,700 % fällig am 29.04.2025	1.200	1.205	0,72
5,650 % fällig am 13.07.2025	500	520	0,31
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd. 5,625 % fällig am 24.10.2024	600	629	0,38
Kaisa Group Holdings Ltd. 10,500 % fällig am 15.01.2025	1.700	1.705	1,02
11,500 % fällig am 30.01.2023	300	315	0,19
11,950 % fällig am 22.10.2022	600	639	0,38
11,950 % fällig am 12.11.2023	1.200	1.275	0,76
KWG Group Holdings Ltd. 5,875 % fällig am 10.11.2024	800	824	0,49
6,000 % fällig am 11.01.2022	400	406	0,24
Meituan 2,125 % fällig am 28.10.2025	200	203	0,12
Melco Resorts Finance Ltd. 5,250 % fällig am 26.04.2026	1.200	1.257	0,75

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
MGM China Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 18.06.2025	\$ 200	\$ 208	0,12
5,375 % fällig am 15.05.2024	300	311	0,19
MTR Corp. CI Ltd. 2,500 % fällig am 02.11.2026	1.000	1.076	0,64
Powerlong Real Estate Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 30.04.2025	600	610	0,36
6,250 % fällig am 10.08.2024	1.200	1.257	0,75
Sands China Ltd. 5,400 % fällig am 08.08.2028	700	822	0,49
Seazen Group Ltd. 6,000 % fällig am 12.08.2024	500	524	0,31
6,450 % fällig am 11.06.2022	700	722	0,43
Sunac China Holdings Ltd. 6,500 % fällig am 10.01.2025	200	207	0,12
6,650 % fällig am 03.08.2024	1.400	1.461	0,87
7,250 % fällig am 14.06.2022	500	517	0,31
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 3,750 % fällig am 23.01.2023	700	731	0,44
Tencent Holdings Ltd. 3,240 % fällig am 03.06.2050	2.000	2.070	1,23
Times China Holdings Ltd. 6,600 % fällig am 02.03.2023	400	409	0,24
VLL International, Inc. 5,750 % fällig am 28.11.2024	200	202	0,12
Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 15.01.2026	900	937	0,56
5,625 % fällig am 26.08.2028	200	211	0,13
Yingde Gases Investment Ltd. 6,250 % fällig am 19.01.2023	1.500	1.551	0,92
Yuzhou Group Holdings Co. Ltd. 7,375 % fällig am 13.01.2026	500	538	0,32
8,500 % fällig am 04.02.2023	200	216	0,13
Zhenro Properties Group Ltd. 8,700 % fällig am 03.08.2022	200	210	0,13
9,150 % fällig am 08.03.2022	1.000	1.037	0,62
		36.540	21,79
Summe Cayman Inseln		37.939	22,62
<b>CHINA</b>			
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>			
China Yangtze Power International BVI Ltd. 0,000 % fällig am 09.11.2021 (a)	€ 300	364	0,22
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Ampeace Ltd. 2,250 % fällig am 22.10.2030	\$ 1.200	1.203	0,72
CFLD Cayman Investment Ltd. 8,050 % fällig am 13.01.2025	200	167	0,10
Challico Hong Kong Corp. Ltd. 5,000 % fällig am 21.05.2023 (c)	500	510	0,31
China Construction Bank Corp. 2,450 % fällig am 24.06.2030 (e)	1.200	1.231	0,73
China Huadian Overseas Development Ltd. 3,375 % fällig am 23.06.2025 (c)	1.200	1.223	0,73
China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd. 3,080 % fällig am 09.12.2025 (c)	1.600	1.612	0,96
Contemporary Ruiding Development Ltd. 1,875 % fällig am 17.09.2025	500	505	0,30
2,625 % fällig am 17.09.2030	500	509	0,30
Greenland Global Investment Ltd. 5,600 % fällig am 13.11.2022	400	380	0,23
7,250 % fällig am 22.01.2025	1.800	1.688	1,01
Huaxin Cement International Finance Co. Ltd. 2,250 % fällig am 19.11.2025	2.100	2.103	1,25
New Metro Global Ltd. 4,800 % fällig am 15.12.2024	700	712	0,43
Overseas Chinese Town Asia Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.07.2023 (c)	400	406	0,24
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 2,500 % fällig am 08.08.2024	200	208	0,12
2,700 % fällig am 13.05.2030	2.200	2.286	1,36
2,950 % fällig am 12.11.2029	300	317	0,19
4,600 % fällig am 12.09.2048	1.100	1.408	0,84

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SPIC MTN Co. Ltd. 1,625 % fällig am 27.07.2025	\$ 1.200	\$ 1.208	0,72
Sunny Express Enterprises Corp. 3,350 % fällig am 23.10.2022 (c)	500	505	0,30
Wens Foodstuffs Group Co. Ltd. 3,258 % fällig am 29.10.2030	500	489	0,29
Yango Justice International Ltd. 8,250 % fällig am 25.11.2023	700	739	0,44
Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	1.600	1.599	0,95
Zoomlion HK SPV Co. Ltd. 6,125 % fällig am 20.12.2022	1.400	1.470	0,88
		22.478	13,40
Summe China		22.842	13,62
<b>HONGKONG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AIA Group Ltd. 3,200 % fällig am 11.03.2025	250	270	0,16
3,200 % fällig am 16.09.2040	500	525	0,31
CNOOC Finance USA LLC 4,375 % fällig am 02.05.2028	200	229	0,14
Far East Horizon Ltd. 4,350 % fällig am 14.06.2022 (c)	400	400	0,24
Fortune Star BVI Ltd. 4,350 % fällig am 06.05.2023	€ 200	249	0,15
5,950 % fällig am 19.10.2025	\$ 1.500	1.577	0,94
GLP China Holdings Ltd. 4,974 % fällig am 26.02.2024	400	429	0,26
Huarong Finance Co. Ltd. 1,330 % fällig am 24.02.2023	300	296	0,18
5,000 % fällig am 19.11.2025	1.300	1.463	0,87
5,500 % fällig am 16.01.2025	600	679	0,40
ICBCIL Finance Co. Ltd. 1,750 % fällig am 25.08.2025	400	402	0,24
Industrial & Commercial Bank of China Asia Ltd. 4,250 % fällig am 21.07.2021 (c)(e)	500	506	0,30
Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030	1.300	1.368	0,82
5,875 % fällig am 24.04.2025	2.500	2.883	1,72
Nanyang Commercial Bank Ltd. 3,800 % fällig am 20.11.2029 (e)	800	829	0,49
Yanlord Land HK Co. Ltd. 6,800 % fällig am 27.02.2024	500	528	0,31
		12.633	7,53
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Airport Authority Hong Kong 2,400 % fällig am 08.03.2028 (c)	1.800	1.843	1,10
Summe Hongkong		14.476	8,63
<b>INDIEN</b>			
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>			
Bharti Airtel Ltd. 1,500 % fällig am 17.02.2025	1.000	1.158	0,69
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Adani Electricity Mumbai Ltd. 3,949 % fällig am 12.02.2030	200	213	0,13
Adani Transmission Ltd. 4,000 % fällig am 03.08.2026	500	542	0,32
JSW Steel Ltd. 5,250 % fällig am 13.04.2022	500	512	0,31
Muthoot Finance Ltd. 6,125 % fällig am 31.10.2022	500	525	0,31
Network I2I Ltd. 5,650 % fällig am 15.01.2025 (c)	200	213	0,13
NTPC Ltd. 4,500 % fällig am 19.03.2028	300	336	0,20
Periana Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	2.000	2.131	1,27
ReNew Power Pvt Ltd. 6,450 % fällig am 27.09.2022	1.300	1.354	0,81

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
ReNew Power Synthetic 6,670 % fällig am 12.03.2024	\$ 400	\$ 422	0,25	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026	\$ 1.200	\$ 1.302	0,78	Alam Synergy Pte. Ltd. 6,625 % fällig am 24.04.2022	\$ 500	\$ 423	0,25
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,700 % fällig am 27.02.2022	2.000	2.035	1,21	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	650	689	0,41	BOC Aviation Ltd. 2,625 % fällig am 17.09.2030	1.200	1.215	0,73
TML Holdings Pte. Ltd. 5,500 % fällig am 03.06.2024	1.200	1.226	0,73	Summe Mauritius		2.402	1,43	Global Prime Capital Pte. Ltd. 7,250 % fällig am 26.04.2021	200	202	0,12
		9.509	5,67	<b>MONGOLEI</b>				Indika Energy Capital Pte. Ltd. 8,250 % fällig am 22.10.2025	650	705	0,42
Summe Indien		10.667	6,36	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				LMIRT Capital Pte. Ltd. 7,250 % fällig am 19.06.2024	200	202	0,12
<b>INDONESIEN</b>				Mongolia Government International Bond 5,125 % fällig am 05.12.2022	500	521	0,31	Summe Singapur		4.028	2,40
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,625 % fällig am 01.05.2023	800	846	0,51	<b>SÜDKOREA</b>			
Adaro Indonesia PT 4,250 % fällig am 31.10.2024	250	258	0,15	Summe Mongolei		1.367	0,82	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5,450 % fällig am 15.05.2030	800	965	0,58	<b>NIEDERLANDE</b>				KB Capital Co. Ltd. 1,500 % fällig am 28.10.2025	1.200	1.221	0,73
LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % fällig am 04.02.2039	1.127	1.333	0,80	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Kookmin Bank 2,500 % fällig am 04.11.2030	1.000	1.019	0,61
Medco Oak Tree Pte. Ltd. 7,375 % fällig am 14.05.2026	500	539	0,32	Prosus NV 3,832 % fällig am 08.02.2051	1.500	1.476	0,88	(e)			
Minejasa Capital BV 5,625 % fällig am 10.08.2037	600	661	0,39	<b>PAKISTAN</b>				Shinhan Bank Co. Ltd. 4,000 % fällig am 23.04.2029	200	228	0,14
Pelabuhan Indonesia Persero PT 4,875 % fällig am 01.10.2024	500	553	0,33	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				(e)			
Pelabuhan Indonesia PT 5,375 % fällig am 05.05.2045	500	605	0,36	Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd. 5,625 % fällig am 05.12.2022	500	514	0,30	Shinhan Card Co. Ltd. 1,375 % fällig am 19.10.2025	700	711	0,42
Pertamina Persero PT 4,300 % fällig am 20.05.2023	1.600	1.723	1,03	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				SK Hynix, Inc. 3,000 % fällig am 17.09.2024	200	214	0,13
TBG Global Pte. Ltd. 5,250 % fällig am 10.02.2022	200	200	0,12	Pakistan Government International Bond 6,875 % fällig am 05.12.2027	700	733	0,44	Tongyang Life Insurance Co. Ltd. 5,250 % fällig am 22.09.2025	400	413	0,25
		6.837	4,08	Summe Pakistan		1.247	0,74	(c)			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>PHILIPPINEN</b>				Woori Bank 4,250 % fällig am 04.10.2024	1.000	1.047	0,62
Indonesia Government International Bond 3,700 % fällig am 30.10.2049	500	549	0,33	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				(c)(e)			
8,125 % fällig am 15.05.2024	IDR 19.350.000	1.514	0,90	BDO Unibank, Inc. 2,125 % fällig am 13.01.2026	1.200	1.237	0,74	5,250 % fällig am 16.05.2022	200	209	0,12
8,375 % fällig am 15.09.2026	23.000.000	1.880	1,12	JGSH Philippines Ltd. 4,125 % fällig am 09.07.2030	200	211	0,13	(c)(e)			
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 3,800 % fällig am 23.06.2050	\$ 1.000	1.107	0,66	Jollibee Worldwide Pte. Ltd. 4,750 % fällig am 24.06.2030	500	507	0,30	Summe Südkorea		5.062	3,02
4,150 % fällig am 29.03.2027	2.200	2.525	1,50	Megaworld Corp. 4,125 % fällig am 30.07.2027	400	420	0,25	<b>SRI LANKA</b>			
		7.575	4,51	Metropolitan Bank & Trust Co. 2,125 % fällig am 15.01.2026	500	512	0,30	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Summe Indonesien		14.412	8,59	PLDT, Inc. 3,450 % fällig am 23.06.2050	700	753	0,45	Sri Lanka Government International Bond 5,750 % fällig am 18.04.2023	400	258	0,15
<b>JAPAN</b>				Royal Capital BV 5,875 % fällig am 05.05.2022	500	512	0,31	6,200 % fällig am 11.05.2027	1.500	862	0,51
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				(c)				7,550 % fällig am 28.03.2030	1.300	750	0,45
Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	700	774	0,46	SM Investments Corp. 4,875 % fällig am 10.06.2024	200	215	0,13	Summe Sri Lanka		1.870	1,11
<b>LUXEMBURG</b>				SMC Global Power Holdings Corp. 7,000 % fällig am 21.10.2025	200	206	0,12	<b>THAILAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				(c)		4.573	2,73	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	400	478	0,28	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Bangkok Bank PCL 4,450 % fällig am 19.09.2028	200	232	0,14
<b>MALAYSIA</b>				Philippines Government International Bond 5,000 % fällig am 13.01.2037	200	265	0,16	Kasikornbank PCL 5,275 % fällig am 14.10.2025	400	413	0,25
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				10,625 % fällig am 16.03.2025	900	1.279	0,76	(c)(e)			
Cerah Capital Ltd. 0,000 % fällig am 08.08.2024 (a)	1.700	1.698	1,01			1.544	0,92	PTT Treasury Center Co. Ltd. 3,700 % fällig am 16.07.2070	500	525	0,31
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Philippinen		6.117	3,65	Summe Thailand		1.170	0,70
Axiata SPV2 Bhd. 2,163 % fällig am 19.08.2030	1.200	1.214	0,72	<b>RUMÄNIEN</b>				<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
Petronas Capital Ltd. 3,500 % fällig am 21.04.2030	500	576	0,34	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
TNB Global Ventures Capital Bhd. 3,244 % fällig am 19.10.2026	800	868	0,52	Romania Government International Bond 2,625 % fällig am 02.12.2040	€ 400	523	0,31	Barclays PLC 7,875 % fällig am 15.03.2022	200	210	0,13
		2.658	1,58	<b>SAUDI-ARABIEN</b>				(c)(e)			
Summe Malaysia		4.356	2,59	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Jaguar Land Rover Automotive PLC 7,750 % fällig am 15.10.2025	400	432	0,26
<b>MAURITIUS</b>				Saudi Arabian Oil Co. 3,250 % fällig am 24.11.2050	\$ 800	813	0,49	Standard Chartered PLC 3,265 % fällig am 18.02.2036	500	524	0,31
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,500 % fällig am 24.11.2070	500	507	0,30	Vedanta Resources Finance PLC 8,000 % fällig am 23.04.2023	400	337	0,20
Azure Power Energy Ltd. 5,500 % fällig am 03.11.2022	400	411	0,24	Summe Saudi-Arabien		1.320	0,79	Summe Großbritannien		1.503	0,90
				<b>SINGAPUR</b>				<b>USA</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				ABJA Investment Co. Pte. Ltd. 5,450 % fällig am 24.01.2028	1.200	1.281	0,76	Aviation Capital Group LLC 5,500 % fällig am 15.12.2024	100	111	0,07
								Hyundai Capital America 2,750 % fällig am 27.09.2026	500	531	0,32
								Nissan Motor Acceptance Corp. 3,875 % fällig am 21.09.2023	100	107	0,06
										749	0,45

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
<b>US-SCHATZOBBLIGATIONEN</b>								<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>											
U.S. Treasury Bonds				Easy Tactic Ltd.				PIMCO Select Funds plc -			
2,250 % fällig am 15.08.2049	\$ 20	\$ 23	0,01	12,375 % fällig am 18.11.2022	\$ 1.000	\$ 1.017	0,61	PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	1.510.252	\$ 15.045	8,97
Summe USA		772	0,46	NWD MTN Ltd.	200	208	0,12	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (d)	1.880	25	0,02
<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH) WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>											
Link CB Ltd.				4,125 % fällig am 18.07.2029							
1,600 % fällig am 03.04.2024	HKD 12.000	1.557	0,93	Peak RE BVI Holding Ltd.							
Summe Jungferneinseln (Britisch)				5,350 % fällig am 28.10.2025							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
1MDB Global Investments Ltd.				6,950 % fällig am 05.12.2022	200	205	0,12			15.070	8,99
4,400 % fällig am 09.03.2023	\$ 1.000	1.019	0,61	Summe Jungferneinseln (Britisch)		4.964	2,96	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
Celestial Miles Ltd.						6.521	3,89	<b>PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)</b>			
5,750 % fällig am 31.01.2024	1.000	1.058	0,63	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>					10.100	1.027	0,61
China Reinsurance Finance Corp. Ltd.				<b>U.S. TREASURY BILLS</b>							
3,375 % fällig am 09.03.2022	200	204	0,12	0,071 % fällig am 21.01.2021	2.200	2.200	1,31	<b>Summe Investmentfonds</b>			
				(a)(b)				\$		16.097	9,60
				Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 148.688	88,65				

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 1.299	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021	\$ (1.325)	\$ 1.299	\$ 1.299	0,78
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.325)	\$ 1.299	\$ 1.299	0,78

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend<sup>1</sup>, 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 March Futures	Short	03.2021	32	\$ (4)	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2021	6	1	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	4	0	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2021	7	1	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2021	4	(1)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	11	6	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	2	(3)	0,00
				\$ 0	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 0	0,00

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend<sup>1</sup>)**

\* 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<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Atlantia SpA	1,000 %	20.06.2025	€ 100	\$ 3	0,00

**ZINSSWAPS**

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung <sup>(3)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,803 %	17.03.2026	CNY 4.500	\$ 4	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	\$ 900	0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,670	27.12.2024	100	5	0,01
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	0,500	16.12.2025	AUD 800	4	0,00
					\$ 13	0,01
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 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.

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

(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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC USD versus INR	INR 69,000	03.09.2021	250	\$ 20	\$ 12	0,01
	Put - OTC USD versus INR	69,000	03.12.2021	700	38	39	0,02
					\$ 58	\$ 51	0,03

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Alibaba Group Holding Ltd.	(1,000) %	20.12.2025	\$ 2.300	\$ (63)	\$ (2)	\$ (65)	(0,04)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Baidu, Inc.	1,000 %	20.12.2025	\$ 500	\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,01
	China Government International Bond	1,000	20.12.2025	2.300	75	7	82	0,05
BRC	Baidu, Inc.	1,000	20.12.2025	500	8	1	9	0,01
	China Cinda Finance Ltd.	1,000	20.12.2025	1.000	9	0	9	0,01
	Indonesia Asahan Aluminium PT	1,000	20.12.2025	800	(7)	6	(1)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	3	0	3	0,00
	Joy Treasure Assets Holdings Inc.	1,000	20.12.2025	1.000	5	1	6	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2025	1.000	6	4	10	0,01
	Philippines Government International Bond	1,000	20.06.2025	200	4	2	6	0,00
	PT Perusahaan Listrik Negara	1,000	20.12.2025	1.000	5	3	8	0,01
	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.	1,000	20.12.2025	1.000	5	1	6	0,00
GST	Country Garden Holdings Co. Ltd.	1,000	20.12.2021	500	(5)	0	(5)	(0,01)
					\$ 117	\$ 25	\$ 142	0,09

(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	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
SCX	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,650 %	05.03.2025	CNY 1.100	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	(0,01)
	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	(4)	(4)	0,00
						\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	(0,01)

### 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
DBL	Zahlung	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 2.596	08.03.2021	\$ 0	\$ 36	\$ 36	0,02

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	03.2021	HKD 9.173	\$ 1.183	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	03.2021	THB 12.469	412	0	(4)	(4)	0,00
BPS	01.2021	€ 89	109	0	0	0	0,00
	02.2021	AUD 755	548	0	(35)	(35)	(0,02)
	02.2021	\$ 84	¥ 8.768	1	0	1	0,00
	03.2021	HKD 2.069	\$ 267	0	0	0	0,00
BRC	03.2021	CNH 7.000	1.066	0	(6)	(6)	0,00
	03.2021	HKD 4.170	538	0	0	0	0,00
CBK	02.2021	\$ 354	RUB 26.226	0	(1)	(1)	0,00
	03.2021	870	CNH 5.811	21	0	21	0,01
	03.2021	990	INR 73.446	8	0	8	0,01
GLM	02.2021	128	RUB 9.754	3	0	3	0,00
	03.2021	CNH 18.230	\$ 2.767	0	(26)	(26)	(0,02)
	03.2021	HKD 15.964	2.059	0	0	0	0,00
	03.2021	\$ 1.064	CNH 7.000	9	0	9	0,01
HUS	01.2021	€ 360	\$ 431	0	(9)	(9)	(0,01)
	01.2021	\$ 4	HKD 34	0	0	0	0,00
	02.2021	AUD 301	\$ 227	0	(6)	(6)	0,00
	02.2021	\$ 409	¥ 42.914	7	0	7	0,01
	02.2021	1.228	RUB 91.171	4	(4)	0	0,00
	03.2021	15	IDR 221.166	0	0	0	0,00
	03.2021	184	TWD 5.149	2	0	2	0,00
IND	02.2021	204	¥ 21.252	2	0	2	0,00
MYI	02.2021	AUD 1.175	\$ 881	0	(28)	(28)	(0,02)
	03.2021	HKD 7.372	951	0	0	0	0,00
	03.2021	THB 23.997	798	0	(3)	(3)	0,00
RBC	03.2021	TWD 12.210	435	0	(5)	(5)	0,00
RYL	03.2021	\$ 345	CNH 2.276	4	0	4	0,00
SCX	01.2021	€ 571	\$ 684	0	(15)	(15)	(0,01)
	02.2021	571	699	0	0	0	0,00
SSB	02.2021	\$ 1.721	¥ 177.245	0	(3)	(3)	0,00
UAG	02.2021	282	RUB 21.472	7	0	7	0,00
	03.2021	HKD 2.961	\$ 382	0	0	0	0,00
	03.2021	TWD 2.742	99	0	0	0	0,00
				\$ 68	\$ (145)	\$ (77)	(0,04)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	SGD 547	\$ 413	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	02.2021	\$ 413	SGD 547	1	0	1	0,00
GLM	01.2021	552	738	7	0	7	0,00
	02.2021	SGD 12	\$ 9	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	1.659	1.247	0	(8)	(8)	(0,01)
	01.2021	\$ 1.210	SGD 1.619	13	0	13	0,01
	02.2021	1.247	1.659	9	0	9	0,01
SSB	01.2021	SGD 18	\$ 14	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 52	SGD 69	1	0	1	0,00
	02.2021	373	496	2	0	2	0,00
UAG	01.2021	SGD 1.827	\$ 1.376	0	(7)	(7)	0,00
	01.2021	\$ 1.216	SGD 1.626	14	0	14	0,01
	02.2021	1.376	1.827	7	0	7	0,00
				\$ 54	\$ (16)	\$ 38	0,02

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 116 0,07

Summe Anlagen

\$ 166.216 99,11

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 1.500 0,89

Nettovermögen

\$ 167.716 100,00

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

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

- 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.

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

(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 - 07.12.2020	\$ 813	\$ 812	0,48

Barmittel in Höhe von USD 223 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	0	132	0	132
<b>Summen</b>	<b>\$ 15.070</b>	<b>\$ 151.146</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 166.216</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 34.275	\$ 0	\$ 34.275
Investmentfonds	3.494	0	0	3.494
Pensionsgeschäfte	0	284	0	284
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(22)	(82)	0	(104)
<b>Summen</b>	<b>\$ 3.472</b>	<b>\$ 34.477</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 37.949</b>

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 47	\$ 0	\$ 47
BPS	(8)	0	(8)
BRC	50	0	50
CBK	28	0	28
DBL	36	0	36
GLM	(7)	0	(7)
GST	(5)	0	(5)
HUS	(6)	0	(6)
IND	2	0	2
MYI	(17)	0	(17)
RBC	(5)	0	(5)
RYL	4	0	4
SCX	(24)	0	(24)
UAG	21	0	21

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	60,35	86,22
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	28,30	2,77
Investmentfonds	9,60	9,08
Pensionsgeschäfte	0,78	0,74
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	(0,06)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	0,00
Freiverkehrsfinaanzderivate	0,07	(0,21)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Australien	2,47	0,56
Bahamas	0,35	0,56
Bermuda	0,27	k. A.
Kanada	k. A.	1,40
Cayman-Inseln	22,62	16,93
China	13,62	14,02
Frankreich	k. A.	0,86
Hongkong	8,63	12,74
Indien	6,36	7,02
Indonesien	8,59	12,81
Japan	0,46	k. A.
Luxemburg	0,28	1,17
Malaysia	2,59	0,52
Mauritius	1,43	1,59
Mongolei	0,82	0,53
Niederlande	0,88	1,23
Pakistan	0,74	k. A.
Philippinen	3,65	2,92
Rumänien	0,31	k. A.
Saudi-Arabien	0,79	k. A.
Singapur	2,40	2,01
Südkorea	3,02	2,98
Sri Lanka	1,11	1,53
Thailand	0,70	1,63
Großbritannien	0,90	1,89
USA	0,46	0,83
Jungferninseln (Britisch)	3,89	3,26
Kurzfristige Instrumente	1,31	0,00
Investmentfonds	9,60	9,08
Pensionsgeschäfte	0,78	0,74
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,00	(0,06)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,01	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,03	0,02
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	(0,01)
Zinsswapoptionen	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,04)	(0,28)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,09	0,12
Zinsswaps	(0,01)	(0,03)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	0,02	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,04)	(0,03)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,02	0,00
Sonstige Aktiva und Passiva	0,89	1,46
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>





# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOS	0,110 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 100.000	U.S. Treasury Bonds 1,125 % fällig am 15.08.2040	\$ (102.407)	\$ 100.000	\$ 100.001	1,26
BPS	0,090	31.12.2020	04.01.2021	27.200	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024	(27.810)	27.200	27.200	0,34
FICC	0,000	31.12.2020	04.01.2021	12.244	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	(12.489)	12.244	12.244	0,15
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (142.706)	\$ 139.444	\$ 139.445	1,75

<sup>(1)</sup> 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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	125	\$ 41	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	358	(131)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	1.386	(805)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	273	42	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	797	(1.012)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	317	(599)	(0,01)
				\$ (2.464)	(0,03)
Summe der an einem gereglten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (2.464)	(0,03)

## 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<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 32 10-Year Index	(1,000) %	20.12.2029	€ 125.000	\$ (851)	(0,01)
iTraxx Europe Senior 32 5-Year Index	(1,000)	20.12.2024	100.000	(651)	(0,01)
				\$ (1.502)	(0,02)

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000 %	17.03.2051	€ 16.200	\$ (55)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	16.06.2051	81.100	159	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031	107.300	310	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.03.2026	73.800	(221)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2026	386.700	1.089	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	£ 164.600	(23)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	16.06.2031	153.800	(1.020)	(0,01)
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.09.2030	26.300	(101)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051	47.800	(153)	0,00
					\$ (15)	0,00
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (1.517)	(0,02)

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Standard Chartered PLC	(1,000)%	20.06.2025	€ 20.000	\$ 799	\$ (1.025)	\$ (226)	(0,01)
JPM	Standard Chartered PLC	(1,000)	20.06.2025	20.000	725	(952)	(227)	0,00
MYC	Standard Chartered PLC	(1,000)	20.06.2025	20.000	810	(1.037)	(227)	0,00
					\$ 2.334	\$ (3.014)	\$ (680)	(0,01)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Intrum AB	5,000 %	20.06.2025	€ 12.600	\$ (715)	\$ 1.748	\$ 1.033	0,01

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Zahlung	BNP FP Dividend Swap	1.614.000	k. A.	€ 5.018	17.12.2021	\$ 0	\$ (1.954)	\$ (1.954)	(0,03)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	€ 250.000	\$ 303.042	\$ 0	\$ (2.918)	\$ (2.918)	(0,03)
BPS	01.2021	AUD 1.812	1.333	0	(65)	(65)	0,00
	01.2021	CAD 1.601	1.235	0	(22)	(22)	0,00
	01.2021	€ 12.101	14.701	3	(109)	(106)	0,00
	01.2021	£ 6.362	8.497	0	(200)	(200)	0,00
	01.2021	\$ 14.831	€ 12.136	28	(9)	19	0,00
	01.2021	£ 8.235	€ 6.110	118	0	118	0,00
	03.2021	SGD 1.238	\$ 917	0	(19)	(19)	0,00
	03.2021	\$ 544	HKD 4.214	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	4.992	€ 4.085	7	0	7	0,00
	01.2021	5.463	£ 4.079	113	0	113	0,00
CBK	01.2021	15.017	€ 12.416	177	0	177	0,00
	01.2021	£ 3.555	€ 2.660	81	0	81	0,00
	03.2021	181	CNH 1.208	4	0	4	0,00
HUS	01.2021	€ 130.364	\$ 156.806	0	(2.714)	(2.714)	(0,03)
	01.2021	£ 96.233	128.591	0	(2.958)	(2.958)	(0,04)
	01.2021	SEK 5.706	671	0	(24)	(24)	0,00
	01.2021	\$ 16.539	€ 13.581	83	(4)	79	0,00
	01.2021	5.304	£ 3.919	53	0	53	0,00
JPM	01.2021	€ 10.217	\$ 12.476	0	(26)	(26)	0,00
MYI	01.2021	229	281	1	0	1	0,00
	01.2021	£ 2.761	3.716	0	(58)	(58)	0,00
	01.2021	SGD 181	137	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 869	AUD 1.126	0	0	0	0,00
	01.2021	166	€ 135	0	0	0	0,00
	01.2021	1.676	£ 1.231	7	0	7	0,00
RBC	01.2021	€ 140.000	\$ 169.820	0	(1.542)	(1.542)	(0,02)
	01.2021	SGD 12	9	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	€ 743	911	1	0	1	0,00
	01.2021	£ 77.371	103.423	0	(2.342)	(2.342)	(0,03)
	01.2021	\$ 3.292	£ 2.450	57	0	57	0,00
SSB	01.2021	£ 796.097	\$ 1.062.650	0	(25.610)	(25.610)	(0,32)
TOR	01.2021	€ 2.108.862	\$ 2.525.560	0	(54.739)	(54.739)	(0,69)
	01.2021	\$ 1.546	£ 1.151	28	0	28	0,00
	02.2021	€ 2.108.862	\$ 2.582.034	0	(22)	(22)	0,00
				\$ 761	\$ (93.381)	\$ (92.620)	(1,16)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 36.563	AUD 49.511	\$ 1.644	\$ 0	\$ 1.644	0,02
BPS	01.2021	4.471	6.078	220	0	220	0,00
BRC	01.2021	202	266	3	0	3	0,00
CBK	01.2021	23	30	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	33.191	44.943	1.491	0	1.491	0,02
JPM	01.2021	9.795	13.313	478	0	478	0,01
MYI	01.2021	AUD 500	\$ 369	0	(17)	(17)	0,00
	01.2021	\$ 854	AUD 1.125	14	0	14	0,00
SCX	01.2021	AUD 342	\$ 263	1	(2)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 8.418	AUD 11.401	380	0	380	0,00
UAG	01.2021	18.956	25.774	933	0	933	0,01
				\$ 5.164	\$ (19)	\$ 5.145	0,06

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	BRL 14.584	\$ 2.882	\$ 74	\$ 0	\$ 74	0,00
	01.2021	\$ 2.806	BRL 14.584	1	0	1	0,00
	02.2021	2.880	14.584	0	(73)	(73)	0,00
BPS	01.2021	BRL 1.306	\$ 251	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 245	BRL 1.306	6	0	6	0,00
BRC	01.2021	BRL 13.863	\$ 2.668	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 2.612	BRL 13.863	57	0	57	0,00
CBK	01.2021	BRL 14.791	\$ 2.921	74	(1)	73	0,00
	01.2021	\$ 2.834	BRL 14.791	13	0	13	0,00
	02.2021	2.881	14.584	0	(74)	(74)	0,00
GLM	01.2021	BRL 229	\$ 45	1	0	1	0,00
	01.2021	\$ 44	BRL 229	0	0	0	0,00
	02.2021	45	229	0	(1)	(1)	0,00
HUS	01.2021	BRL 51	\$ 10	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 10	BRL 51	0	0	0	0,00
	02.2021	10	51	0	0	0	0,00
JPM	01.2021	BRL 229	\$ 44	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 45	BRL 229	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2021	BRL 14.584	\$ 2.881	73	0	73	0,00
	01.2021	\$ 2.806	BRL 14.584	1	0	1	0,00
	02.2021	2.940	14.900	0	(73)	(73)	0,00
SSB	01.2021	2.611	13.863	58	0	58	0,00
TOR	01.2021	BRL 13.197	\$ 2.539	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 2.484	BRL 13.197	56	0	56	0,00
				\$ 414	\$ (225)	\$ 189	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 83	CAD 107	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BPS	01.2021	23	29	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	145	189	3	0	3	0,00
GLM	01.2021	CAD 1	\$ 1	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	1	1	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	\$ 25	CAD 32	1	0	1	0,00
UAG	01.2021	146	189	3	0	3	0,00
				\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 18.334	CHF 16.550	\$ 392	\$ (1)	\$ 391	0,00
BPS	01.2021	1.404	1.246	6	0	6	0,00
BRC	01.2021	98	88	2	0	2	0,00
CBK	01.2021	48	42	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	22.743	20.558	517	0	517	0,01
SCX	01.2021	CHF 51	\$ 58	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 2.186	CHF 1.977	51	0	51	0,00
SSB	01.2021	22.060	19.861	410	0	410	0,01
UAG	01.2021	CHF 84	\$ 94	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 68	CHF 60	0	0	0	0,00
				\$ 1.378	\$ (1)	\$ 1.377	0,02

Zum 31. Dezember 2020 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	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	€ 6.000	\$ 7.370	\$ 28	\$ 0	\$ 28	0,00
BPS	01.2021	3.012	3.655	0	(31)	(31)	0,00
	01.2021	\$ 977.986	€ 816.368	20.896	(14)	20.882	0,26
CBK	01.2021	€ 614	\$ 741	0	(11)	(11)	0,00
	01.2021	\$ 2.851	€ 2.370	49	0	49	0,00
HUS	01.2021	€ 23.750	\$ 28.936	2	(127)	(125)	0,00
	01.2021	\$ 123.318	€ 102.728	2.385	0	2.385	0,03
JPM	01.2021	€ 856	\$ 1.045	0	(2)	(2)	0,00
MYI	01.2021	\$ 221	€ 181	1	0	1	0,00
SCX	01.2021	1.183.033	987.829	25.625	0	25.625	0,32
	02.2021	1.812.975	1.480.719	0	(8)	(8)	0,00
TOR	01.2021	1.115.431	931.382	24.161	0	24.161	0,31
	02.2021	1.522.798	1.243.721	0	(6)	(6)	0,00
				\$ 73.147	\$ (199)	\$ 72.948	0,92

Zum 31. Dezember 2020 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	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	\$ 18.649	£ 13.961	\$ 436	\$ 0	\$ 436	0,01
BPS	01.2021	1.194	894	28	0	28	0,00
BRC	01.2021	£ 34	\$ 47	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 33	£ 24	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	£ 1.207	\$ 1.648	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 53.508	£ 40.029	1.211	0	1.211	0,02
HUS	01.2021	£ 743	\$ 999	0	(16)	(16)	0,00
	01.2021	\$ 68.979	£ 51.572	1.520	0	1.520	0,02
MYI	01.2021	9.345	7.001	225	0	225	0,00
SCX	01.2021	£ 93	\$ 125	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 921	£ 693	27	0	27	0,00
SSB	01.2021	79.315	59.420	1.911	0	1.911	0,02
				\$ 5.359	\$ (19)	\$ 5.340	0,07

Zum 31. Dezember 2020 standen für die ausschüttende Investor RMB (Hedged) Class 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	01.2021	\$ 958	CNH 6.310	\$ 13	\$ 0	\$ 13	0,00
BPS	01.2021	CNH 14.965	\$ 2.293	0	(10)	(10)	0,00
	01.2021	\$ 2.233	CNH 14.658	23	0	23	0,00
	02.2021	CNH 333	\$ 51	0	0	0	0,00
	02.2021	\$ 2.293	CNH 14.992	10	0	10	0,00
BRC	01.2021	38	252	1	0	1	0,00
GLM	01.2021	CNH 15.028	\$ 2.305	0	(8)	(8)	0,00
	02.2021	\$ 2.306	CNH 15.056	8	0	8	0,00
HUS	01.2021	CNH 7.195	\$ 1.102	0	(6)	(6)	0,00
	01.2021	\$ 2.206	CNH 14.547	33	0	33	0,00
	02.2021	1.141	7.463	6	0	6	0,00
SSB	01.2021	216	1.421	3	0	3	0,00
				\$ 97	\$ (24)	\$ 73	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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
BPS	01.2021	SGD 24.222	\$ 18.259	\$ 0	\$ (69)	\$ (69)	0,00
	02.2021	\$ 18.260	SGD 24.222	68	0	68	0,00
BRC	01.2021	105	140	1	0	1	0,00
GLM	02.2021	SGD 418	\$ 316	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	\$ 807	SGD 1.079	9	0	9	0,00
	02.2021	405	538	2	0	2	0,00
MYI	01.2021	SGD 18.064	\$ 13.575	0	(93)	(93)	0,00
	01.2021	\$ 15.127	SGD 20.229	179	0	179	0,00
	02.2021	13.576	18.064	93	0	93	0,00
NGF	01.2021	SGD 29.018	\$ 21.777	0	(179)	(179)	0,00
	01.2021	\$ 13.530	SGD 18.137	193	0	193	0,00
	02.2021	21.778	29.018	179	0	179	0,00
SCX	01.2021	20.559	27.588	315	0	315	0,01
SSB	01.2021	SGD 80	\$ 60	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 2.692	SGD 3.611	40	0	40	0,00
	02.2021	75	100	0	0	0	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Capital Securities 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
UAG	01.2021	SGD 19	\$ 14	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 464	SGD 620	6	0	6	0,00
	02.2021	71	95	1	0	1	0,00
				\$ 1.086	\$ (342)	\$ 744	0,01
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (8.397)	(0,11)
Summe Anlagen						\$ 9.930.551	124,78
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (1.972.229)	(24,78)
Nettovermogen						\$ 7.958.322	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) Nullkuponwertpapier.
- (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
- (c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.
- (d) Mit dem Fonds verbunden.
- (e) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (f) Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.265.911 und Barmittel in Hohe von USD 6.111 als Sicherheiten verpfandet.
- (g) Gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 21.536 und Barmittel in Hohe von USD 40.470 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 5,452 und Barmittel in Hohe von USD 74.587 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Hohe von USD 73.087 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 1.102	\$ 9.024.814	\$ 0	\$ 9.025.916
Investmentfonds	163.747	613.822	0	777.569
Pensionsgeschafte	0	139.444	0	139.444
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(2.464)	(9.914)	0	(12.378)
Summen	\$ 162.385	\$ 9.768.166	\$ 0	\$ 9.930.551

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 1.055	\$ 7.305.533	\$ 0	\$ 7.306.588
Investmentfonds	773.196	0	0	773.196
Pensionsgeschafte	0	989.100	0	989.100
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(648)	(11.403)	0	(12.051)
Summen	\$ 773.603	\$ 8.283.230	\$ 0	\$ 9.056.833

<sup>(1)</sup> Zwecks zusatzlicher Informationen siehe Erlauterung 3 in den Erlauterungen zum Abschluss.

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

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

### Umgekehrte Pensionsgeschafte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Falligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschaften	% des Nettovermogens
BOS	0,380 %	04.12.2020	04.03.2021	\$ (184.786)	\$ (184.841)	(2,32)
BPS	(1,400)	11.07.2019	TBD <sup>(1)</sup>	€ (363)	(435)	(0,01)
	(1,400)	04.01.2021	TBD <sup>(1)</sup>	(368)	(450)	(0,01)
	(0,280)	01.10.2020	11.01.2021	(86.071)	(105.238)	(1,32)
	(0,280)	01.10.2020	18.01.2021	(46.825)	(57.252)	(0,72)

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
	(0,150) %	16.10.2020	20.01.2021	€ (19.443)	\$ (23.782)	(0,30)
	(0,150)	19.10.2020	20.01.2021	(9.189)	(11.239)	(0,14)
	(0,150)	04.12.2020	20.01.2021	(662.553)	(810.572)	(10,18)
	0,440	04.01.2021	08.03.2021	\$ (94.458)	(94.458)	(1,19)
	0,470	15.10.2020	16.02.2021	(201.744)	(201.950)	(2,54)
	0,470	15.12.2020	16.02.2021	(33.176)	(33.184)	(0,42)
	0,480	30.09.2020	04.01.2021	(61.421)	(61.497)	(0,77)
	0,480	21.10.2020	04.01.2021	(32.826)	(32.857)	(0,41)
	0,490	20.10.2020	21.04.2021	(73.373)	(73.446)	(0,92)
	0,490	15.12.2020	21.04.2021	(1.225)	(1.225)	(0,02)
	0,500	23.10.2020	22.02.2021	(7.709)	(7.717)	(0,10)
BRC	(0,950)	20.11.2020	TBD <sup>(1)</sup>	€ (11.168)	(13.650)	(0,17)
	0,390	30.11.2020	01.03.2021	\$ (162.656)	(162.712)	(2,04)
	0,390	22.12.2020	01.03.2021	(20.353)	(20.355)	(0,26)
CFR	(0,150)	21.05.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.539)	(1.538)	(0,02)
IND	0,460	27.10.2020	24.02.2021	(49.727)	(49.769)	(0,62)
	0,480	30.09.2020	25.01.2021	(37.338)	(37.384)	(0,47)
	0,480	30.09.2020	27.01.2021	(40.544)	(40.594)	(0,51)
	0,480	30.09.2020	29.01.2021	(30.115)	(30.153)	(0,38)
	0,580	30.09.2020	25.01.2021	(9.128)	(9.142)	(0,11)
	0,580	30.09.2020	27.01.2021	(13.946)	(13.967)	(0,18)
	0,580	30.09.2020	29.01.2021	(34.746)	(34.798)	(0,44)
SOG	0,500	03.12.2020	03.03.2021	(5.901)	(5.903)	(0,07)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (2.130.472)</b>	<b>(26,77)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (403)	\$ 2.003	\$ 1.600
BPS	18.678	(22.750)	(4.072)
BRC	184	(120)	64
CBK	1.524	(1.370)	154
GST	1.033	(1.110)	(77)
HUS	(265)	431	166
JPM	222	0	222
MYC	(227)	(280)	(507)
MYI	869	(650)	219
NGF	193	(260)	(67)
RBC	(1.542)	2.340	798
SCX	24.105	(30.360)	(6.255)
SSB	(23.188)	19.102	(4.086)
TOR	(30.523)	37.840	7.317
UAG	943	(840)	103

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	95,52	87,76
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	17,78	4,21
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,12	0,00
Investmentfonds	9,77	9,73
Pensionsgeschäfte	1,75	12,45
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,02)	0,12
Freiverkehrsinanzderivate	(0,11)	(0,26)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(26,77)	(14,58)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Österreich	1,50	0,74
Belgien	1,97	2,26
Kanada	0,43	k. A.
Cayman-Inseln	k. A.	0,84
Dänemark	0,47	0,66
Finnland	1,13	0,72
Frankreich	7,32	7,27
Deutschland	4,34	0,72
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,87

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Irland	3,04	0,97
Italien	8,99	6,20
Jersey, Kanalinseln	1,81	2,52
Luxemburg	0,42	1,13
Mexiko	0,31	k. A.
Niederlande	15,00	13,36
Portugal	0,14	0,16
Singapur	k. A.	0,08
Slowenien	0,54	0,29
Spanien	11,74	11,99
Schweden	0,41	k. A.
Schweiz	8,81	6,59
Großbritannien	26,12	26,20
USA	3,40	8,40
Kurzfristige Instrumente	15,53	k. A.
Investmentfonds	9,77	9,73
Pensionsgeschäfte	1,75	12,45
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,03)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	(0,07)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,02)	(0,09)
Zinsswaps	0,00	0,28
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,01)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	(0,12)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,03)	0,00
Devisenterminkontrakte	(1,16)	(0,98)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,08	0,86
Sonstige Aktiva und Passiva	(24,78)	(14,00)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Climate Bond Fund

31. Dezember 2020

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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>								<b>MAURITIUS</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Greeno Solar Mauritius Ltd.								5,950 % fällig am 29.07.2026	\$ 900	\$ 977	0,96
3,400 % fällig am 27.10.2027	AUD	930	0,74					<b>NIEDERLANDE</b>			
<b>BELGIEN</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
KBC Group NV								Cooperative Rabobank UA	500	504	0,50
0,875 % fällig am 27.06.2023	€	300	0,37					1,004 % fällig am 24.09.2026			
<b>KANADA</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
National Bank of Canada								Enel Finance International NV	1.200	1.281	1,26
0,550 % fällig am 15.11.2024	\$	950	0,94					2,650 % fällig am 10.09.2024			
<b>CHILE</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Chile Government International Bond								Givaudan Finance Europe BV	300	392	0,38
0,830 % fällig am 02.07.2031	€	500	0,63					1,000 % fällig am 22.04.2027			
<b>DANEMARK</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AP Moller - Maersk A/S								Global Switch Finance BV	400	511	0,50
4,000 % fällig am 04.04.2025	£	300	0,45					1,375 % fällig am 07.10.2030			
<b>FINNLAND</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nokia Oyj								ING Groep NV	800	942	0,92
2,375 % fällig am 15.05.2025	€	200	0,25					4,625 % fällig am 06.01.2026			
3,125 % fällig am 15.05.2028		500	0,66					4,875 % fällig am 16.05.2029	1.100	1.129	1,11
								(b)(c)			
								LeasePlan Corp. NV	€ 100	127	0,12
								1,375 % fällig am 07.03.2024	700	977	0,96
								3,500 % fällig am 09.04.2025			
								Summe Niederlande		5.863	5,75
								<b>SPANIEN</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	600	780	0,77
								1,375 % fällig am 14.05.2025			
								Bankinter S.A.	400	500	0,49
								0,625 % fällig am 06.10.2027			
								CaixaBank S.A.	400	492	0,48
								0,375 % fällig am 18.11.2026			
								Iberdrola Finanzas S.A.	1.100	1.393	1,37
								1,000 % fällig am 07.03.2024			
								Summe Spanien		3.227	3,17
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Xunta de Galicia	50	62	0,06
								0,084 % fällig am 30.07.2027			
								Summe Spanien		3.227	3,17
								<b>ÜBERNATIONAL</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								EUROFIMA			
								0,000 % fällig am 28.07.2026			
								(a)	100	125	0,12
								0,150 % fällig am 10.10.2034	500	618	0,61
								Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 1.240	1.286	1,26
								1,500 % fällig am 13.02.2025			
								Europäische Union	€ 100	133	0,13
								0,300 % fällig am 04.11.2050			
								Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 1.000	1.071	1,05
								2,125 % fällig am 03.03.2025			
								Summe übernational		3.233	3,17
								<b>SCHWEDEN</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								Castellum AB	€ 900	1.108	1,09
								0,750 % fällig am 04.09.2026			
								<b>SCHWEIZ</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								UBS AG			
								5,125 % fällig am 15.05.2024	\$ 900	994	0,98
								(c)			
								<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								Barclays PLC	€ 600	743	0,73
								0,625 % fällig am 14.11.2023			
								Burberry Group PLC	£ 600	824	0,81
								1,125 % fällig am 21.09.2025			
								Chanel Ceres PLC	€ 400	505	0,49
								1,000 % fällig am 31.07.2031			
								Grainger PLC	£ 600	915	0,90
								3,375 % fällig am 24.04.2028			

# Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Climate 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
HSBC Holdings PLC 3,033 % fällig am 22.11.2023	\$ 400	\$ 421	0,41	Dell International LLC 4,900 % fällig am 01.10.2026 6,200 % fällig am 15.07.2030	\$ 50 1.000	\$ 59 1.302	0,06 1,28	TerraForm Power Operating LLC 5,000 % fällig am 31.01.2028	\$ 850	\$ 957	0,94
Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026 4,500 % fällig am 10.07.2027	£ 800 100	1.119 142	1,10 0,14	Digital Euro Finco LLC 2,500 % fällig am 16.01.2026	€ 100	136	0,13	UDR, Inc. 1,900 % fällig am 15.03.2033 3,100 % fällig am 01.11.2034	900 150	902 169	0,89 0,17
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 1,750 % fällig am 19.05.2032	500	745	0,73	Equinix, Inc. 1,550 % fällig am 15.03.2028	\$ 120	122	0,12	Verizon Communications, Inc. 1,500 % fällig am 18.09.2030	125	123	0,12
Tesco Corporate Treasury Services PLC 2,500 % fällig am 01.07.2024	€ 500	664	0,65	Eversource Energy 1,650 % fällig am 15.08.2030	2.680	2.675	2,63	Weyerhaeuser Co. 7,375 % fällig am 15.03.2032	140	210	0,21
Tesco PLC 5,000 % fällig am 24.03.2023	£ 250	374	0,37	Farmers Exchange Capital 5,454 % fällig am 15.10.2054	30	37	0,04			29.474	28,93
Travis Perkins PLC 3,750 % fällig am 17.02.2026	600	854	0,84	Hanwha Energy USA Holdings Corp. 2,375 % fällig am 30.07.2022	400	411	0,40				
Summe Großbritannien		7.306	7,17	HAT Holdings LLC 3,750 % fällig am 15.09.2030 6,000 % fällig am 15.04.2025	900 500	938 536	0,92 0,53				
<b>USA</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
AES Corp. 2,450 % fällig am 15.01.2031	\$ 1.100	1.116	1,09	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 4,875 % fällig am 15.01.2030	30	33	0,03	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Allstate Corp. 1,450 % fällig am 15.12.2030	250	250	0,24	Host Hotels & Resorts LP 3,500 % fällig am 15.09.2030	1.675	1.768	1,74	New York Water & Sewer System, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 5,724 % fällig am 15.06.2042 5,882 % fällig am 15.06.2044	170 110	262 178	0,26 0,17
Avangrid, Inc. 3,150 % fällig am 01.12.2024 3,200 % fällig am 15.04.2025 3,800 % fällig am 01.06.2029	1.200 260 1.365	1.309 285 1.568	1,28 0,28 1,54	JPMorgan Chase & Co. 0,653 % fällig am 16.09.2024	100	101	0,10	San Francisco, California Public Utilities Commission Water Revenue Bonds, Series 2020 1,988 % fällig am 01.11.2031 2,825 % fällig am 01.11.2041	255 150	264 157	0,26 0,15
Bank of America Corp. 0,981 % fällig am 25.09.2025 2,456 % fällig am 22.10.2025	500 100	506 107	0,50 0,10	Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032	2.000	2.033	2,00	State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020 2,154 % fällig am 01.07.2030	170	179	0,18
Boise Cascade Co. 4,875 % fällig am 01.07.2030	100	108	0,11	Kimco Realty Corp. 2,700 % fällig am 01.10.2030	1.125	1.216	1,19			1.040	1,02
Boston Properties LP 3,400 % fällig am 21.06.2029	1.200	1.341	1,32	Liberty Utilities Finance GP 2,050 % fällig am 15.09.2030	975	982	0,96	<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>			
Bush Foundation 2,754 % fällig am 01.10.2050	125	133	0,13	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,200 % fällig am 02.12.2026 AUD	1.550	1.236	1,21	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025 0,625 % fällig am 30.11.2027	7.490 1.680	7.501 1.680	7,37 1,65
Chubb INA Holdings, Inc. 0,875 % fällig am 15.06.2027	€ 600	773	0,76	Nordstrom, Inc. 4,375 % fällig am 01.04.2030	\$ 300	296	0,29			9.181	9,02
Citigroup, Inc. 1,678 % fällig am 15.05.2024	\$ 225	232	0,23	Owens Corning 3,950 % fällig am 15.08.2029	110	127	0,12	Summe USA		39.695	38,97
Clearway Energy Operating LLC 4,750 % fällig am 15.03.2028 5,000 % fällig am 15.09.2026	100 900	107 935	0,10 0,92	PayPal Holdings, Inc. 2,400 % fällig am 01.10.2024	900	963	0,94	<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>			
Community Preservation Corp. 2,867 % fällig am 01.02.2030	160	168	0,16	Pfizer, Inc. 2,625 % fällig am 01.04.2030	75	84	0,08	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 3,350 % fällig am 01.04.2030 3,950 % fällig am 01.04.2050	325 725	373 886	0,37 0,87	Public Service Co. of Colorado 2,700 % fällig am 15.01.2051 3,200 % fällig am 01.03.2050	75 25	81 29	0,08 0,03	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	907	1.029	1,01
Crown Cork & Seal Co., Inc. 7,375 % fällig am 15.12.2026	525	641	0,63	Radian Group, Inc. 6,625 % fällig am 15.03.2025	500	567	0,56	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 88.461	86,84	
				Regency Centers LP 3,700 % fällig am 15.06.2030	200	227	0,22				
				Rockefeller Foundation 2,492 % fällig am 01.10.2050	120	125	0,12				
				Solar Star Funding LLC 5,375 % fällig am 30.06.2035	172	191	0,19				

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOS	0,100 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 12.100	U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	\$ (12.400)	\$ 12.100	\$ 12.100	11,88
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (12.400)	\$ 12.100	\$ 12.100	11,88

<sup>(1)</sup> 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 March Futures	Short	03.2021	20	\$ 11	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	60	6	0,01
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	2	(4)	(0,01)
				\$ 13	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 13	0,01

**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 <sup>(1)</sup>		6-Month EUR-EURIBOR	0,000 %	16.06.2051	€ 500	\$ 2	0,00
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 2</b>	<b>0,00</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.**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 Nettovermögens
BOA	02.2021	AUD 210	\$ 153	\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	(0,01)
	02.2021	€ 140	166	0	(6)	(6)	(0,01)
	02.2021	£ 2.376	3.148	0	(101)	(101)	(0,10)
	02.2021	\$ 261	€ 214	1	0	1	0,00
BPS	02.2021	AUD 664	\$ 503	0	(9)	(9)	(0,01)
	02.2021	£ 965	1.281	0	(39)	(39)	(0,03)
BRC	02.2021	€ 5.919	7.176	0	(73)	(73)	(0,07)
	02.2021	£ 427	570	0	(14)	(14)	(0,01)
CBK	02.2021	€ 242	289	0	(8)	(8)	(0,01)
GLM	02.2021	AUD 208	152	0	(8)	(8)	(0,01)
	02.2021	€ 3.431	4.066	0	(137)	(137)	(0,13)
JPM	02.2021	£ 206	273	0	(9)	(9)	(0,01)
MYI	02.2021	AUD 1.543	1.152	0	(39)	(39)	(0,04)
	02.2021	€ 6.574	7.989	0	(63)	(63)	(0,06)
RBC	02.2021	\$ 36	£ 27	1	0	1	0,00
	02.2021	142	105	1	0	1	0,00
SSB	02.2021	€ 7.173	\$ 8.673	0	(113)	(113)	(0,11)
	02.2021	£ 211	280	0	(8)	(8)	(0,01)
				<b>\$ 3</b>	<b>\$ (636)</b>	<b>\$ (633)</b>	<b>(0,62)</b>

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 84	CHF 76	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
CBK	01.2021	0	0	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	85	77	2	0	2	0,01
SSB	01.2021	86	77	2	0	2	0,00
				<b>\$ 6</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 6</b>	<b>0,01</b>

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 18.485	€ 15.208	\$ 124	\$ 0	\$ 124	0,12
BPS	01.2021	157	128	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	6.752	5.635	143	0	143	0,14
GLM	01.2021	95	78	0	0	0	0,00
JPM	01.2021	6.250	5.209	124	0	124	0,12
MYI	01.2021	58	48	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	25.162	20.833	330	0	330	0,32
	02.2021	13.748	11.228	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	36.589	30.150	304	0	304	0,30
				<b>\$ 1.025</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 1.025</b>	<b>1,00</b>

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse Institutional 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
BOA	01.2021	\$ 624	£ 462	\$ 7	\$ 0	\$ 7	0,01
BRC	01.2021	148	110	2	0	2	0,00
CBK	01.2021	88	66	2	0	2	0,00
MYI	01.2021	3	2	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	718	532	9	0	9	0,01
SSB	01.2021	724	537	10	0	10	0,01
				\$ 30	\$ 0	\$ 30	0,03
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ 428</b>	<b>0,42</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>\$ 101.004</b>	<b>99,15</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>\$ 865</b>	<b>0,85</b>
<b>Nettovermögen</b>						<b>\$ 101.869</b>	<b>100,00</b>

**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) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar

(c) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von USD 271 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	13	430	0	443
<b>Summen</b>	<b>\$ 13</b>	<b>\$ 100.991</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 101.004</b>

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 18	\$ 0	\$ 18
BPS	(48)	0	(48)
BRC	58	(110)	(52)
CBK	(6)	0	(6)
GLM	(145)	0	(145)
JPM	115	0	115
MYI	(99)	0	(99)
RBC	1	0	1
SCX	339	(380)	(41)
SSB	195	(270)	(75)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%) <sup>(1)</sup>
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	70,37	k. A.
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	15,10	k. A.
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,37	k. A.
Pensionsgeschäfte	11,88	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	k. A.
Freiverkehrsfinanzderivate	0,42	k. A.

<sup>(1)</sup> Der PIMCO Climate Bond Fund wurde am 23. September 2020 aufgelegt.



**Aufstellung der Wertpapieranlagen Commodity Real Return 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
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>			
1,039 % fällig am 21.06.2021				1,123 % fällig am 25.07.2034	\$ 191	\$ 188	0,06	2,838 % fällig am 25.01.2035	\$ 41	\$ 42	0,01
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Chase Mortgage Finance Trust</b>			
Lloyds Banking Group PLC				New Century Home Equity Loan Trust	669	657	0,20	3,022 % fällig am 25.02.2034	10	10	0,00
1,039 % fällig am 21.06.2021	\$ 800	\$ 803	0,25	1,348 % fällig am 25.11.2034	202	188	0,06	3,132 % fällig am 25.11.2034	8	8	0,00
Natwest Group PLC				Residential Asset Securities Corp. Trust	300	300	0,09	3,462 % fällig am 25.09.2034	91	91	0,03
1,801 % fällig am 25.06.2024	600	611	0,19	Saxon Asset Securities Trust	3,000	2.831	0,87	3,800 % fällig am 25.05.2047 ^	10	10	0,00
4,519 % fällig am 25.06.2024	400	437	0,13	0,458 % fällig am 25.09.2037	440	428	0,13	Bear Stearns ALT-A Trust			
		1.851	0,57			13.364	4,11	3,478 % fällig am 25.08.2036 ^	16	10	0,00
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>GreenPoint Mortgage Funding Trust</b>			
Canada Square Funding PLC				Broadcom, Inc.	1.459	1.621	0,50	0,588 % fällig am 25.06.2045	115	104	0,03
1,156 % fällig am 17.10.2051	£ 1.687	2.308	0,71	3,459 % fällig am 15.09.2026	1.459	1.621	0,50	GSR Mortgage Loan Trust			
Finsbury Square PLC				Charter Communications Operating LLC	1.000	1.055	0,32	2,822 % fällig am 25.06.2034	9	9	0,00
1,084 % fällig am 16.09.2069	1.356	1.858	0,57	4,464 % fällig am 23.07.2022	1.000	1.055	0,32	3,201 % fällig am 25.09.2035	3	3	0,00
Great Hall Mortgages PLC				Conagra Brands, Inc.	300	314	0,10	3,328 % fällig am 25.07.2035	86	88	0,03
0,167 % fällig am 18.03.2039	21	29	0,01	3,250 % fällig am 15.09.2022	300	314	0,10	HarborView Mortgage Loan Trust	300	290	0,09
0,187 % fällig am 18.06.2038	25	34	0,01	Cox Communications, Inc.	200	211	0,07	1,052 % fällig am 20.06.2035	300	290	0,09
Hawksmoor Mortgages PLC				3,250 % fällig am 15.12.2022	200	211	0,07	HomeBanc Mortgage Trust	23	23	0,01
1,104 % fällig am 25.05.2053	2.621	3.589	1,11	CVS Health Corp.	500	501	0,15	0,808 % fällig am 25.10.2035	23	23	0,01
Towd Point Mortgage Funding PLC				0,950 % fällig am 09.03.2021	500	501	0,15	Impac CMB Trust	2	2	0,00
1,073 % fällig am 20.10.2051	1.745	2.395	0,74	3,700 % fällig am 09.03.2023	41	44	0,01	1,048 % fällig am 25.10.2033	2	2	0,00
Twin Bridges PLC				Delta Air Lines, Inc.	1.300	1.338	0,41	IndyMac Mortgage Loan Trust	1.958	1.869	0,58
1,204 % fällig am 12.06.2053	1.667	2.284	0,70	3,625 % fällig am 15.03.2022	1.300	1.338	0,41	0,788 % fällig am 25.07.2045	4	3	0,00
		12.497	3,85	Duke Energy Corp.	1.400	1.402	0,43	JPMorgan Mortgage Trust	11	11	0,00
<b>AKTIEN</b>								3,011 % fällig am 25.08.2035	39	39	0,01
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>								3,419 % fällig am 25.04.2035	39	39	0,01
Nationwide Building Society	7.021	1.700	0,52	Lehman Brothers Holdings, Inc.	100	2	0,00	Lehman XS Trust	1.450	1.459	0,45
10,250 %				7,875 % fällig am 08.05.2018 ^	£ 100	2	0,00	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust	1	1	0,00
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								0,599 % fällig am 15.12.2030	1	1	0,00
United Kingdom Gilt				McDonald's Corp.	\$ 1.200	1.203	0,37	New Residential Mortgage Loan Trust	771	837	0,26
0,125 % fällig am 22.03.2026 (c)	£ 10.600	16.984	5,22	0,652 % fällig am 28.10.2021	\$ 1.200	1.203	0,37	4,500 % fällig am 25.05.2058			
0,125 % fällig am 10.08.2028 (c)	3.531	6.099	1,88	Nissan Motor Acceptance Corp.	600	604	0,19	Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates	500	487	0,15
0,125 % fällig am 22.11.2036 (c)	905	1.932	0,59	1,900 % fällig am 14.09.2021	600	604	0,19	1,948 % fällig am 25.04.2035			
1,875 % fällig am 22.11.2022 (c)	2.862	4.284	1,32	Penske Truck Leasing Co. LP	700	747	0,23	Regal Trust	8	8	0,00
		29.299	9,01	4,875 % fällig am 11.07.2022	700	747	0,23	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust	7	8	0,00
Summe Großbritannien		45.347	13,95	Sempra Energy	200	200	0,06	6,500 % fällig am 25.03.2032			
<b>USA</b>								Sequoia Mortgage Trust	945	918	0,28
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>								0,652 % fällig am 20.07.2036	7	7	0,00
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				Time Warner Cable LLC	1.200	1.217	0,37	0,852 % fällig am 19.10.2026	36	37	0,01
1,188 % fällig am 25.12.2033	\$ 1.210	1.198	0,37	4,000 % fällig am 01.09.2021	1.200	1.217	0,37	2,789 % fällig am 20.04.2035			
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Volkswagen Group of America Finance LLC	1.800	1.809	0,56	Structured Asset Mortgage Investments Trust	3	3	0,00
1,188 % fällig am 25.05.2034	97	88	0,03	1,098 % fällig am 24.09.2021	1.800	1.809	0,56	0,732 % fällig am 19.07.2034	16	16	0,01
Asset-Backed Funding Certificates Trust				<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,852 % fällig am 19.03.2034	11	11	0,00
0,748 % fällig am 25.10.2034	456	450	0,14	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates	1	1	0,00
CIT Mortgage Loan Trust				American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010	200	298	0,09	2,181 % fällig am 25.07.2032			
1,498 % fällig am 25.10.2037	478	481	0,15	7,734 % fällig am 15.02.2033	200	298	0,09	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	23	22	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				Bay Area Toll Authority, California Revenue Bonds, (BABs), Series 2010	600	937	0,29	0,768 % fällig am 25.01.2045	121	118	0,04
0,293 % fällig am 25.09.2036	856	823	0,25	6,918 % fällig am 01.04.2040	600	937	0,29	0,888 % fällig am 25.01.2045	238	239	0,08
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009	500	826	0,25	0,928 % fällig am 25.10.2044	2	2	0,00
1,093 % fällig am 25.10.2034	542	538	0,16	7,300 % fällig am 01.10.2039	500	826	0,25	2,009 % fällig am 25.06.2042			
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				7,500 % fällig am 01.04.2034	100	167	0,05				
0,838 % fällig am 25.10.2035 ^	800	757	0,23	7,550 % fällig am 01.04.2039	200	352	0,11				
CoreVest American Finance Trust				Los Angeles Department of Water & Power, California Revenue Bonds, Series 2010	500	636	0,20				
2,968 % fällig am 15.10.2049	103	105	0,03	5,516 % fällig am 01.07.2027	500	636	0,20				
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010	200	275	0,08				
0,678 % fällig am 25.02.2036	770	767	0,24	5,508 % fällig am 01.08.2037	200	275	0,08				
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				New York State Urban Development Corp., Revenue Bonds, (BABs), Series 2009	100	129	0,04				
1,198 % fällig am 25.06.2035	1.995	1.917	0,59	5,770 % fällig am 15.03.2039	100	129	0,04				
Ellington Loan Acquisition Trust				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
1,248 % fällig am 25.05.2037	877	878	0,27	American Home Mortgage Investment Trust	20	20	0,01	Fannie Mae	3	3	0,00
First Franklin Mortgage Loan Trust				1,757 % fällig am 25.09.2045	20	20	0,01	0,718 % fällig am 25.09.2036			
0,458 % fällig am 25.07.2036	87	83	0,03	Banc of America Funding Trust							
Home Equity Asset Trust				2,809 % fällig am 20.09.2034	16	16	0,01				
1,003 % fällig am 25.08.2034	162	161	0,05	BCAP LLC Trust	294	222	0,07				
Mid-State Capital Corp. Trust				5,250 % fällig am 26.04.2037	294	222	0,07				
5,787 % fällig am 15.10.2040	126	136	0,04								
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust											
0,808 % fällig am 25.01.2035	401	390	0,12								

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
6,000 % fällig am 25.02.2044	\$	5	0,00	US-SCHATZOBIGLATIONEN				2,500 % fällig am 15.01.2029	\$	1.951	0,79
6,500 % fällig am 25.06.2028		11	0,00	U.S. Treasury Bonds				3,875 % fällig am 15.04.2029		1.031	0,46
Freddie Mac				1,625 % fällig am 15.11.2050	\$	6.710	6,686	2,06			
0,288 % fällig am 25.09.2031		14	0,00	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)				Summe USA			
0,609 % fällig am 15.12.2031		1	0,00	0,125 % fällig am 15.04.2021		2.669	2,678				
0,659 % fällig am 15.04.2028		7	0,00	0,125 % fällig am 15.01.2022		3.014	3,068	0,82			
0,741 % fällig am 15.03.2024		4	0,00	0,125 % fällig am 15.04.2022 (g)		25.116	25,646	7,89			
0,809 % fällig am 15.03.2032		92	0,03	0,125 % fällig am 15.01.2023 (g)		18.535	19,258	5,92			
2,713 % fällig am 01.01.2034		2	0,00	0,125 % fällig am 15.07.2024 (g)		6.580	7,047	2,17			
5,000 % fällig am 15.01.2035		355	0,13	0,125 % fällig am 15.04.2025		4.738	5,099	1,57			
6,000 % fällig am 15.04.2036		5	0,00	0,125 % fällig am 15.07.2026 (g)		8.049	8,857	2,72			
Ginnie Mae				0,125 % fällig am 15.01.2030 (g)		5.364	5,988	1,84			
0,402 % fällig am 20.02.2035		41	0,01	0,125 % fällig am 15.07.2030		4.164	4,675	1,44			
0,455 % fällig am 20.10.2043		729	0,22	0,250 % fällig am 15.07.2029		1.639	1,857	0,57			
0,599 % fällig am 20.08.2068		841	0,26	0,375 % fällig am 15.07.2023 (g)		4.364	4,624	1,42			
0,642 % fällig am 20.02.2038		22	0,01	0,375 % fällig am 15.07.2025		202	222	0,07			
0,696 % fällig am 20.03.2060		36	0,01	0,375 % fällig am 15.01.2027 (g)		3.460	3,863	1,19			
0,962 % fällig am 20.07.2062		947	0,29	0,375 % fällig am 15.07.2027 (g)		8.281	9,323	2,87			
0,972 % fällig am 20.08.2062		1.334	0,41	0,500 % fällig am 15.04.2024 (g)		16.003	17,158	5,28			
Ginnie Mae, TBA				0,625 % fällig am 15.07.2021 (g)		4.390	4,447	1,37			
2,500 % fällig am 01.03.2051		4.900	5,168	0,625 % fällig am 15.04.2023		2.233	2,352	0,72			
Uniform Mortgage-Backed Security				0,625 % fällig am 15.01.2024 (g)		10.490	11,261	3,46			
5,152 % fällig am 01.11.2034		346	0,11	0,625 % fällig am 15.01.2026 (g)		5.249	5,862	1,80			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				0,750 % fällig am 15.07.2028 (g)		4.077	4,744	1,46			
2,000 % fällig am 01.03.2051		7.800	8,077	0,875 % fällig am 15.01.2029 (g)		5.404	6,355	1,96			
2,500 % fällig am 01.03.2051		3.900	4,099	1,125 % fällig am 15.01.2021		24	24	0,01			
3,000 % fällig am 01.02.2051		8.200	8,599	1,750 % fällig am 15.01.2028 (g)		5.031	6,175	1,90			
3,500 % fällig am 01.02.2051		7.480	7,918	2,125 % fällig am 15.02.2040		458	710	0,22			
4,000 % fällig am 01.02.2051		13.114	14,026	2,125 % fällig am 15.02.2041 (g)		2.140	3,361	1,03			
				2,375 % fällig am 15.01.2025 (g)		14.781	17,277	5,31			
		52.728	16,22								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 2.372	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (2.419)	\$ 2.372	\$ 2.372	0,73
TDM	0,090	31.12.2020	04.01.2021	7.700	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2046	(7.942)	7.700	7.700	2,37
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (10.361)	\$ 10.072	\$ 10.072	3,10

(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 March Futures	Short	03.2021	69	\$ (4)	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	11	(7)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von EUR 114.400 auf Euro-Schatz Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	63	0	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2021	59	7	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2021	90	(73)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	31	1	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	10	(6)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	29	0	0,00
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2021	222	32	0,01
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	3	(1)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2021	155	33	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2021	139	(34)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	91	11	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	117	57	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	155	343	0,10
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	12	(9)	0,00
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	14	(29)	(0,01)
				\$ 321	0,10
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 321	0,10

(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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 200	\$ 15	0,01

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-34 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2025	\$ 92	\$ (14)	(0,01)
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000)	20.12.2025	9.500	(463)	(0,14)
				\$ (477)	(0,15)

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000 %	15.12.2047	\$ 1.750	\$ (337)	(0,10)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,428	20.12.2047	400	(118)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,478	20.12.2047	1.115	(345)	(0,11)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,499	20.12.2047	570	(178)	(0,05)
Erhalt	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	NZD 900	(123)	(0,04)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,394	21.11.2023	\$ 10.100	(10)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 9.900	(2)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051	£ 2.200	(53)	(0,02)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 74.880	(15)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,066	15.02.2024	€ 3.800	98	0,03
Zahlung	CPTFEMU	1,168	15.03.2024	3.300	86	0,03
Zahlung	CPTFEMU	1,475	15.05.2023	1.900	79	0,02
Zahlung	CPTFEMU	1,535	15.06.2023	2.900	137	0,04
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	60	20	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,230	04.11.2021	\$ 5.100	(39)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,280	02.11.2021	3.000	(22)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,290	05.11.2021	9.300	(66)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	1,445	09.09.2021	3.900	9	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,550	26.07.2021	1.100	(18)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	1,580	20.09.2021	3.500	(2)	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,592	20.09.2021	3.100	(2)	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,678	24.05.2021	4.400	(2)	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	1.000	33	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,816	13.05.2021	17.100	(59)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	3.000	76	0,02
Erhalt	CPURNSA	1,927	18.03.2021	1.800	(8)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	700	(9)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	3.600	(28)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,155	17.10.2027	1.900	18	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,210	05.02.2023	5.270	(92)	(0,03)
Erhalt	CPURNSA	2,263	27.04.2023	1.450	(34)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,263	09.05.2023	1.790	(42)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,335	05.02.2028	2.680	91	0,03
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	1.790	72	0,02
Zahlung	CPURNSA	2,360	09.05.2028	2.690	111	0,03
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	2.750	114	0,04
Erhalt	FRCPXTOB	1,030	15.03.2024	€ 3.300	(111)	(0,03)
Erhalt	FRCPXTOB	1,345	15.06.2021	3.700	(109)	(0,03)
Zahlung	FRCPXTOB	1,910	15.01.2038	390	90	0,03
Zahlung	UKRPI	3,100	15.06.2031	£ 2.300	200	0,06
Zahlung	UKRPI	3,330	15.01.2025	16.700	589	0,18
Erhalt	UKRPI	3,330	15.01.2040	600	(31)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,400	15.06.2030	1.610	143	0,04
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	4.100	178	0,05
Zahlung	UKRPI	3,530	15.10.2031	540	42	0,01
					\$ 331	0,10
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (131)</b>	<b>(0,04)</b>

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
HUS	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,315	07.01.2021	4.489	\$ 58	\$ 1	0,00

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	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	\$ 65	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	1.040	79	71	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	600	67	66	0,02
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	560	42	38	0,01
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	600	66	66	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,344	17.11.2022	23.800	27	39	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	900	65	62	0,02
							\$ 347	\$ 407	0,13

##### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.02.2051	\$ 62,000	04.02.2021	8.200	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.02.2051	66,000	04.02.2021	13.114	1	0	0,00
					\$ 1	\$ 0	0,00

##### VERKAUFSoPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250 %	20.01.2021	200	\$ (2)	\$ 0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	1.000	(2)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	1.300	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	3.300	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	1.300	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	3.300	(4)	(3)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	300	0	(1)	0,00
BRC	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	200	0	0	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	1.700	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	1.300	(1)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	700	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	700	(1)	(1)	0,00
						\$ (18)	\$ (13)	0,00

##### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	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 <sup>(1)</sup>	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	\$ (61)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	3.190	(79)	(68)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	1.800	(66)	(66)	(0,02)
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	1.710	(42)	(36)	(0,01)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	19.900	(31)	(26)	(0,01)
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	1.800	(65)	(66)	(0,02)
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	2.700	(65)	(57)	(0,02)
							\$ (348)	\$ (380)	(0,12)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	\$ 102,906	11.03.2021	100	\$ 0	\$ (1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	100	0	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,141	04.03.2021	100	0	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	104,141	04.03.2021	100	0	0	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,406	04.02.2021	1.100	(3)	(4)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,750	04.02.2021	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	103,750	04.02.2021	200	(1)	(1)	0,00
					\$ (6)	\$ (8)	0,00

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
DUB	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 1.500	\$ (104)	\$ 122	\$ 18	0,01
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	1.800	(94)	116	22	0,01
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	700	(1)	7	6	(0,01)
					\$ (199)	\$ 245	\$ 46	0,01

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998 %	20.06.2028	ILS 890	\$ 0	\$ 34	\$ 34	0,01
BRC	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	810	0	30	30	0,01
CKL	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	750	(3)	34	31	0,01
GLM	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	1.430	0	56	56	0,01
HUS	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	610	0	23	23	0,01
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	480	0	18	18	0,01
						\$ (3)	\$ 195	\$ 192	0,06

### 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	BCOMTR Index	151.961	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 24.559	16.02.2021	\$ 0	\$ 760	\$ 760	0,23
CBK	Zahlung	BCOMTR Index	182.528	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	29.499	16.02.2021	0	913	913	0,28
	Zahlung	CIXBSTR3 Index	324.655	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	57.409	16.02.2021	0	1.794	1.794	0,55
CIB	Zahlung	BCOMTR Index	154.350	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	24.945	16.02.2021	0	772	772	0,24
FBF	Zahlung	BCOMTR Index	83.595	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	13.510	16.02.2021	0	418	418	0,13
	Zahlung	BCOMF1TC Index	9.734	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	2.452	16.02.2021	0	75	75	0,02
GST	Zahlung	BCOMTR Index	387.038	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	62.552	16.02.2021	110	1.825	1.935	0,59
	Zahlung	BCOMTR2 Index	56.072	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	9.143	16.02.2021	0	284	284	0,09
	Zahlung	BCOMF1TC Index	421.556	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	55.549	16.02.2021	0	1.704	1.704	0,52
JPM	Zahlung	BCOMTR Index	62.695	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	10.133	16.02.2021	211	102	313	0,10
	Zahlung	JMABDEWU Index	494.170	0,053	78.535	16.02.2021	0	277	277	0,08
MEI	Zahlung	BCOMTR Index	142.977	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	23.107	16.02.2021	0	715	715	0,22
SOG	Zahlung	BCOMTR Index	3.773	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	610	16.02.2021	0	19	19	0,01
								\$ 321	\$ 9.658	\$ 9.979

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	¥ 571.593	\$ 5.496	\$ 0	\$ (40)	\$ (40)	(0,01)
BPS	01.2021	AUD 3.228	\$ 2.374	0	(117)	(117)	(0,04)
	01.2021	CAD 3.551	\$ 2.739	0	(48)	(48)	(0,02)
	01.2021	£ 170	\$ 227	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	\$ 182	€ 149	0	0	0	0,00
	01.2021	£ 341	£ 253	4	0	4	0,00
	02.2021	DKK 24.925	\$ 3.978	0	(122)	(122)	(0,04)
BRC	01.2021	£ 50	\$ 67	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 309	£ 231	7	0	7	0,00
CBK	01.2021	¥ 55.725	\$ 535	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	NZD 2.947	\$ 2.073	0	(49)	(49)	(0,02)
	01.2021	PEN 1.112	\$ 308	1	0	1	0,00
	02.2021	DKK 26.153	\$ 4.191	0	(111)	(111)	(0,03)
	02.2021	PEN 4.124	\$ 1.144	4	0	4	0,00
	05.2021	2.580	716	3	0	3	0,00
GLM	01.2021	\$ 11.325	¥ 1.172.100	29	0	29	0,01
	02.2021	DKK 20.213	\$ 3.242	0	(82)	(82)	(0,03)
	02.2021	ILS 629	\$ 185	0	(10)	(10)	0,00
	02.2021	¥ 1.172.100	\$ 11.328	0	(29)	(29)	(0,01)
	02.2021	\$ 335	DKK 2.030	0	(1)	(1)	0,00
HUS	01.2021	€ 6.407	\$ 7.677	0	(163)	(163)	(0,05)
	01.2021	£ 32.233	\$ 43.109	0	(954)	(954)	(0,29)
	01.2021	¥ 102.947	\$ 988	0	(9)	(9)	0,00
	01.2021	SEK 23.565	\$ 2.770	0	(100)	(100)	(0,03)
	01.2021	\$ 388	£ 287	4	0	4	0,00
JPM	01.2021	AUD 2.474	\$ 1.820	0	(89)	(89)	(0,03)
	01.2021	€ 639	\$ 780	0	(2)	(2)	0,00
MYI	01.2021	222	\$ 272	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	AUD 1.445	\$ 1.064	0	(51)	(51)	(0,02)
	01.2021	€ 84.142	\$ 100.768	0	(2.184)	(2.184)	(0,67)
	01.2021	\$ 2.455	SEK 20.745	71	0	71	0,02
	02.2021	€ 84.142	\$ 103.021	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2021	¥ 441.835	\$ 4.235	0	(44)	(44)	(0,01)
UAG	01.2021	AUD 4.862	\$ 3.574	0	(177)	(177)	(0,05)
	02.2021	DKK 31.181	\$ 4.992	0	(136)	(136)	(0,04)
				\$ 123	\$ (4.530)	\$ (4.407)	(1,36)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2020 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
BPS	01.2021	€ 237	\$ 288	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	01.2021	\$ 17.948	€ 14.882	269	(6)	263	0,08
BRC	01.2021	49	€ 40	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	708	€ 587	11	0	11	0,00
HUS	01.2021	€ 26	\$ 32	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 5.070	€ 4.186	56	(3)	53	0,02
JPM	01.2021	5.215	€ 4.271	11	0	11	0,00
MYI	01.2021	439	€ 360	1	0	1	0,00
SCX	01.2021	15.934	€ 13.305	345	0	345	0,11
	02.2021	33.219	€ 27.131	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	9	€ 7	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	15.023	€ 12.544	325	0	325	0,10
	02.2021	11.025	€ 9.004	0	0	0	0,00
				\$ 1.018	\$ (11)	\$ 1.007	0,31

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 1.911	£ 1.431	\$ 45	\$ 0	\$ 45	0,01
BPS	01.2021	552	£ 413	13	0	13	0,00
BRC	01.2021	£ 101	\$ 135	0	(3)	(3)	0,00
CBK	01.2021	\$ 2.204	£ 1.649	50	0	50	0,02
HUS	01.2021	5.481	£ 4.102	126	0	126	0,04
MYI	01.2021	4.028	£ 2.993	64	0	64	0,02
SSB	01.2021	4.404	£ 3.300	106	0	106	0,03
				\$ 404	\$ (3)	\$ 401	0,12

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 7.224 2,21

Summe Anlagen

\$ 527.081 162,12

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (201.972) (62,12)

Nettovermögen

\$ 325.109 100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Commodity Real Return 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) Nullkuponwertpapier.

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

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 155.363 als Sicherheiten verpfändet.

(h) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.524 und Barmittel in Höhe von USD 1.910 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 1.725 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 3.808 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	321	7.093	0	7.414
<b>Summen</b>	<b>\$ 339</b>	<b>\$ 526.742</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 527.081</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 753.737	\$ 0	\$ 753.737
Investmentfonds	24.077	0	0	24.077
Pensionsgeschäfte	0	29.088	0	29.088
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(44)	3.221	0	3.177
<b>Summen</b>	<b>\$ 24.033</b>	<b>\$ 786.046</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 810.079</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
GRE	0,180 %	28.10.2020	27.01.2021	\$ (78.523)	\$ (78.549)	(24,16)
	0,180	09.11.2020	27.01.2021	(5.766)	(5.767)	(1,78)
	0,180	13.11.2020	13.01.2021	(38.476)	(38.486)	(11,84)
	0,180	29.12.2020	13.01.2021	(3.784)	(3.784)	(1,16)
IND	0,150	16.12.2020	11.02.2021	(15.776)	(15.777)	(4,85)
SCX	0,160	10.12.2020	11.01.2021	(11.186)	(11.187)	(3,44)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (153.550)</b>	<b>(47,23)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 39	\$ 0	\$ 39
BPS	742	(670)	72
BRC	35	0	35
CBK	2.611	(2.090)	521
CIB	772	(380)	392
CKL	31	0	31

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
DUB	\$ 18	\$ (20)	\$ (2)
FBF	418	(270)	148
GLM	(41)	0	(41)
GST	2.314	(1.870)	444
HUS	(1.024)	892	(132)
JPM	2.212	(1.790)	422
MEI	715	(360)	355
MYC	44	(16)	28
MYI	65	20	85
SCX	(1.820)	2.232	412
SOG	19	0	19
SSB	106	0	106
TOR	281	(270)	11
UAG	(313)	290	(23)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	116,55	79,75
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	37,46	53,81
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,73	k. A.
Investmentfonds	0,01	4,26
Pensionsgeschäfte	3,10	5,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,04)	0,12
Freiverkehrsfinaanzderivate	2,21	0,45
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(47,23)	(29,05)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Australien	2,86	1,48
Brasilien	k. A.	0,05
Kanada	0,86	0,46
Cayman-Inseln	3,95	3,48
Dänemark	5,22	4,40
Frankreich	12,47	10,08
Deutschland	0,54	0,31
Guernsey, Kanalinseln	0,15	0,09
Indien	k. A.	0,09
Irland	1,15	0,73
Italien	16,40	7,49
Japan	3,67	2,37
Mexiko	k. A.	0,46
Niederlande	1,65	1,32
Neuseeland	0,68	0,35
Peru	0,62	0,36
Katar	0,20	0,17
Saudi-Arabien	0,11	0,06
Spanien	2,86	3,74
Schweden	0,10	0,46
Schweiz	1,24	0,72
Großbritannien	13,95	8,14
USA	86,92	86,52
Kurzfristige Instrumente	1,14	0,23
Investmentfonds	0,01	4,26
Pensionsgeschäfte	3,10	5,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,10	0,00
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,15)	(0,14)
Zinsswaps	0,10	0,26
Freiverkehrsfinaanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	0,13	0,01
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Inflation-Capped Options	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,12)	(0,02)
Zinsscaps	k. A.	0,00
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,01	0,01
Zinsswaps	0,06	0,03
Total Return Swaps auf Indizes	3,06	0,89
Devisenterminkontrakte	(1,36)	(0,62)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,43	0,16
Sonstige Aktiva und Passiva	(62,12)	(43,53)
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
<b>ÜBER TRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>CHINA</b>				<b>LIBERIA</b>			
<b>ARGENTINIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				New Metro Global Ltd. 7,500 % fällig am 16.12.2021				Royal Caribbean Cruises Ltd. 10,875 % fällig am 01.06.2023			
Argentina Government International Bond 0,125 % fällig am 09.07.2041	\$ 800	\$ 305	0,21	200	206	0,14	11,500 % fällig am 01.06.2025	100	114	0,08	
1,000 % fällig am 09.07.2029	13	5	0,01	<b>KOLUMBIEN</b>				100	117	0,08	
Provincia de Buenos Aires 36,050 % fällig am 12.04.2025	ARS 20	0	0,00	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Liberia			
Summe Argentinien		310	0,22	BanColombia S.A. 3,000 % fällig am 29.01.2025				231 0,16			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>LUXEMBURG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 3,650 % fällig am 10.11.2021				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Virgin Australia Holdings Ltd. 8,125 % fällig am 15.11.2024 ^	\$ 400	33	0,02	100 102 0,07				Cirs Finance International SARL 4,750 % fällig am 22.05.2025			
<b>ÖSTERREICH</b>				<b>FRANKREICH</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Altice France S.A. 3,375 % fällig am 15.01.2028				Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK) 10,000 % fällig am 09.11.2024 ^a)			
Eldorado Intl. Finance GmbH 8,625 % fällig am 16.06.2021	500	508	0,35	€ 300 364 0,25				€ 400 480 0,33			
Sappi Papier Holding GmbH 3,125 % fällig am 15.04.2026	€ 400	478	0,33	\$ 300 314 0,22				\$ 1.309 279 0,20			
Summe Österreich		986	0,68	Summe Frankreich				800 544 0,38			
<b>BERMUDAS</b>				<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
IHS Markt Ltd. 4,250 % fällig am 01.05.2029	\$ 100	122	0,08	Deutsche Bank AG 3,961 % fällig am 26.11.2025				Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 3,398 % fällig am 30.06.2025			
NCL Corp. Ltd. 10,250 % fällig am 01.02.2026	450	527	0,37	800 875 0,60				1.481 1.463 1,01			
Summe Bermuda		649	0,45	150 154 0,11				Summe Luxemburg			
<b>BRASILIEN</b>				<b>FRAPORT</b>				<b>MAURITIUS</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>AG Frankfurt Airport Services Worldwide</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % fällig am 10.01.2025	200	214	0,15	2,125 % fällig am 09.07.2027				Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026			
Banco do Brasil S.A. 4,875 % fällig am 19.04.2023	800	855	0,59	€ 300 393 0,27				500 543 0,38			
Summe Brasilien		1.069	0,74	\$ 500 531 0,37				<b>MEXIKO</b>			
<b>KANADA</b>				<b>IRLAND</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bombardier, Inc. 6,000 % fällig am 15.10.2022	200	197	0,14	AWAS Aviation Capital Ltd. 4,870 % fällig am 02.10.2021 (h)				BBVA Bancomer S.A. 6,750 % fällig am 30.09.2022			
7,500 % fällig am 01.12.2024	100	96	0,07	714 722 0,50				200 216 0,15			
Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % fällig am 29.04.2030	1.000	1.121	0,77	<b>ITALIEN</b>				<b>MULTINATIONAL</b>			
Northriver Midstream Finance LP 5,625 % fällig am 15.02.2026	200	207	0,14	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Summe Kanada		1.621	1,12	Atlantia SpA 1,875 % fällig am 13.07.2027				Axalta Coating Systems LLC 4,750 % fällig am 15.06.2027			
<b>CAYMAN INSELN</b>				<b>JAPAN</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Kaisa Group Holdings Ltd. 11,750 % fällig am 26.02.2021	400	405	0,28	Nissan Motor Co. Ltd. 3,043 % fällig am 15.09.2023				Clear Channel International BV 6,625 % fällig am 01.08.2025			
Melco Resorts Finance Ltd. 5,750 % fällig am 21.07.2028	700	747	0,52	\$ 300 314 0,22				200 212 0,15			
MGM China Holdings Ltd. 5,375 % fällig am 15.05.2024	200	207	0,14	<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
New Metro Global Ltd. 6,800 % fällig am 05.08.2023	200	212	0,15	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^	186	176	0,12	CPUK Finance Ltd. 4,875 % fällig am 28.02.2047				ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026 (e)(g)			
Sands China Ltd. 4,375 % fällig am 18.06.2030	300	335	0,23	€ 400 \$ 548 0,38				200 217 0,15			
5,125 % fällig am 08.08.2025	1.000	1.124	0,78	Heathrow Funding Ltd. 1,875 % fällig am 12.07.2032				LeasePlan Corp. NV 7,375 % fällig am 29.05.2024 (e)(g)			
5,400 % fällig am 08.08.2028	600	704	0,49	€ 250 334 0,23				€ 700 941 0,65			
Seagate HDD Cayman 5,750 % fällig am 01.12.2034	100	118	0,08	Summe Jersey, Kanalinseln				Prosus NV 3,832 % fällig am 08.02.2051			
Tencent Holdings Ltd. 2,390 % fällig am 03.06.2030	200	206	0,14	882 0,61				\$ 300 295 0,20			
3,240 % fällig am 03.06.2050	200	207	0,14	<b>Summe Niederlande</b>				Syngenta Finance NV 5,182 % fällig am 24.04.2028			
Transocean Guardian Ltd. 5,875 % fällig am 15.01.2024	\$ 142	\$ 120	0,08	2.916 2,02				€ 94 115 0,08			
Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 15.01.2026	200	208	0,14	<b>Summe Cayman Inseln</b>				Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 2,800 % fällig am 21.07.2023			
5,500 % fällig am 01.10.2027	400	416	0,29	5.396 3,73				400 397 0,27			
5,625 % fällig am 26.08.2028	200	211	0,15					2.706 1,87			

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des 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	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
<b>NORWEGEN</b>				<b>USA</b>				<b>BESCHREIBUNG</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>								
Adevinta ASA	€	100	125	0,09	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			Boeing Co.	\$	200	242	0,17
2,625 % fällig am 15.11.2025					0,698 % fällig am 25.12.2045	\$	391	\$	288	0,20	0,10	0,10
<b>PERU</b>				<b>ARGENTINA</b>				<b>BOOKING HOLDINGS, INC.</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>ARGENT SECURITIES TRUST</b>				<b>4,625 % fällig am 13.04.2030</b>				
Peru Government International Bond					0,298 % fällig am 25.09.2036	847	376	0,26	100	124	0,09	
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	1.200	414	0,29	0,508 % fällig am 25.04.2036	289	139	0,10	100	113	0,08	
6,150 % fällig am 12.08.2032		100	34	0,02	0,708 % fällig am 25.04.2036	707	349	0,24	100	113	0,08	
6,350 % fällig am 12.08.2028		3.300	1.160	0,80	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			British Airways Pass-Through Trust				
Summe Peru			1.608	1,11	0,698 % fällig am 25.06.2036	369	369	0,26	50	54	0,04	
<b>KATAR</b>				<b>CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST</b>				<b>BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>0,308 % fällig am 25.12.2036</b>				<b>3,900 % fällig am 15.03.2027</b>				
Qatar Government International Bond	\$	400	472	0,33	2.106	1.471	1,02	350	390	0,27		
3,750 % fällig am 16.04.2030					First Franklin Mortgage Loan Trust			Broadcom, Inc.				
<b>RUSSLAND</b>				<b>0,883 % fällig am 25.07.2035</b>				<b>4,150 % fällig am 15.11.2030</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>1,573 % fällig am 25.10.2034</b>				<b>4,250 % fällig am 15.04.2026</b>				
Russia Government International Bond					505	507	0,35	600	688	0,48		
7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB	58.800	897	0,62	GSAMP Trust			Caesars Entertainment, Inc.	700	746	0,52	
8,500 % fällig am 17.09.2031		39.300	638	0,44	0,238 % fällig am 25.01.2037	462	338	0,23	100	106	0,07	
Summe Russland			1.535	1,06	0,268 % fällig am 25.12.2036	617	380	0,26	600	625	0,43	
<b>SINGAPUR</b>				<b>0,378 % fällig am 25.12.2036</b>				<b>6,250 % fällig am 01.07.2025</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>MSTR Asset-Backed Securities Trust</b>				<b>Calpine Corp.</b>				
Flex Ltd.	\$	100	118	0,08	0,628 % fällig am 25.08.2036	556	310	0,21	600	625	0,43	
4,875 % fällig am 15.06.2029					Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			CCO Holdings LLC	50	53	0,04	
<b>SUDAFRIKA</b>				<b>0,208 % fällig am 25.11.2037</b>				<b>4,500 % fällig am 01.05.2032</b>				
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.					0,208 % fällig am 25.11.2037	82	41	0,03	100	106	0,07	
5,872 % fällig am 02.05.2023		700	743	0,51	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			CenterPoint Energy Houston Electric LLC	100	109	0,08	
<b>SPANIEN</b>				<b>0,278 % fällig am 25.01.2037</b>				<b>2,900 % fällig am 01.07.2050</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>0,288 % fällig am 25.10.2036</b>				<b>CF Industries, Inc.</b>				
Abertis Infraestructuras S.A.	€	300	428	0,30	0,298 % fällig am 25.09.2036	2.004	987	0,68	100	127	0,09	
3,000 % fällig am 27.03.2031					0,378 % fällig am 25.09.2036	69	41	0,03	100	104	0,07	
<b>SCHWEDEN</b>				<b>Morgan Stanley Home Equity Loan Trust</b>				<b>Charter Communications Operating LLC</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>0,248 % fällig am 25.04.2037</b>				<b>3,700 % fällig am 01.04.2051</b>				
Intrum AB					76	51	0,04	100	104	0,07		
3,500 % fällig am 15.07.2026		400	487	0,34	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			4,200 % fällig am 15.03.2028	2.200	2.540	1,77	
<b>UKRAINE</b>				<b>5,965 % fällig am 25.09.2046</b>				<b>Cheniere Energy Partners LP</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>3,148 % fällig am 25.01.2033</b>				<b>5,250 % fällig am 01.10.2025</b>				
Ukraine Government International Bond	\$	100	104	0,07	87	81	0,06	300	305	0,21		
7,750 % fällig am 01.09.2021					NovaStar Mortgage Funding Trust			Citizens Financial Group, Inc.	150	169	0,12	
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>0,298 % fällig am 25.09.2036</b>				<b>(e)</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>0,448 % fällig am 25.06.2036</b>				<b>Citrix Systems, Inc.</b>				
HSBC Holdings PLC					1.013	604	0,42	100	111	0,08		
4,600 % fällig am 17.12.2030		300	306	0,21	687	571	0,41	100	111	0,08		
(e)(g)					Option One Mortgage Loan Trust			Community Health Systems, Inc.	200	215	0,15	
Jaguar Land Rover Automotive PLC					0,398 % fällig am 25.03.2037	609	401	0,28	1.000	1.054	0,73	
7,750 % fällig am 15.10.2025		200	216	0,15	Residential Asset Mortgage Products Trust			8,625 % fällig am 15.02.2025	100	104	0,07	
Marks & Spencer PLC	£	200	280	0,19	0,608 % fällig am 25.12.2035	1.388	1.232	0,85	100	104	0,07	
3,750 % fällig am 19.05.2026		300	458	0,32	Residential Asset Securities Corp. Trust			Core & Main Holdings LP (8,625 % bar oder 9,375 % PIK)				
6,000 % fällig am 12.06.2025					1,028 % fällig am 25.08.2034	582	530	0,37	(a)	700	718	0,50
Natwest Group PLC	\$	700	842	0,58	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			CSC Holdings LLC	600	589	0,41	
4,892 % fällig am 18.05.2029		400	492	0,34	1,108 % fällig am 25.01.2036	203	177	0,12	900	942	0,65	
5,076 % fällig am 27.01.2030					Soundview Home Loan Trust			4,125 % fällig am 01.12.2030	100	108	0,07	
<b>ROLLS-ROYCE PLC</b>				<b>0,328 % fällig am 25.07.2037</b>				<b>CyrusOne LP</b>				
<b>4,625 % fällig am 16.02.2026</b>				<b>0,298 % fällig am 25.09.2037</b>				<b>3,450 % fällig am 15.11.2029</b>				
5,750 % fällig am 15.10.2027	£	100	133	0,09	467	398	0,28	1.200	1.274	0,88		
Virgin Media Secured Finance PLC					Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			Delta Air Lines, Inc.	1.000	1.155	0,80	
4,125 % fällig am 15.08.2030		300	419	0,29	0,298 % fällig am 25.09.2037	11.457	7,93	7,000 % fällig am 01.05.2025	1.000	1.155	0,80	
Vmed O2 UK Financing PLC	\$	250	256	0,18	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				1.000	1.155	0,80	
4,250 % fällig am 31.01.2031					Acadia Healthcare Co., Inc.			Diamond Sports Group LLC	400	326	0,23	
Summe Großbritannien			4.009	2,77	5,000 % fällig am 15.04.2029	100	107	0,07	100	116	0,08	
				<b>ADVANTAGE SALES &amp; MARKETING, INC.</b>				<b>ENERGY CORP.</b>				
				<b>6,500 % fällig am 15.11.2028</b>				<b>3,750 % fällig am 15.06.2050</b>				
				<b>ALASKA AIRLINES PASS-THROUGH TRUST</b>				<b>EXPEDIA GROUP, INC.</b>				
				<b>4,800 % fällig am 15.02.2029</b>				<b>3,250 % fällig am 15.02.2030</b>				
				<b>AMERICAN BUILDERS &amp; CONTRACTORS SUPPLY CO., INC.</b>				<b>3,800 % fällig am 15.02.2028</b>				
				<b>4,000 % fällig am 15.01.2028</b>				<b>7,000 % fällig am 15.07.2021</b>				
				<b>AMERICAN HOMES 4 RENT LP</b>				<b>FORD MOTOR CREDIT CO. LLC</b>				
				<b>4,900 % fällig am 15.02.2029</b>				<b>3,087 % fällig am 09.01.2023</b>				
				<b>ANHEUSER-BUSCH COS. LLC</b>				<b>3,219 % fällig am 09.01.2022</b>				
				<b>4,900 % fällig am 01.02.2046</b>				<b>3,550 % fällig am 07.10.2022</b>				
				<b>ARCONIC CORP.</b>				<b>5,125 % fällig am 16.06.2025</b>				
				<b>6,000 % fällig am 15.05.2025</b>				<b>Fortress Transportation &amp; Infrastructure Investors LLC</b>				
				<b>AT&amp;T, Inc.</b>				<b>6,500 % fällig am 01.10.2025</b>				
				<b>3,650 % fällig am 01.06.2051</b>				<b>6,750 % fällig am 15.03.2022</b>				
				<b>AVANTOR FUNDING, INC.</b>				<b>Freedom Mortgage Corp.</b>				
				<b>4,625 % fällig am 15.07.2028</b>				<b>7,625 % fällig am 01.05.2026</b>				
				<b>AVIATION CAPITAL GROUP LLC</b>				<b>8,125 % fällig am 15.11.2024</b>				
				<b>3,500 % fällig am 01.11.2027</b>				<b>100</b>				
				<b>5,500 % fällig am 15.12.2024</b>				<b>225</b>				
				<b>BEACON ROOFING SUPPLY, INC.</b>				<b>100</b>				
				<b>4,500 % fällig am 15.11.2026</b>				<b>238</b>				
								<b>105</b>				
								<b>0,07</b>				
								<b>100</b>				
								<b>125</b>				
								<b>0,09</b>				

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
Gap, Inc. 8,625 % fällig am 15.05.2025 \$	600	\$ 670	0,46	QVC, Inc. 4,850 % fällig am 01.04.2024 \$	200	\$ 216	0,15	IRB Holding Corp. TBD % fällig am 05.02.2025 \$	497	\$ 494	0,34
GE Capital Funding LLC 4,550 % fällig am 15.05.2032	600	721	0,50	Radian Group, Inc. 6,625 % fällig am 15.03.2025	300	340	0,23	MPH Acquisition Holdings LLC 3,750 % fällig am 07.06.2023	323	322	0,22
General Electric Co. 4,250 % fällig am 01.05.2040	800	947	0,65	Radiate Holdco LLC 4,500 % fällig am 15.09.2026	400	413	0,29	NCI Building Systems, Inc. 3,904 % fällig am 12.04.2025	1.559	1.559	1,08
Genworth Holdings, Inc. 7,200 % fällig am 15.02.2021	300	300	0,21	Rattler Midstream LP 5,625 % fällig am 15.07.2025	100	106	0,07	Parexel International Corp. 2,897 % fällig am 27.09.2024	1.193	1.175	0,81
Global Atlantic Fin Co. 4,400 % fällig am 15.10.2029	100	110	0,08	Rio Oil Finance Trust 9,250 % fällig am 06.07.2024	122	135	0,09	Rackspace Hosting, Inc. 4,000 % fällig am 03.11.2023	992	993	0,69
GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2030	1.100	1.197	0,83	Sabine Pass Liquefaction LLC 4,200 % fällig am 15.03.2028	100	115	0,08	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 3,897 % fällig am 16.11.2025	736	734	0,51
5,250 % fällig am 01.06.2025	600	677	0,47	4,500 % fällig am 15.05.2030	400	475	0,33	Sotera Health Holdings LLC 5,500 % fällig am 11.12.2026	955	960	0,66
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 4,000 % fällig am 01.05.2031	100	106	0,07	Scripps Escrow, Inc. 3,875 % fällig am 15.01.2029	100	104	0,07	Spirit AeroSystems, Inc. 6,000 % fällig am 30.01.2025	200	203	0,14
4,875 % fällig am 15.01.2030	800	875	0,61	Shift4 Payments LLC 4,625 % fällig am 01.11.2026	125	130	0,09	TransDigm, Inc. 2,397 % fällig am 09.12.2025	399	392	0,27
Host Hotels & Resorts LP 3,375 % fällig am 15.12.2029	100	103	0,07	SLM Corp. 4,200 % fällig am 29.10.2025	300	318	0,22	USI, Inc. 4,254 % fällig am 02.12.2026	990	991	0,69
3,500 % fällig am 15.09.2030	500	528	0,37	Southwest Airlines Co. 2,625 % fällig am 10.02.2030	200	204	0,14	Zayo Group Holdings, Inc. 3,147 % fällig am 09.03.2027	265	264	0,18
Hudson Pacific Properties LP 4,650 % fällig am 01.04.2029	500	584	0,40	5,250 % fällig am 04.05.2025	1.000	1.159	0,80				
Huntsman International LLC 4,500 % fällig am 01.05.2029	600	692	0,48	Spirit AeroSystems, Inc. 5,500 % fällig am 15.01.2025	100	106	0,07				
Hyatt Hotels Corp. 5,750 % fällig am 23.04.2030	500	616	0,43	7,500 % fällig am 15.04.2025	700	752	0,52				
Infor, Inc. 1,450 % fällig am 15.07.2023	100	102	0,07	Sprint Corp. 7,250 % fällig am 15.09.2021	100	104	0,07	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Jefferies Finance LLC 6,250 % fällig am 03.06.2026	500	520	0,36	7,875 % fällig am 15.09.2023	600	695	0,48	Erie Tobacco Asset Securitization Corp., New York Revenue Bonds, Series 2005			
JPMorgan Chase & Co. 5,000 % fällig am 01.08.2024 (e)	100	105	0,07	Standard Industries, Inc. 4,375 % fällig am 15.07.2030	650	696	0,48	6,000 % fällig am 01.06.2028	100	100	0,07
Kilroy Realty LP 3,050 % fällig am 15.02.2030	350	373	0,26	Stearns Holdings LLC 9,375 % fällig am 15.08.2020	2.157	0	0,00	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Kraft Heinz Foods Co. 4,250 % fällig am 01.03.2031	100	112	0,08	Stifel Financial Corp. 4,000 % fällig am 15.05.2030	100	114	0,08	Banc of America Funding Trust 6,000 % fällig am 25.07.2037	256	241	0,17
Las Vegas Sands Corp. 3,900 % fällig am 08.08.2029	100	108	0,07	Switch Ltd. 3,750 % fällig am 15.09.2028	150	153	0,11	BCAP LLC Trust 0,368 % fällig am 25.05.2047 ^	302	295	0,20
Leidos, Inc. 4,375 % fällig am 15.05.2030	100	120	0,08	Time Warner Entertainment Co. LP 8,375 % fällig am 15.09.2033	100	155	0,11	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,447 % fällig am 25.07.2036 ^	70	68	0,05
Live Nation Entertainment, Inc. 6,500 % fällig am 15.05.2027	1.000	1.120	0,77	TransDigm, Inc. 8,000 % fällig am 15.12.2025	400	443	0,31	Countrywide Alternative Loan Trust 0,342 % fällig am 20.09.2046	15	14	0,01
Manitowoc Co., Inc. 9,000 % fällig am 01.04.2026	500	541	0,37	Triumph Group, Inc. 8,875 % fällig am 01.06.2024	400	440	0,30	0,528 % fällig am 25.09.2046 ^	8	8	0,01
Marriott International, Inc. 3,500 % fällig am 15.10.2032	400	438	0,30	United Airlines Pass-Through Trust 2,700 % fällig am 01.11.2033	296	287	0,20	1,448 % fällig am 25.10.2035 ^	17	13	0,01
4,625 % fällig am 15.06.2030	600	705	0,49	5,875 % fällig am 15.04.2029	200	217	0,15	2,009 % fällig am 25.08.2035	18	17	0,01
MPT Operating Partnership LP 2,550 % fällig am 05.12.2023 £	100	139	0,10	Vail Resorts, Inc. 6,250 % fällig am 15.05.2025	700	748	0,52	5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	380	287	0,20
4,625 % fällig am 01.08.2029 \$	400	428	0,30	VEREIT Operating Partnership LP 3,950 % fällig am 15.08.2027	600	681	0,47	6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	169	158	0,11
MSCI, Inc. 4,000 % fällig am 15.11.2029	100	107	0,07	ViaSat, Inc. 6,500 % fällig am 15.07.2028	100	108	0,07	6,500 % fällig am 25.08.2037 ^	217	272	0,19
Narragansett Electric Co. 3,395 % fällig am 09.04.2030	100	114	0,08	VICI Properties LP 4,250 % fällig am 01.12.2026	100	104	0,07	27,808 % fällig am 25.09.2037	356	502	0,35
Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,125 % fällig am 15.12.2030	100	105	0,07	Western Digital Corp. 4,750 % fällig am 15.02.2026	700	774	0,54	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 3,028 % fällig am 25.09.2037 ^	251	241	0,17
Netflix, Inc. 4,375 % fällig am 15.11.2026	1.000	1.111	0,77	Weyerhaeuser Co. 7,375 % fällig am 15.03.2032	900	1.351	0,93	5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	11	8	0,01
4,875 % fällig am 15.06.2030	400	461	0,32	WP Carey, Inc. 3,850 % fällig am 15.07.2029	100	115	0,08	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 6,000 % fällig am 25.09.2035	270	158	0,11
NiSource, Inc. 3,600 % fällig am 01.05.2030	100	116	0,08	Zayo Group Holdings, Inc. 4,000 % fällig am 01.03.2027	300	301	0,21	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 2,458 % fällig am 29.12.2037	944	730	0,50
Nissan Motor Acceptance Corp. 3,875 % fällig am 21.09.2023	300	320	0,22			55.374	38,33	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust 6,000 % fällig am 25.07.2036	176	140	0,10
Oaktree Specialty Lending Corp. 3,500 % fällig am 25.02.2025	100	104	0,07	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				6,500 % fällig am 25.10.2021 ^	162	60	0,04
Pacific Gas & Electric Co. 2,500 % fällig am 01.02.2031	200	201	0,14	Arches Buyer, Inc. 4,500 % fällig am 06.12.2027	100	100	0,07	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 0,288 % fällig am 25.07.2047	20	19	0,01
3,150 % fällig am 01.01.2026	300	320	0,22	Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 3,250 % fällig am 01.12.2027	200	200	0,14	0,298 % fällig am 25.02.2047	4.205	2.919	2,02
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	100	108	0,07	Calpine Corp. 2,650 % fällig am 16.12.2027	462	460	0,32	0,528 % fällig am 25.10.2036 ^	203	96	0,07
4,550 % fällig am 01.07.2030	200	228	0,16	Core & Main LP 3,750 % fällig am 01.08.2024	800	799	0,55	2,213 % fällig am 25.08.2035 ^	19	18	0,01
PGT Innovations, Inc. 6,750 % fällig am 01.08.2026	700	747	0,52	Elanco Animal Health, Inc. 1,905 % fällig am 01.08.2027	584	580	0,40	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust 2,827 % fällig am 25.08.2035 ^	10	9	0,01
Physicians Realty LP 4,300 % fällig am 15.03.2027	600	666	0,46					Impac Secured Assets Trust 0,298 % fällig am 25.11.2036	324	304	0,21
Prime Healthcare Services, Inc. 7,250 % fällig am 01.11.2025	300	319	0,22					IndyMac Mortgage Loan Trust 0,398 % fällig am 25.02.2037	33	26	0,02
								2,730 % fällig am 25.12.2034	422	424	0,29
								3,548 % fällig am 25.05.2037 ^	90	76	0,05
								JPMorgan Mortgage Trust 6,500 % fällig am 25.07.2036 ^	264	165	0,11
								Lehman XS Trust 0,328 % fällig am 25.07.2037 ^	437	393	0,27
								1,048 % fällig am 25.08.2047 ^	280	248	0,17
								Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2,989 % fällig am 25.11.2037	272	233	0,16

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des 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	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				<b>US-SCHATZobligationen</b>				<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
0,498 % fällig am 25.08.2035 ^ \$	35	\$ 28	0,02	U.S. Treasury Bonds				0,062 % fällig am			
0,898 % fällig am 25.11.2036 ^	765	546	0,38	1,625 % fällig am 15.11.2050	\$ 1.887	\$ 1.881	1,30	12.01.2021 (b)(c)	\$ 1.400	\$ 1.400	0,97
3,490 % fällig am 25.07.2035	4	4	0,00	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				Summe kurzfristige Instrumente		1.403	0,97
4,101 % fällig am 25.12.2035 ^	22	20	0,01	0,250 % fällig am 15.07.2029	1.171	1.326	0,92	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	130.883	90,58
4,420 % fällig am 25.09.2035 ^	1	1	0,00			3.207	2,22				
Residential Asset Securitization Trust											
5,750 % fällig am 25.03.2037 ^	244	139	0,10	<b>AKTIEN</b>				<b>AKTIEN</b>			
6,000 % fällig am 25.02.2036	357	232	0,16	<b>OPTIONSSCHEINE</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	513	301	0,21	Stearns Holdings LLC 'B' -	158.746	0	0,00	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				Exp. 5. November 2039				PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
0,628 % fällig am 25.05.2037 ^	118	118	0,08	Vistra Energy Corp. - Exp. 2.	31.815	12	0,01	US Dollar Short-Term	848.602	8.454	5,84
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Februar 2024				Floating NAV Fund (f)			
0,598 % fällig am 25.05.2035 ^	1.869	1.533	1,06	Summe USA		94.527	65,42	PIMCO Specialty Funds			
		12.387	8,57					Ireland p.l.c. - PIMCO	9.239	120	0,09
								China Bond Fund (f)			
								Summe Investmentfonds	\$	8.981	6,21
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>								<b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>			
Freddie Mac				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				PIMCO ETFs plc - PIMCO			
5,992 % fällig am 25.11.2055	660	401	0,28	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>				US Dollar Short Maturity	4.000	407	0,28
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				(3,480)% fällig am				UCITS ETF (f)			
3,000 % fällig am 01.02.2051	1.300	1.363	0,94	13.09.2021 (b)(c)	ARS 465	3	0,00	Summe Investmentfonds	\$	8.981	6,21
		1.764	1,22								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 495	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (505)	\$ 495	\$ 495	0,34
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (505)	\$ 495	\$ 495	0,34

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

AN EINEM GEREGLTEN 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
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	5	\$ 0	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	8	3	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	195	(54)	(0,04)
				\$ (51)	(0,04)

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHADELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	\$ 169.000	22.01.2021	2	\$ (1)	\$ (1)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	170.000	22.01.2021	1	(1)	(1)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	171.000	22.01.2021	2	(2)	(1)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	177.000	22.01.2021	1	(1)	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	178.000	22.01.2021	2	(2)	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	179.000	22.01.2021	2	(1)	0	0,00
				\$ (8)	\$ (3)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (54)	(0,04)

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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Anheuser-Busch InBev S.A.	(1,000) %	20.12.2023	€ 1.300	\$ (2)	0,00
AutoZone, Inc.	(1,000)	20.06.2024	\$ 1.400	(2)	0,00

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
ConocoPhillips	(1,000) %	20.12.2024	\$ 100	\$ (2)	0,00
Johnson Controls International PLC	(1,000)	20.12.2024	1.500	11	0,01
Kohl's Corp.	(1,000)	20.12.2023	300	(9)	(0,01)
L Brands, Inc.	(1,000)	20.12.2023	350	(23)	(0,02)
Lowe's Cos., Inc.	(1,000)	20.12.2023	700	(1)	0,00
Macy's Retail Holdings, Inc.	(1,000)	20.12.2023	400	16	0,01
Tyson Foods, Inc.	(1,000)	20.06.2024	1.400	6	0,01
				\$ (6)	0,00

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2024	\$ 3.100	\$ 1	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20.12.2021	400	(8)	(0,01)
Bombardier, Inc.	5,000	20.12.2024	200	(21)	(0,02)
DISH DBS Corp.	5,000	20.12.2022	200	0	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	100	1	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 100	11	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	200	(5)	0,00
				\$ (21)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 2.510	\$ (117)	(0,08)
CDX.IG-33 5-Year Index	(1,000)	20.12.2024	1.300	(34)	(0,02)
				\$ (151)	(0,10)

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870 %	03.01.2022	BRL 15.600	\$ (2)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,300	03.01.2022	2.200	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	13.400	19	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	CAD 1.100	20	0,02
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	400	23	0,02
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,588	16.12.2025	CNY 480	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,605	16.12.2025	720	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,611	04.08.2025	400	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,633	10.08.2025	500	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,640	16.07.2025	1.300	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,645	15.07.2025	1.700	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,650	21.08.2025	400	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,671	16.12.2025	1.430	0	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,803	17.03.2026	1.800	2	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,810	17.03.2026	1.000	1	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,848	17.03.2026	300	0	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,873	17.03.2026	300	0	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,884	17.03.2026	1.000	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	\$ 2.200	47	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	04.11.2050	200	(6)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,400	04.01.2051	200	3	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,848	17.12.2025	ZAR 6.700	2	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,025	04.12.2025	17.700	16	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031	€ 1.600	2	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	£ 11.200	(7)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	16.06.2031	900	(8)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051	2.200	(53)	(0,04)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.09.2027	¥ 94.200	(18)	(0,01)
					\$ 45	0,03
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (133)</b>	<b>(0,09)</b>

<sup>(1)</sup> 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 Rückertlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> 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.

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

<sup>(3)</sup> 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.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	260	\$ 29	\$ 29	0,02
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	180	20	20	0,01
							\$ 49	\$ 49	0,03

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.01.2021	300	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	100	0	0	0,00
BPS	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450	20.01.2021	600	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	900	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	100	0	0	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	100	0	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	300	0	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	200	0	0	0,00
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	200	0	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	700	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	300	0	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	700	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	300	0	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	600	(1)	0	0,00
	DUB	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	300	(1)	0
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,700	17.03.2021	200	0	0	0,00
Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Kauf	0,375	21.04.2021	500	0	0	0,00
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,750	21.04.2021	500	(1)	(1)	0,00
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,800	21.04.2021	100	0	0	0,00
Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index		Verkauf	0,950	20.01.2021	100	0	0	0,00
Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index		Verkauf	0,900	17.02.2021	100	0	0	0,00
Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index		Verkauf	1,000	21.04.2021	100	0	0	0,00
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,900	20.01.2021	300	(1)	0	0,00
Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Kauf	0,425	17.02.2021	300	0	0	0,00
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,800	17.02.2021	300	0	0	0,00
FBF		Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	100	0	0
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	17.02.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	300	(1)	0	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	400	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	300	0	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	300	0	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	500	0	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	300	0	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	300	0	0	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	100	0	0	0,00
MYC	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	200	0	0	0,00
						\$ (21)	\$ (11)	(0,01)

## DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
HUS	Put - OTC USD versus CNH	CNH 6,420	26.02.2021	300	\$ (2)	\$ (1)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6,660	26.02.2021	300	(1)	(1)	0,00
					\$ (3)	\$ (2)	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175 %	15.03.2023	790	\$ (29)	\$ (29)	(0,02)
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,012	14.01.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,015	14.01.2021	200	(2)	(1)	0,00
DUB	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,298	11.01.2021	200	(2)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,598	11.01.2021	200	(2)	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,830	22.01.2021	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,070	22.01.2021	300	(1)	(1)	0,00
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	550	(20)	(20)	(0,02)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,100	19.01.2021	200	(2)	0	0,00
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,460	19.01.2021	200	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,210	04.01.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,510	04.01.2021	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,165	11.01.2021	300	(2)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,280	11.01.2021	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,485	11.01.2021	300	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,580	11.01.2021	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,110	15.01.2021	200	(2)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,450	15.01.2021	200	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,131	19.01.2021	200	(2)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,491	19.01.2021	200	(2)	(2)	0,00
	NGF	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,270	07.01.2021	200	(2)	0
Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap		3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,570	07.01.2021	200	(2)	0	0,00
					\$ (82)	\$ (59)	(0,04)		

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens	
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	\$ 102,141	04.03.2021	300	\$ (1)	\$ (1)	0,00	
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	200	(1)	0	0,00	
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	100	0	(1)	0,00	
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	100	0	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,188	04.02.2021	100	0	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,266	04.02.2021	100	0	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	200	(1)	0	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,141	04.03.2021	100	0	0	0,00	
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	104,141	04.03.2021	100	0	0	0,00	
	SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,406	04.02.2021	200	(1)	(1)	0,00
						\$ (4)	\$ (3)	0,00

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Mexico Government International Bond	(1,000) %	20.12.2023	\$ 2.200	\$ 25	\$ (66)	\$ (41)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% 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	3	4	0,00
FBF	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	100	0	1	1	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	1	10	11	0,01
					\$ 2	\$ 16	\$ 18	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(3)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% 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	(2)	21	0,01
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	300	39	(9)	30	0,02
					\$ 72	\$ (10)	\$ 62	0,04

## Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Credit Opportunities 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 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	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	\$ 669	¥ 69.590	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
	01.2021	155	PLN 598	6	0	6	0,00
BPS	01.2021	€ 414	\$ 502	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	PEN 133	37	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	\$ 52	PLN 203	2	0	2	0,00
	02.2021	RUB 21.534	\$ 292	2	0	2	0,00
	01.2021	PEN 5.391	1.502	12	0	12	0,01
	01.2021	RUB 2.149	28	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 65	¥ 6.784	1	0	1	0,00
	02.2021	PEN 2.936	\$ 819	8	0	8	0,01
	02.2021	RUB 9.482	127	0	(1)	(1)	0,00
	03.2021	CNH 804	121	0	(2)	(2)	0,00
	03.2021	\$ 365	MXN 7.461	6	0	6	0,00
	05.2021	304	COP 1.113.540	21	0	21	0,02
DUB	05.2021	805	PEN 2.901	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	PEN 250	\$ 69	0	0	0	0,00
GLM	01.2021	BRL 708	136	0	0	0	0,00
	01.2021	¥ 142.700	1.379	0	(3)	(3)	0,00
HUS	01.2021	RUB 2.675	35	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 140	BRL 708	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	142	ZAR 2.164	5	0	5	0,00
	02.2021	RUB 9.441	\$ 124	0	(3)	(3)	0,00
	02.2021	\$ 1.379	¥ 142.700	4	0	4	0,00
	01.2021	BRL 1.714	\$ 338	8	0	8	0,01
	01.2021	£ 1.561	2.088	0	(46)	(46)	(0,03)
	01.2021	\$ 330	BRL 1.714	0	0	0	0,00
	01.2021	120	¥ 12.533	1	0	1	0,00
	01.2021	106	MXN 2.118	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	132	PLN 503	3	0	3	0,00
	02.2021	RUB 11.703	\$ 157	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$ 338	BRL 1.714	0	(8)	(8)	(0,01)
	03.2021	165	IDR 2.363.703	4	0	4	0,00
	01.2021	€ 12	\$ 15	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 10	€ 8	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	10	PLN 37	0	0	0	0,00
	01.2021	BRL 573	\$ 110	0	0	0	0,00
	01.2021	€ 3.390	4.060	0	(89)	(89)	(0,06)
	01.2021	\$ 113	BRL 573	0	(3)	(3)	0,00
SSB	02.2021	€ 3.390	\$ 4.151	0	0	0	0,00
	03.2021	\$ 283	INR 21.084	4	0	4	0,00
	01.2021	82	BRL 434	2	0	2	0,00
TOR	01.2021	516	¥ 53.792	5	0	5	0,00
UAG	02.2021	RUB 27.863	\$ 368	0	(7)	(7)	0,00
				\$ 99	\$ (178)	\$ (79)	(0,05)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 8.316	CHF 7.507	\$ 178	\$ 0	\$ 178	0,13
MYI	01.2021	8.271	7.491	204	0	204	0,14
SCX	01.2021	105	95	3	0	3	0,00
SSB	01.2021	8.339	7.515	163	0	163	0,11
				\$ 548	\$ 0	\$ 548	0,38

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilklassen Institutional 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
BPS	01.2021	€ 34	\$ 41	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 20.101	€ 16.783	434	0	434	0,30
CBK	01.2021	€ 35	\$ 42	0	(1)	(1)	0,00
HUS	01.2021	€ 600	\$ 729	0	(6)	(6)	0,00
	01.2021	\$ 585	€ 480	4	(1)	3	0,00
JPM	01.2021	€ 1	\$ 1	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	\$ 22.051	€ 18.412	477	0	477	0,33
	02.2021	33.524	27.380	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	€ 20.791	\$ 17.360	450	0	450	0,31
	02.2021	30.738	25.105	0	0	0	0,00
				\$ 1.365	\$ (8)	\$ 1.357	0,94
<b>Summe Freiverkehrsfinaizderivate</b>						<b>\$ 1.839</b>	<b>1,27</b>

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	\$ 500	\$ (519)	(0,36)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (519)</b>	<b>(0,36)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 141.492</b>	<b>97,91</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ 3.020</b>	<b>2,09</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 144.512</b>	<b>100,00</b>

## 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 mit Sachwertausschüttung.  
 (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	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
AWAS Aviation Capital Ltd.	4,870 %	02.10.2021	02.10.2014	\$ 714	\$ 722	0,50

Barmittel in Höhe von USD 3.615 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(54)	1.706	0	1.652
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(519)	0	(519)
<b>Summen</b>	<b>\$ 8.532</b>	<b>\$ 131.837</b>	<b>\$ 1.123</b>	<b>\$ 141.492</b>

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

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 69	\$ 129.730	\$ 3.703	\$ 133.502
Investmentfonds	12.948	0	0	12.948
Pensionsgeschäfte	0	848	0	848
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	56	1.423	0	1.479
<b>Summen</b>	<b>\$ 13.073</b>	<b>\$ 132.001</b>	<b>\$ 3.703</b>	<b>\$ 148.777</b>

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 188	\$ 0	\$ 188
BPS	426	(530)	(104)
BRC	6	0	6
CBK	8	0	8
FAR	(1)	0	(1)
FBF	11	0	11
GLM	(4)	0	(4)
GST	19	0	19
HUS	(44)	0	(44)
JPM	27	0	27
MYC	(5)	0	(5)
MYI	204	0	204
SAL	(1)	0	(1)
SCX	392	(490)	(98)
SSB	165	0	165
TOR	455	(330)	125
UAG	(7)	0	(7)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	34,68	22,42
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	49,69	66,97
Sonstige übertragbare Wertpapiere	6,21	k. A.
Investmentfonds	6,21	8,67
Pensionsgeschäfte	0,34	0,57
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,04)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,09)	0,13
Freiverkehrsfinauzderivate	1,27	0,82
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,36)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Argentinien	0,22	0,26
Australien	0,02	k. A.
Österreich	0,68	0,65
Bermuda	0,45	k. A.
Brasilien	0,74	1,75
Kanada	1,12	0,56
Cayman-Inseln	3,73	7,66
China	0,14	0,13
Kolumbien	0,14	k. A.
Curacao	0,07	0,07
Frankreich	0,47	0,21
Deutschland	1,35	1,01
Guernsey, Kanalinseln	0,54	0,49
Hongkong	k. A.	0,47
Indien	0,29	1,51
Irland	0,50	1,26
Italien	0,87	k. A.
Japan	0,22	k. A.
Jersey, Kanalinseln	0,61	k. A.
Liberia	0,16	k. A.

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Luxemburg	2,21	6,14
Mauritius	0,38	0,61
Mexiko	0,15	k. A.
Multinational	0,45	0,78
Niederlande	2,02	1,35
Norwegen	0,09	k. A.
Peru	1,11	k. A.
Katar	0,33	k. A.
Russland	1,06	0,90
Singapur	0,08	0,07
Südafrika	0,51	0,97
Spanien	0,30	k. A.
Schweden	0,34	0,31
Schweiz	k. A.	1,02
Ukraine	0,07	0,07
Großbritannien	2,77	3,65
USA	65,42	57,49
Kurzfristige Instrumente	0,97	0,00
Investmentfonds	6,21	8,67
Pensionsgeschäfte	0,34	0,57
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,04)	0,04
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	(0,09)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,10)	(0,01)
Zinsswaps	0,03	0,20
Freiverkehrsinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,03	0,11
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,04)	(0,10)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
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	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,04	0,07
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	(0,28)
Devisenterminkontrakte	(0,05)	(0,05)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,32	1,10
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,36)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	2,09	0,38
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
<b>CHINA</b>				<b>FRANKREICH</b>				<b>DEUTSCHLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bank of China Ltd. 0,988 % fällig am 24.06.2023 1,250 % fällig am 24.06.2025	\$ 25.600 42.400	\$ 25.522 42.428	0,14 0,23	Altareit S.C.A. 2,875 % fällig am 02.07.2025	€ 100	\$ 131	0,00	2,625 % fällig am 12.02.2026 3,375 % fällig am 12.05.2021 3,547 % fällig am 18.09.2031 3,700 % fällig am 30.05.2024 3,875 % fällig am 12.02.2024	€ 5.500 \$ 7.400 19.400 14.400 £ 20.800	\$ 7.390 7.467 21.068 15.508 30.808	0,04 0,04 0,11 0,08 0,17
CNPC Global Capital Ltd. 1,125 % fällig am 23.06.2023 Eastern Creation Investment Holdings Ltd. 1,000 % fällig am 10.09.2023	31.700 13.900	31.755 13.858	0,17 0,07	Altice France S.A. 2,125 % fällig am 15.02.2025 3,375 % fällig am 15.01.2028 7,375 % fällig am 01.05.2026 8,125 % fällig am 01.02.2027	3.800 3.200 \$ 54.511 400	4.497 3.882 57.441 441	0,02 0,02 0,31 0,00	3,950 % fällig am 27.02.2023 3,961 % fällig am 26.11.2025 4,250 % fällig am 14.10.2021 4,500 % fällig am 01.04.2025 (j) 5,000 % fällig am 14.02.2022 5,625 % fällig am 19.05.2031 5,882 % fällig am 08.07.2031 (j) 6,000 % fällig am 30.10.2025	\$ 1.100 26.600 63.075 5.800 9.900 € 5.000 \$ 42.900	1,169 29,096 64,694 6,294 10,354 7,087 51,530	0,01 0,16 0,35 0,03 0,06 0,04 0,28
New Metro Global Ltd. 4,800 % fällig am 15.12.2024 6,500 % fällig am 23.04.2021	14.900 3.200	15.161 3.231	0,08 0,02	Auchan Holding S.A. 3,250 % fällig am 23.07.2027	€ 28.100	39.690	0,21	6,000 % fällig am 30.10.2025 (h)(j)	3.000	3.015	0,02
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 2,150 % fällig am 13.05.2025 2,750 % fällig am 03.05.2021	32.100 2.192	33.099 2.205	0,18 0,01	BNP Paribas S.A. 0,223 % fällig am 07.06.2024 1,904 % fällig am 30.09.2028 2,219 % fällig am 09.06.2026 2,819 % fällig am 19.11.2025 3,500 % fällig am 16.11.2027 4,400 % fällig am 14.08.2028 4,705 % fällig am 10.01.2025 5,198 % fällig am 10.01.2030	\$ 38.500 5.800 1.000 1.400 2.200 58.900 4.600	39,203 6,074 1,066 1,572 2,611 65,519 5,711	0,21 0,03 0,01 0,01 0,01 0,35 0,03	IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK) 3,625 % fällig am 15.05.2025 (d) € IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (d) €	7.600 34.750	9,507 43,821	0,05 0,24
State Grid Overseas Investment Ltd. 1,303 % fällig am 05.08.2032	€ 1.200	1.537	0,01	BPCE S.A. 0,000 % fällig am 11.01.2023 2,375 % fällig am 14.01.2025 3,000 % fällig am 22.05.2022	€ 1.800 \$ 3.700 7.000	2.212 3.913 7.246	0,01 0,02 0,04	INEOS Styrolution Group GmbH 2,250 % fällig am 16.01.2027 (l)	24.000	28.547	0,15
Summe China		168.796	0,91	Summe Frankreich		422.246	2,26	Infineon Technologies AG 1,125 % fällig am 24.06.2026 2,000 % fällig am 24.06.2032	1.500 3.400	1.939 4.737	0,01 0,03
<b>KOLUMBIEN</b>				<b>CEETRUS S.A.</b>				<b>MTU Aero Engines AG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Ecopetrol S.A. 5,875 % fällig am 28.05.2045	\$ 200	242	0,00	2,750 % fällig am 26.11.2026	€ 200	265	0,00	3,000 % fällig am 01.07.2025	1.900	2.535	0,01
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>CREDIT AGRICOLE S.A.</b>				<b>PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE</b>			
Colombia Government International Bond 5,000 % fällig am 15.06.2045 5,625 % fällig am 26.02.2044 6,125 % fällig am 18.01.2041 7,375 % fällig am 18.09.2037 10,375 % fällig am 28.01.2033	59.520 2.600 100 100 950	72.838 3.376 135 146 1.539	0,39 0,02 0,00 0,00 0,01	0,375 % fällig am 21.10.2025 1,907 % fällig am 16.06.2026	€ 100 \$ 15.650	125 16.250	0,00 0,09	2,625 % fällig am 15.04.2021	4.900	6.001	0,03
Summe Kolumbien		78.276	0,42	Electricite de France S.A. 4,500 % fällig am 21.09.2028	6.600	7.883	0,04	Schaeffler AG 2,750 % fällig am 12.10.2025 3,375 % fällig am 12.10.2028	5.400 6.100	7,013 8,238	0,04 0,04
<b>CURACAO</b>				<b>HOLDING D'INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT SASU</b>				<b>SIXT SE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 3,650 % fällig am 10.11.2021	39.401	40.002	0,21	1,625 % fällig am 18.09.2029	€ 2.900	3.778	0,02	1,750 % fällig am 09.12.2024	11.400	14.215	0,08
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>				<b>INDIGO GROUP S.A.S.</b>				<b>THYSSENKRUPP AG</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Dominican Republic Government International Bond 4,875 % fällig am 23.09.2032 6,500 % fällig am 15.02.2048 6,850 % fällig am 27.01.2045 6,875 % fällig am 29.01.2026	24.300 42.300 18.800 1.800	26.973 50.126 23.007 2.176	0,15 0,27 0,12 0,01	1,625 % fällig am 19.04.2028	100	127	0,00	1,875 % fällig am 06.03.2023	1.900	2.331	0,01
Summe Dominikanische Republik		102.282	0,55	La Mondiale SAM 5,050 % fällig am 17.12.2025 (h)	15.065	21.354	0,12	Volkswagen Bank GmbH 1,250 % fällig am 10.06.2024 1,875 % fällig am 31.01.2024 2,500 % fällig am 31.07.2026	18.000 100 18.600	22,839 129 25,437	0,12 0,00 0,14
<b>ECUADOR</b>				<b>LOXAM S.A.S.</b>				<b>VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Ecuador Government International Bond 0,000 % fällig am 31.07.2030 (f) 0,500 % fällig am 31.07.2030 0,500 % fällig am 31.07.2035 0,500 % fällig am 31.07.2040	3.989 12.531 32.838 15.050	1.905 8.113 17.938 7.657	0,01 0,04 0,10 0,04	3,250 % fällig am 14.01.2025 3,750 % fällig am 15.07.2026 5,750 % fällig am 15.07.2027	3.700 9.700 250	4.550 12.106 310	0,03 0,07 0,00	0,625 % fällig am 01.04.2022 0,875 % fällig am 12.04.2023 3,375 % fällig am 06.04.2028	500 1.600 4.500	618 1,995 6,610	0,00 0,01 0,04
Summe Ecuador		35.613	0,19	Summe Deutschland		665.254	3,57	Summe Deutschland		665.254	3,57
<b>ÄGYPTEN</b>				<b>RCI BANQUE S.A.</b>				<b>GHANA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Egypt Government International Bond 4,750 % fällig am 11.04.2025 5,625 % fällig am 16.04.2030 6,375 % fällig am 11.04.2031 7,600 % fällig am 01.03.2029 8,500 % fällig am 31.01.2047	€ 18.100 2.650 34.700 \$ 600 10.700	23.111 3.405 45.782 692 12.162	0,12 0,02 0,25 0,00 0,07	0,124 % fällig am 14.03.2022	400	490	0,00	Ghana Government International Bond 7,875 % fällig am 26.03.2027 8,125 % fällig am 26.03.2032 8,750 % fällig am 11.03.2061 8,950 % fällig am 26.03.2051	\$ 5.600 5.200 5.600 5.500	6,175 5,521 5,782 5,753	0,03 0,03 0,03 0,03
Summe Ägypten		85.152	0,46	Renault S.A. 1,250 % fällig am 24.06.2025 2,375 % fällig am 25.05.2026	15.700 65.400	18.838 81.120	0,10 0,44	Summe Ghana		23.231	0,12
<b>FINNLAND</b>				<b>SOCIETE GENERALE S.A.</b>				<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nokia Oyj 3,125 % fällig am 15.05.2028	€ 16.100	21.706	0,12	4,000 % fällig am 22.01.2027	\$ 700	790	0,00	Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust 5,250 % fällig am 30.05.2025	395	370	0,00
Summe Finnland				Summe Guernsey, Kanalinseln		83.691	0,45	Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust 5,125 % fällig am 30.11.2024	6.938	6.566	0,04
<b>HONGKONG</b>				<b>DEUTSCHE BANK AG</b>				<b>HONGKONG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AIA Group Ltd. 3,375 % fällig am 07.04.2030	\$ 4.600	5.176	0,03	0,287 % fällig am 16.05.2022 1,000 % fällig am 19.11.2025 1,375 % fällig am 03.09.2026 1,411 % fällig am 16.11.2022 1,463 % fällig am 27.02.2023 1,625 % fällig am 20.01.2027 1,750 % fällig am 17.01.2028 1,750 % fällig am 19.11.2030 2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 5.100 12.700 16.900 \$ 2.000 1.700 € 13.000 7.600 17.200 £ 11.200	6,263 15,796 21,362 2,005 1,696 16,635 9,808 22,138 16,152	0,03 0,08 0,11 0,01 0,01 0,09 0,05 0,12 0,09	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,875 % fällig am 20.06.2022 2,950 % fällig am 29.07.2026 3,000 % fällig am 29.03.2025	€ 4.500 8.600 46.439	5,680 11,082 60,064	0,03 0,06 0,32
CNOOC Finance Ltd. 3,000 % fällig am 09.05.2023	17.700	18.422	0,10	Summe Hongkong				Summe Hongkong, Kanalinseln		83.762	0,45

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified 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
Far East Horizon Ltd. 3,375 % fällig am 18.02.2025	\$ 4.000	\$ 4.046	0,02	4,450 % fällig am 01.10.2025	\$ 400	\$ 446	0,00	Unipol Gruppo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2030	€ 16.800	\$ 21.800	0,12
Fortune Star BVI Ltd. 5,950 % fällig am 19.10.2025	20.400	21.408	0,11	4,450 % fällig am 03.04.2026	6.050	6.792	0,04	Summe Italien		615.527	3,30
Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023 3,250 % fällig am 03.06.2021	49.100 2.050	49.499 2.062	0,27 0,01	4,625 % fällig am 15.10.2027	44.150	50.053	0,27	<b>ELFENBEINKÜSTE STAATSEMISSIONEN</b>			
Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030	6.900	7.261	0,04	AIB Group PLC 6,250 % fällig am 23.06.2025 (h)(j)	€ 6.600	8.954	0,05	Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	400	526	0,00
Summe Hongkong		107.874	0,58	Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025 (h)(j)	17.100	24.004	0,13	5,875 % fällig am 17.10.2031	3.450	4.672	0,03
<b>INDIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				GE Capital International Funding Co. Unlimited Co. 3,373 % fällig am 15.11.2025	\$ 300	333	0,00	6,625 % fällig am 22.03.2048	300	407	0,00
Adani Electricity Mumbai Ltd. 3,949 % fällig am 12.02.2030	3.800	4.040	0,02	4,418 % fällig am 15.11.2035	9.100	10.873	0,06	6,875 % fällig am 17.10.2040	3.500	4.879	0,03
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 18.01.2033	£ 15.541	29.294	0,16	Summe Elfenbeinküste		10.484	0,06
Export-Import Bank of India 3,250 % fällig am 15.01.2030	2.200	2.359	0,01	James Hardie International Finance DAC 3,625 % fällig am 01.10.2026	€ 5.000	6.325	0,03	<b>JAPAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
3,375 % fällig am 05.08.2026	5.900	6.396	0,04	Liberty Mutual Finance Europe DAC 1,750 % fällig am 27.03.2024	400	516	0,00	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,022 % fällig am 30.05.2023	1.000	1.232	0,01
Summe Indien		12.795	0,07	Mobile Telesystems OJSC Via MTS International Funding DAC 5,000 % fällig am 30.05.2023	1.600	1.718	0,01	3,407 % fällig am 07.03.2024	\$ 7.000	7.611	0,04
<b>INDONESIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Perrigo Finance Unlimited Co. 3,150 % fällig am 15.06.2030	1.900	2.035	0,01	Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % fällig am 17.03.2026	€ 3.800	4.922	0,03
LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % fällig am 04.02.2039	188	222	0,00	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875 % fällig am 15.01.2026	€ 10.900	14.780	0,08	3,201 % fällig am 17.09.2028	9.900	13.159	0,07
Pelabuhan Indonesia Persero PT 4,875 % fällig am 01.10.2024	5.700	6.305	0,03	Summe Irland		225.020	1,21	4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 92.500	102.286	0,55
Pertamina Persero PT 4,875 % fällig am 03.05.2022	1.990	2.096	0,01	<b>INSEL MAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,810 % fällig am 17.09.2030	4.000	4.511	0,02
6,500 % fällig am 07.11.2048	39.500	55.700	0,30	NE Property BV 2,625 % fällig am 22.05.2023	4.800	6.117	0,03	Summitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,474 % fällig am 08.07.2025	5.100	5.229	0,03
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 3,000 % fällig am 30.06.2030	20.700	21.508	0,12	3,375 % fällig am 14.07.2027	29.750	39.510	0,21	1,474 % fällig am 08.07.2025	5.100	5.229	0,03
5,500 % fällig am 22.11.2021	2.500	2.614	0,01	Summe Isle of Man		45.627	0,24	Summe Japan		144.991	0,78
Summe Indonesien		88.445	0,47	<b>ISRAEL STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>ITA LIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	\$ 200	238	0,00	Japan Government International Bond 0,600 % fällig am 20.06.2050	¥ 630.000	6.041	0,03
Atlantia SpA 1,625 % fällig am 03.02.2025	€ 3.100	3.792	0,02	Summe Israel				Summe Japan		144.991	0,78
1,875 % fällig am 13.07.2027	3.200	3.881	0,02	<b>ISRAEL STAATSEMISSIONEN</b>				Jersey Government International Bond 1,625 % fällig am 18.01.2022	5.000	6.203	0,03
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % fällig am 28.04.2025	19.115	24.086	0,13	Intesa Sanpaolo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2024	\$ 9.200	9.836	0,05	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025	900	1.120	0,01
3,625 % fällig am 24.09.2024	19.600	25.353	0,14	4,000 % fällig am 10.07.2022	11.976	13.522	0,07	3,950 % fällig am 30.06.2022	£ 29.150	40.409	0,22
3,375 % fällig am 30.07.2025	26.700	33.988	0,18	5,017 % fällig am 26.06.2024	18.037	19.743	0,11	Summe Jersey, Kanalinseln		160.045	0,86
3,750 % fällig am 14.06.2028	23.000	34.145	0,18	5,375 % fällig am 18.01.2028 (I)	£ 6.400	10.262	0,06	<b>JORDANIEN STAATSEMISSIONEN</b>			
4,125 % fällig am 15.01.2025	\$ 18.800	21.069	0,11	8,000 % fällig am 22.01.2030	\$ 10.200	11.683	0,06	Jordan Government International Bond 4,950 % fällig am 07.07.2025	\$ 4.100	4.363	0,02
4,625 % fällig am 15.04.2043	38.600	46.736	0,25	8,500 % fällig am 10.09.2030	34.000	42.079	0,23	5,850 % fällig am 07.07.2030	8.200	9.068	0,05
5,125 % fällig am 15.01.2045	24.700	31.969	0,17	Immobiliare Grande Distribuzione SIQ SpA 2,125 % fällig am 28.11.2024	6.000	6.966	0,04	Summe Jordanien		13.431	0,07
8,500 % fällig am 12.10.2035	3.900	6.389	0,04	Intesa Sanpaolo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2024	\$ 9.200	9.836	0,05	<b>KASACHSTAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,300 % fällig am 23.06.2025	32.400	33.907	0,18	4,000 % fällig am 23.09.2029	11.976	13.522	0,07	KazMunayGas National Co. JSC 5,750 % fällig am 19.04.2047	200	269	0,00
2,800 % fällig am 23.06.2030	5.300	5.628	0,03	5,017 % fällig am 26.06.2024	18.037	19.743	0,11	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
3,400 % fällig am 29.03.2022	2.500	2.587	0,01	5,148 % fällig am 10.06.2030	£ 6.400	10.262	0,06	Kazakhstan Government International Bond 5,125 % fällig am 21.07.2025	28.800	34.115	0,18
3,800 % fällig am 23.06.2050	4.200	4.647	0,03	5,710 % fällig am 15.01.2026	\$ 10.200	11.683	0,06	6,500 % fällig am 21.07.2045	1.700	2.749	0,02
4,150 % fällig am 29.03.2027	16.400	18.826	0,10	5,875 % fällig am 01.09.2031	€ 12.400	17.059	0,09	Summe Kasachstan		37.133	0,20
4,400 % fällig am 01.03.2028	200	235	0,00	6,500 % fällig am 24.02.2021	\$ 33.131	33.396	0,18	<b>KENIA STAATSEMISSIONEN</b>			
Summe Indonesien		393.399	2,11	7,000 % fällig am 19.01.2021	€ 16.661	20.472	0,11	Kenya Government International Bond 8,000 % fällig am 22.05.2032	7.600	8.874	0,05
<b>IRLAND FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				7,750 % fällig am 11.01.2027 (h)(j)	800	1.176	0,01	<b>KENIA STAATSEMISSIONEN</b>			
Fair Oaks Loan Funding DAC 1,900 % fällig am 15.07.2031	€ 5.150	6.344	0,04	Pro-Gest SpA 3,250 % fällig am 15.12.2024	5.000	5.750	0,03	Summe Kenia		37.133	0,20
Vendome Funding CLO DAC 1,860 % fällig am 20.07.2031	7.700	9.443	0,05	Telecom Italia SpA 2,375 % fällig am 12.10.2027	200	255	0,00	<b>KENIA STAATSEMISSIONEN</b>			
Summe Irland		15.787	0,09	UniCredit SpA 1,200 % fällig am 20.01.2026	10.500	13.061	0,07	Kenya Government International Bond 8,000 % fällig am 22.05.2032	7.600	8.874	0,05
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				1,800 % fällig am 20.01.2030	12.300	15.795	0,08	<b>KENIA STAATSEMISSIONEN</b>			
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC 2,700 % fällig am 11.06.2023	29.250	36.413	0,19	2,200 % fällig am 22.07.2027	51.600	67.117	0,36	Summe Kenia		37.133	0,20
AerCap Ireland Capital DAC 3,150 % fällig am 15.02.2024	\$ 15.300	16.050	0,09	2,569 % fällig am 22.09.2026	16.550	16.907	0,09	<b>KENIA STAATSEMISSIONEN</b>			
3,500 % fällig am 15.01.2025	200	212	0,00	4,129 % fällig am 14.01.2022	10.375	10.669	0,06	Kenya Government International Bond 8,000 % fällig am 22.05.2032	7.600	8.874	0,05
3,650 % fällig am 21.07.2027	400	435	0,00	5,459 % fällig am 30.06.2035	400	441	0,00	<b>KENIA STAATSEMISSIONEN</b>			
				6,572 % fällig am 14.01.2022	9.100	9.591	0,05	Summe Kenia		37.133	0,20
				6,750 % fällig am 10.09.2021 (h)(j)	€ 500	624	0,00	<b>KENIA STAATSEMISSIONEN</b>			
				7,500 % fällig am 03.06.2026 (h)(j)	5.500	7.831	0,04	Summe Kenia		37.133	0,20
				7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 96.650	114.752	0,62	<b>KENIA STAATSEMISSIONEN</b>			

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				
<b>LIBERIA</b>															
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>															
Royal Caribbean Cruises Ltd. 10,875 % fällig am 01.06.2023	\$ 13.000	\$ 14.817	0,08	Telecom Italia Capital S.A. 6,000 % fällig am 30.09.2034	\$ 4.400	\$ 5.371	0,03	6,050 % fällig am 11.01.2040	\$ 146	\$ 196	0,00				
						654.348	3,51			26.298	0,14				
								Summe Mexiko		433.600	2,33				
<b>LUXEMBURG</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>MAROKKO</b>							
<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>								<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
Corestate Capital Holding S.A. 1,375 % fällig am 28.11.2022	€ 16.200	15.837	0,09	Altice Financing S.A. 2,897 % fällig am 31.01.2026 2,909 % fällig am 15.07.2025	26.202 1.979	25.678 1.941	0,14 0,01	Morocco Government International Bond 4,000 % fällig am 15.12.2050	8.000	8.274	0,04				
				Delos Finance SARL 2,004 % fällig am 06.10.2023	420	420	0,00								
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>MULTINATIONAL</b>							
ADLER Group S.A. 2,750 % fällig am 13.11.2026	8.300	10.428	0,06	Summer (BC) Holdco B SARL 4,750 % fällig am 04.12.2026	€ 5.000	6.117	0,03	Ardagh Packaging Finance PLC 4,125 % fällig am 15.08.2026	17.500	18.309	0,10				
Altice Financing S.A. 2,250 % fällig am 15.01.2025 3,000 % fällig am 15.01.2028 7,500 % fällig am 15.05.2026	6.200 5.000 52.800	7.345 5.908 55.786	0,04 0,03 0,30	Summe Luxemburg		34.156	0,18	Connect Finco SARL 6,750 % fällig am 01.10.2026	25.700	27.724	0,15				
Altice France Holding S.A. 4,000 % fällig am 15.02.2028 6,000 % fällig am 15.02.2028 8,000 % fällig am 15.05.2027	€ 11.700 \$ 27.400 € 12.900	13.689 27.793 17.186	0,07 0,15 0,09			704.341	3,78	Delta Air Lines, Inc. 4,500 % fällig am 20.10.2025	4.100	4.384	0,02				
Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 21.000	25.091	0,13					NXP BV 3,150 % fällig am 01.05.2027	800	883	0,01				
Bevco Lux SARL 1,500 % fällig am 16.09.2027 1,750 % fällig am 09.02.2023	€ 8.000 200	10.326 254	0,06 0,00					Summe multinational		51.300	0,28				
Cirsa Finance International SARL 7,875 % fällig am 20.12.2023	\$ 269	272	0,00	<b>MAZEDONIEN</b>				<b>NIEDERLANDE</b>							
Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK) 10,000 % fällig am 09.11.2024 ^(d)	2.547	654	0,00	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % fällig am 15.04.2023 (l)	€ 33.700	34.400	0,18	Petronas Capital Ltd. 4,550 % fällig am 21.04.2050 7,875 % fällig am 22.05.2022	\$ 1.400 10.400	1.877 11.460	0,01 0,06	Airbus SE 1,625 % fällig am 09.06.2030	€ 8.500	11.447	0,06				
CPI Property Group S.A. 1,625 % fällig am 23.04.2027 2,750 % fällig am 12.05.2026 2,750 % fällig am 22.01.2028 4,750 % fällig am 08.03.2023	9.800 23.850 £ 4.700 \$ 24.300	12.339 31.720 6.639 26.070	0,07 0,17 0,04 0,14	Summe Malaysia		13.337	0,07	Athora Netherlands NV 7,000 % fällig am 19.06.2025 (h)(j)	5.000	6.867	0,04				
Eurofins Scientific SE 3,750 % fällig am 17.07.2026	€ 36.900	53.068	0,29	<b>MAURITIUS</b>				Conti-Gummi Finance BV 1,125 % fällig am 25.09.2024 2,125 % fällig am 27.11.2023							
FEL Energy SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040	\$ 58.500	62.364	0,33	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Cooperatieve Rabobank UA 6,625 % fällig am 29.06.2021 (h)(i)							
Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. 4,375 % fällig am 19.09.2022 6,000 % fällig am 27.11.2023	1.000 2.200	1.050 2.462	0,01 0,01					ING Groep NV 0,309 % fällig am 20.09.2023 5,750 % fällig am 16.11.2026 (h)(j)	400	498	0,00				
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,949 % fällig am 24.01.2024 4,250 % fällig am 06.04.2024 4,950 % fällig am 19.07.2022 5,150 % fällig am 11.02.2026 6,510 % fällig am 07.03.2022	€ 500 £ 18.100 \$ 9.900 11.600 4.700	645 26.430 10.454 13.249 4.995	0,00 0,14 0,06 0,07 0,03					16,400	20.654	0,11					
Intelsat Jackson Holdings S.A. 5,500 % fällig am 01.08.2023 ^ 8,500 % fällig am 15.10.2024 ^ 9,750 % fällig am 15.07.2025 ^	12.500 4.800 1.900	8.500 3.444 1.371	0,05 0,02 0,01	<b>MEXIKO</b>				JAB Holdings BV 2,250 % fällig am 19.12.2039							
Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024 3,875 % fällig am 01.04.2024	€ 66.075 1.575	81.938 1.929	0,44 0,01	<b>STAMMAKTIVEN</b>				Kazakhstan Temir Zholy Finance BV 6,950 % fällig am 10.07.2042							
Logicor Financing SARL 3,250 % fällig am 13.11.2028	17.600	25.386	0,14	Hipotecaria Su Casita S.A. (e)	28.925	0	0,00	Koninklijke KPN NV 5,750 % fällig am 17.09.2029	£ 100	168	0,00				
Nielsen Co. Luxembourg SARL 5,500 % fällig am 01.10.2021	\$ 9.648	9.699	0,05	Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (e)	477	1	0,00	LeasePlan Corp. NV 0,750 % fällig am 03.10.2022 1,000 % fällig am 25.02.2022	€ 1.500 400	1.861 496	0,01 0,00				
Pacific Drilling S.A. 8,375 % fällig am 01.10.2023 ^	700	187	0,00	Summe Stammaktien		1	0,00	MDGH - GMTN BV 2,500 % fällig am 21.05.2026 3,950 % fällig am 21.05.2050	\$ 7.500 11.300	7.986 13.574	0,04 0,07				
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,125 % fällig am 29.10.2022 6,125 % fällig am 07.02.2022	3.900 13.000	4.114 13.703	0,02 0,07					Metinvest BV 7,750 % fällig am 23.04.2023	200	214	0,00				
SELP Finance SARL 1,500 % fällig am 20.12.2026	€ 600	789	0,00					NN Group NV 4,500 % fällig am 15.01.2026 (h)	€ 22.000	31.111	0,17				
SIG CombiBloc Purchase Co. SARL 2,125 % fällig am 18.06.2025	5.200	6.706	0,04	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				NXP BV 5,350 % fällig am 01.03.2026							
Stena International S.A. 6,125 % fällig am 01.02.2025	\$ 4.500	4.455	0,02	Grupo Televisa S.A.B. 5,000 % fällig am 13.05.2045	\$ 200	242	0,00	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026 4,441 % fällig am 24.04.2023	€ 26.600 \$ 9.450	35.149 9.923	0,19 0,05				
Summer BC Holdco SARL 5,750 % fällig am 31.10.2026	€ 20.200	26.139	0,14	Petroleos Mexicanos 2,750 % fällig am 21.04.2027 3,750 % fällig am 21.02.2024 4,750 % fällig am 26.02.2029 4,875 % fällig am 21.02.2028 5,625 % fällig am 23.01.2046 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 02.06.2041 6,625 % fällig am 15.06.2035 6,625 % fällig am 15.06.2038 6,750 % fällig am 21.09.2047 6,840 % fällig am 23.01.2030 6,875 % fällig am 04.08.2026 7,690 % fällig am 23.01.2050	€ 15.950 9.900 25.050 25.400 \$ 12.442 39.600 4.400 24.900 6.300 85.700 4.000 30.000 64.600 1.200 34.847	18.417 12.309 30.997 31.816 10.722 39.570 4.653 26.268 5.894 84.976 3.858 28.173 67.735 1.313 35.196	0,10 0,07 0,17 0,17 0,06 0,21 0,14 0,03 0,04 0,46 0,02 0,15 0,36 0,01 0,19	Trust Fibra Uno 6,390 % fällig am 15.01.2050	4.400	5.162	0,03	4,892 % fällig am 24.04.2025 5,182 % fällig am 24.04.2028	47.500 11.654	51.008 12.510	0,28 0,07
						407.301	2,19	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
								Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,125 % fällig am 15.10.2024 1,250 % fällig am 31.03.2023 3,250 % fällig am 15.04.2022 4,500 % fällig am 01.03.2025 6,000 % fällig am 31.01.2025							
								United Group BV 3,625 % fällig am 15.02.2028 4,875 % fällig am 01.07.2024							
								Upjohn Finance BV 0,816 % fällig am 23.06.2022							
								Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023							
								£ 8.400	11.601	0,06					

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>Volkswagen International Finance NV</b>			
3,500 % fällig am 17.06.2025 (h)	€ 11.900	\$ 15.394	0,08
3,875 % fällig am 17.06.2029 (h)	22.600	29.961	0,16
		434.130	2,33
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
<b>Diamond (BC) BV</b>			
3,147 % - 3,214 % fällig am 06.09.2024	\$ 1.086	1.072	0,01
<b>Sigma Bidco BV</b>			
3,500 % fällig am 02.07.2025	€ 44.400	53.522	0,28
<b>Ziggo BV</b>			
3,000 % fällig am 31.01.2029	22.560	27.593	0,15
<b>Ziggo Financing Partnership</b>			
2,659 % fällig am 30.04.2028	\$ 19.040	18.909	0,10
		101.096	0,54
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
<b>EMF-NL Prime BV</b>			
0,293 % fällig am 17.04.2041	€ 45	53	0,00
<b>Eurosail PLC</b>			
0,993 % fällig am 17.10.2040	440	543	0,00
		596	0,00
Summe Niederlande		535.822	2,87
<b>NIGERIA STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Nigeria Government International Bond</b>			
6,500 % fällig am 28.11.2027	\$ 700	756	0,00
7,143 % fällig am 23.02.2030	11.800	12.760	0,07
7,875 % fällig am 16.02.2032	26.700	29.441	0,16
Summe Nigeria		42.957	0,23
<b>NORWEGEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Aker BP ASA</b>			
3,750 % fällig am 15.01.2030	13.915	14.670	0,08
4,750 % fällig am 15.06.2024	8.400	8.692	0,05
<b>Equinor ASA</b>			
3,625 % fällig am 06.04.2040	3.900	4.689	0,02
<b>Yara International ASA</b>			
3,148 % fällig am 04.06.2030	2.100	2.278	0,01
Summe Norwegen		30.329	0,16
<b>OMAN STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Oman Government International Bond</b>			
6,500 % fällig am 08.03.2047	20.600	20.282	0,11
6,750 % fällig am 17.01.2048	59.000	58.596	0,31
Summe Oman		78.878	0,42
<b>PANAMA STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Panama Government International Bond</b>			
6,700 % fällig am 26.01.2036	24.200	36.041	0,19
8,125 % fällig am 28.04.2034	700	1.029	0,01
Summe Panama		37.070	0,20
<b>PARAGUAY STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Paraguay Government International Bond</b>			
5,600 % fällig am 13.03.2048	8.400	10.836	0,06
6,100 % fällig am 11.08.2044	5.000	6.719	0,03
Summe Paraguay		17.555	0,09
<b>PERU STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Peru Government International Bond</b>			
2,783 % fällig am 23.01.2031	11.900	13.087	0,07

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>PORTUGAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Banco Espirito Santo S.A.</b>			
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	€ 200	\$ 38	0,00
<b>Galp Energia SGPS S.A.</b>			
2,000 % fällig am 15.01.2026	21.300	26.931	0,14
Summe Portugal		26.969	0,14
<b>KATAR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Nakilat, Inc.</b>			
6,067 % fällig am 31.12.2033	\$ 14.950	19.173	0,10
<b>Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.</b>			
5,838 % fällig am 30.09.2027	13.350	15.634	0,09
6,332 % fällig am 30.09.2027	3.270	3.844	0,02
		38.651	0,21
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Qatar Government International Bond</b>			
3,875 % fällig am 23.04.2023	2.200	2.367	0,01
4,400 % fällig am 16.04.2050	64.400	84.100	0,45
4,500 % fällig am 23.04.2028	6.600	8.008	0,04
4,625 % fällig am 02.06.2046	220	293	0,00
4,817 % fällig am 14.03.2049	13.700	18.730	0,10
5,103 % fällig am 23.04.2048	6.200	8.735	0,05
		122.233	0,65
Summe Katar		160.884	0,86
<b>RUMÄNIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>RCS &amp; RDS S.A.</b>			
3,250 % fällig am 05.02.2028	€ 700	858	0,01
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Romania Government International Bond</b>			
4,125 % fällig am 11.03.2039	22.200	34.038	0,18
Summe Rumänien		34.896	0,19
<b>RUSSLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>ALROSA Finance S.A.</b>			
3,100 % fällig am 25.06.2027	\$ 24.600	25.384	0,14
4,650 % fällig am 09.04.2024	3.200	3.466	0,02
<b>MMK International Capital DAC</b>			
4,375 % fällig am 13.06.2024	9.500	10.263	0,05
		39.113	0,21
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Russia Government International Bond</b>			
2,875 % fällig am 04.12.2025	€ 32.200	43.563	0,23
4,750 % fällig am 27.05.2026	\$ 11.200	12.957	0,07
5,625 % fällig am 04.04.2042	5.000	6.966	0,04
		63.486	0,34
Summe Russland		102.599	0,55
<b>SAUDI-ARABIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Saudi Arabian Oil Co.</b>			
2,875 % fällig am 16.04.2024	11.000	11.686	0,06
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Saudi Government International Bond</b>			
2,875 % fällig am 04.03.2023	500	524	0,00
2,900 % fällig am 22.10.2025	2.000	2.159	0,01
4,000 % fällig am 17.04.2025	40.600	45.414	0,25
4,500 % fällig am 26.10.2046	138.400	168.325	0,91
5,000 % fällig am 17.04.2049	300	394	0,00
5,250 % fällig am 16.01.2050	200	273	0,00
		217.089	1,17
Summe Saudi-Arabien		228.775	1,23

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
<b>SENEGAL STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>Senegal Government International Bond</b>				
4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 4.200	\$ 5.498	0,03	
6,250 % fällig am 23.05.2033	\$ 3.500	3.939	0,02	
Summe Senegal		9.437	0,05	
<b>SERBIEN STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>Serbia Government International Bond</b>				
3,125 % fällig am 15.05.2027	€ 1.400	1.931	0,01	
<b>SINGAPUR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Flex Ltd.</b>				
3,750 % fällig am 01.02.2026	\$ 34.000	38.066	0,20	
<b>SLOWENIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Nova Ljubljanska Banka d.d.</b>				
3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 8.200	9.105	0,05	
<b>SÜDAFRIKA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>AngloGold Ashanti Holdings PLC</b>				
3,750 % fällig am 01.10.2030	\$ 2.000	2.154	0,01	
<b>Growthpoint Properties International Pty. Ltd.</b>				
5,872 % fällig am 02.05.2023	2.000	2.124	0,01	
<b>SASOL Financing USA LLC</b>				
5,875 % fällig am 27.03.2024	4.700	5.007	0,03	
		9.285	0,05	
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
<b>South Africa Government International Bond</b>				
4,850 % fällig am 30.09.2029	15.200	16.180	0,09	
4,875 % fällig am 14.04.2026	7.700	8.441	0,04	
5,750 % fällig am 30.09.2049	12.300	12.365	0,07	
5,875 % fällig am 16.09.2025	54.900	62.993	0,34	
		99.979	0,54	
Summe Südafrika		109.264	0,59	
<b>SPANIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>Abertris Infraestructuras S.A.</b>				
1,625 % fällig am 15.07.2029	€ 2.500	3.224	0,02	
1,875 % fällig am 26.03.2032	8.800	11.434	0,06	
2,250 % fällig am 29.03.2029	14.100	18.969	0,10	
3,000 % fällig am 27.03.2031	4.600	6.568	0,04	
3,375 % fällig am 27.11.2026	£ 30.300	45.599	0,24	
<b>ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.</b>				
1,375 % fällig am 17.06.2025	€ 9.700	12.201	0,07	
<b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b>				
5,875 % fällig am 24.09.2023	(h)(j)	600	770	0,00
6,000 % fällig am 29.03.2024	(h)(j)	3.000	3.948	0,02
6,000 % fällig am 15.01.2026	(h)(j)	11.000	14.898	0,08
8,875 % fällig am 14.04.2021	(h)(j)	400	501	0,00
<b>Banco de Sabadell S.A.</b>				
0,875 % fällig am 22.07.2025	700	877	0,01	
1,125 % fällig am 27.03.2025	5.700	7.111	0,04	
1,125 % fällig am 11.03.2027	2.700	3.421	0,02	
1,750 % fällig am 29.06.2023	7.000	8.785	0,05	
1,750 % fällig am 10.05.2024	2.000	2.538	0,01	
5,625 % fällig am 06.05.2026	100	143	0,00	
<b>Banco Santander S.A.</b>				
3,490 % fällig am 28.05.2030	\$ 1.400	1.572	0,01	
4,375 % fällig am 14.01.2026	(h)(j)	€ 4.600	5.657	0,03
6,250 % fällig am 11.09.2021	(h)(j)	13.400	16.817	0,09
<b>CaixaBank S.A.</b>				
5,875 % fällig am 09.10.2027	7.400	10.009	0,05	
		175.042	0,94	
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
<b>Grifols S.A.</b>				
2,250 % fällig am 15.11.2027	1.386	1.699	0,01	

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
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Spanien</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>Emirate of Abu Dhabi Government International Bond</b>			
Autonomous Community of Catalonia	5.100	6.460	0,03	7,750 % fällig am 01.09.2022	23.104	24.762	0,13	1,700 % fällig am 02.03.2031	15.600	15.627	0,08
4,900 % fällig am 15.09.2021	€			8,994 % fällig am 01.02.2024	9.300	10.550	0,06	2,700 % fällig am 02.09.2070	60.800	56.885	0,31
Summe Spanien		183.201	0,98	Summe Ukraine		176.745	0,95	3,875 % fällig am 16.04.2050	14.100	17.230	0,09
<b>SRI LANKA</b>				<b>DAE Sukuk Dific Ltd.</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>First Abu Dhabi Bank PJSC</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
Sri Lanka Government International Bond	6.000	3.484	0,02	1,180 % fällig am 16.04.2022	2.400	2.415	0,01	Summe Vereinigte Arabische Emirate		106.062	0,57
7,550 % fällig am 28.03.2030	\$	19.800	0,06	Summe Sri Lanka		14.916	0,08				
7,850 % fällig am 14.03.2029	€										
Summe Sri Lanka		14.916	0,08								
<b>SCHWEDEN</b>				<b>BARCLAYS BANK PLC</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>7,625 % fällig am 21.11.2022</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
Sagax AB	300	391	0,00	10,000 % fällig am 21.05.2021	€	36.484	0,28	Summe Vereinigte Arabische Emirate		106.062	0,57
2,250 % fällig am 13.03.2025	€			Summe Vereinigte Arabische Emirate		106.062	0,57				
Summe Schweden		2.451	0,01								
<b>SCHWEIZ</b>				<b>BARCLAYS BANK PLC</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>10,000 % fällig am 21.05.2021</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
Credit Suisse AG	83.550	94.298	0,51	Summe Vereinigte Arabische Emirate		106.062	0,57				
6,500 % fällig am 08.08.2023	\$										
Summe Schweiz		217.501	1,17								
<b>TRINIDAD UND TOBAGO</b>				<b>BARCLAYS BANK PLC</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>1,849 % fällig am 10.01.2023</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
Trinidad & Tobago Government International Bond	3.900	4.300	0,02	2,375 % fällig am 06.10.2023	€	7.500	0,05				
4,500 % fällig am 04.08.2026				3,125 % fällig am 17.01.2024	\$	200	0,00				
Summe Trinidad und Tobago		4.300	0,02	3,250 % fällig am 12.02.2027	€	950	0,01				
<b>TUNESIEN</b>				<b>BARCLAYS BANK PLC</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>1,500 % fällig am 01.04.2022</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
Banque Centrale de Tunisie Government International Bond	1.200	1.363	0,01	1,849 % fällig am 10.01.2023	\$	200	0,00				
5,625 % fällig am 17.02.2024	€			2,375 % fällig am 06.10.2023	€	7.500	0,05				
6,375 % fällig am 15.07.2026		600	0,00	3,125 % fällig am 17.01.2024	\$	4.300	0,03				
8,250 % fällig am 19.09.2027	\$	1.050	0,01	3,250 % fällig am 12.02.2027	€	950	0,01				
Summe Tunesien		3.043	0,02	3,375 % fällig am 02.04.2025	€	2.500	0,02				
<b>TÜRKEI</b>				<b>BARCLAYS BANK PLC</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>3,650 % fällig am 16.03.2025</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
Turkey Government International Bond	400	399	0,00	4,338 % fällig am 16.05.2024	\$	700	0,00				
3,250 % fällig am 23.03.2023				4,610 % fällig am 15.02.2023	€	1.900	0,01				
3,250 % fällig am 14.06.2025	€	200	0,00	6,125 % fällig am 15.12.2025	€	14.600	0,09				
4,250 % fällig am 13.03.2025	\$	11.800	0,07	7,250 % fällig am 15.03.2023	€	8.800	0,07				
4,625 % fällig am 31.03.2025	€	4.400	0,03	7,875 % fällig am 15.09.2022	€	15.200	0,12				
4,875 % fällig am 09.10.2026	\$	42.000	0,23	Summe Türkei		225.992	1,21				
4,875 % fällig am 16.04.2043		33.867	0,16								
5,125 % fällig am 17.02.2028		38.700	0,21								
5,600 % fällig am 14.11.2024		21.100	0,12								
5,750 % fällig am 11.05.2047		74.800	0,38								
6,000 % fällig am 25.03.2027		200	0,00								
6,125 % fällig am 24.10.2028		1.600	0,01								
6,875 % fällig am 17.03.2036		600	0,00								
Summe Türkei		225.992	1,21								
<b>UKRAINE</b>				<b>BARCLAYS BANK PLC</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>1,125 % fällig am 18.10.2023</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
Ukraine Government International Bond	55.400	64.961	0,35	1,750 % fällig am 09.02.2023	€	3.000	0,02				
4,375 % fällig am 27.01.2030	€			Summe Türkei		225.992	1,21				
6,750 % fällig am 20.06.2026		6.200	0,05								
7,375 % fällig am 25.09.2032	\$	5.800	0,03								
7,750 % fällig am 01.09.2021	€	59.450	0,33								
Summe Ukraine		61.703	0,33								
<b>UKRAINE</b>				<b>BARCLAYS BANK PLC</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>1,125 % fällig am 18.10.2023</b>				<b>Summe Vereinigte Arabische Emirate</b>			
Ukraine Government International Bond	55.400	64.961	0,35	1,750 % fällig am 09.02.2023	€	3.000	0,02				
4,375 % fällig am 27.01.2030	€			Summe Türkei		225.992	1,21				
6,750 % fällig am 20.06.2026		6.200	0,05								
7,375 % fällig am 25.09.2032	\$	5.800	0,03								
7,750 % fällig am 01.09.2021	€	59.450	0,33								
Summe Ukraine		61.703	0,33								





# Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income 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		
Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates				CenturyLink, Inc.				4,500 % fällig am 15.04.2024	\$	100	\$	109	0,00
0,888 % fällig am 25.04.2034	\$	238	0,00	4,000 % fällig am 15.02.2027	1.300	1.344	0,01	5,000 % fällig am 15.05.2050	2.200	2.388	0,01		
				Charter Communications Operating LLC				5,950 % fällig am 01.10.2043	200	227	0,00		
				4,200 % fällig am 15.03.2028	5.000	5.772	0,03	6,050 % fällig am 01.06.2041	1.500	1.760	0,01		
				4,800 % fällig am 01.03.2050	8.700	10.409	0,06	6,125 % fällig am 15.12.2045	900	1.066	0,01		
				5,125 % fällig am 01.07.2049	19.200	23.472	0,13	6,625 % fällig am 15.10.2036	800	974	0,01		
				5,375 % fällig am 01.04.2038	4.500	5.627	0,03	7,500 % fällig am 01.07.2038	16.065	21.402	0,12		
				Cheniere Corpus Christi Holdings LLC				Energy Transfer Partners LP					
				5,125 % fällig am 30.06.2027	13.200	15.636	0,08	4,500 % fällig am 01.11.2023	7.335	7.949	0,04		
				Chubb INA Holdings, Inc.				5,000 % fällig am 01.10.2022	22.200	23.570	0,13		
				0,875 % fällig am 15.06.2027	€	3.000	3,865	0,02	5,875 % fällig am 01.03.2022	16.800	17.570	0,09	
				CIT Group, Inc.				EPR Properties					
				5,000 % fällig am 15.08.2022	\$	2.986	3,169	0,02	3,750 % fällig am 15.08.2029	500	480	0,00	
				5,000 % fällig am 01.08.2023	2.350	2.572	0,01	EQM Midstream Partners LP					
				Citigroup, Inc.				4,000 % fällig am 01.08.2024	3.100	3.199	0,02		
				1,250 % fällig am 06.07.2026	€	1.500	1,934	0,01	EQT Corp.				
				2,572 % fällig am 03.06.2031 (k)	\$	8.000	8,534	0,05	3,900 % fällig am 01.10.2027	3.200	3.185	0,02	
				3,106 % fällig am 08.04.2026	3.900	4.267	0,02	7,875 % fällig am 01.02.2025	72.635	82.814	0,44		
				3,400 % fällig am 01.05.2026	2.200	2.478	0,01	8,750 % fällig am 01.02.2030	1.000	1.226	0,01		
				Constellation Brands, Inc.				Fidelity National Financial, Inc.					
				3,700 % fällig am 06.12.2026	2.200	2.520	0,01	3,400 % fällig am 15.06.2030	200	220	0,00		
				Continental Airlines Pass-Through Trust				5,500 % fällig am 01.09.2022	2.200	2.371	0,01		
				4,150 % fällig am 11.10.2025	2.427	2.448	0,01	FirstEnergy Corp.					
				5,983 % fällig am 19.10.2023	2.438	2.469	0,01	7,375 % fällig am 15.11.2031	12.780	18.246	0,10		
				Continental Resources, Inc.				Ford Motor Credit Co. LLC					
				3,800 % fällig am 01.06.2024	173	179	0,00	0,000 % fällig am 14.05.2021	€	10.400	12,678	0,07	
				4,375 % fällig am 15.01.2028	13.700	14.070	0,08	0,000 % fällig am 01.12.2021	18.246	22.125	0,12		
				Coty, Inc.				0,000 % fällig am 07.12.2022	3.600	4.260	0,02		
				4,750 % fällig am 15.04.2026	€	800	921	0,01	0,172 % fällig am 01.12.2024	7.800	8.849	0,05	
				CVS Health Corp.				0,217 % fällig am 15.11.2023	1.100	1.289	0,01		
				4,125 % fällig am 01.04.2040	\$	2.900	3,488	0,02	1,048 % fällig am 05.04.2021	\$	1.800	1,792	0,01
				4,250 % fällig am 01.04.2050	1.000	1.253	0,01	1,104 % fällig am 12.10.2021	2.460	2.431	0,01		
				CyrusOne LP				1,296 % fällig am 03.08.2022	300	293	0,00		
				1,450 % fällig am 22.01.2027	€	1.500	1,860	0,01	1,456 % fällig am 15.02.2023	2.100	2.027	0,01	
				DAE Funding LLC				1,514 % fällig am 17.02.2023	€	4.500	5,511	0,03	
				4,500 % fällig am 01.08.2022	\$	100	101	0,00	1,744 % fällig am 19.07.2024	1.300	1.588	0,01	
				5,000 % fällig am 01.08.2024	12.887	13.233	0,07	2,330 % fällig am 25.11.2025	17.800	22.189	0,12		
				5,250 % fällig am 15.11.2021	200	205	0,00	2,386 % fällig am 17.02.2026	100	125	0,00		
				5,750 % fällig am 15.11.2023	100	103	0,00	2,748 % fällig am 14.06.2024	€	9.700	13,276	0,07	
				Daimler Finance North America LLC				2,770 % fällig am 07.01.2021	\$	200	200	0,00	
				0,895 % fällig am 05.11.2021	1.352	1.358	0,01	3,021 % fällig am 06.03.2024	€	15.800	20,079	0,11	
				DaVita, Inc.				3,096 % fällig am 04.05.2023	\$	5.300	5,361	0,03	
				4,625 % fällig am 01.06.2030	19.250	20.441	0,11	3,250 % fällig am 15.09.2025	€	2.700	3,469	0,02	
				Dell International LLC				3,336 % fällig am 18.03.2021	\$	3.200	3,212	0,02	
				4,000 % fällig am 15.07.2024	2.100	2.318	0,01	3,350 % fällig am 01.11.2022	21.200	21.600	0,12		
				4,900 % fällig am 01.10.2026	14.900	17.608	0,09	3,360 % fällig am 07.01.2022	700	705	0,00		
				5,300 % fällig am 01.10.2029	21.600	26.499	0,14	3,550 % fällig am 07.10.2022	7.000	7.153	0,04		
				5,450 % fällig am 15.06.2023	11.400	12.613	0,07	3,664 % fällig am 08.09.2024	1.100	1.131	0,01		
				5,850 % fällig am 15.07.2025	3.400	4.086	0,02	3,813 % fällig am 12.10.2021	1.100	1.114	0,01		
				6,020 % fällig am 15.06.2026	24.779	30.250	0,16	4,063 % fällig am 01.11.2024	38.900	40.916	0,22		
				6,100 % fällig am 15.07.2027	1.600	1.990	0,01	4,134 % fällig am 04.08.2025	200	210	0,00		
				6,200 % fällig am 15.07.2030	1.800	2.343	0,01	4,250 % fällig am 20.09.2022	€	400	414	0,00	
				8,100 % fällig am 15.07.2036	5.200	7.698	0,04	4,535 % fällig am 06.03.2025	\$	2.600	3,782	0,02	
				Delta Air Lines Pass-Through Trust				5,584 % fällig am 18.03.2024	\$	8.400	9,072	0,05	
				6,821 % fällig am 10.02.2024	953	977	0,01	5,596 % fällig am 07.01.2022	11.500	11.916	0,06		
				Delta Air Lines, Inc.				5,875 % fällig am 02.08.2021	800	820	0,00		
				2,900 % fällig am 28.10.2024	2.700	2.666	0,01	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC					
				7,000 % fällig am 01.05.2025	23.039	26.620	0,14	6,500 % fällig am 01.10.2025	20.810	21.825	0,12		
				7,375 % fällig am 15.01.2026	900	1.029	0,01	6,750 % fällig am 15.03.2022	3.069	3.084	0,02		
				Digital Euro Finco LLC				Freedom Mortgage Corp.					
				2,500 % fällig am 16.01.2026	€	3.200	4,366	0,02	7,625 % fällig am 01.05.2026	28.700	30.392	0,16	
				Doctors Co.				8,125 % fällig am 15.11.2024	11.280	11.802	0,06		
				6,500 % fällig am 15.10.2023	\$	10.100	10,924	0,06	8,250 % fällig am 15.04.2025	43.289	45.345	0,24	
				Edison International				GE Capital Funding LLC					
				5,750 % fällig am 15.06.2027	100	120	0,00	3,450 % fällig am 15.05.2025	400	442	0,00		
				EI Paso Natural Gas Co. LLC				4,550 % fällig am 15.05.2032	12.700	15.255	0,08		
				8,375 % fällig am 15.06.2032	1.000	1.410	0,01	General Electric Co.					
				Enable Midstream Partners LP				0,875 % fällig am 17.05.2025	€	2.100	2,649	0,01	
				4,150 % fällig am 15.09.2029	14.700	14.607	0,08	1,500 % fällig am 17.05.2029	600	784	0,00		
				4,400 % fällig am 15.03.2027	500	505	0,00	4,125 % fällig am 19.09.2035	5.500	8.841	0,05		
				4,950 % fällig am 15.05.2028	17.463	18.069	0,10	5,250 % fällig am 07.12.2028	€	6.400	11,055	0,06	
				Energy Transfer Operating LP				5,500 % fällig am 07.06.2021	300	419	0,00		
				2,900 % fällig am 15.05.2025	700	741	0,00	5,550 % fällig am 05.01.2026	\$	5.700	6,910	0,04	
				3,600 % fällig am 01.02.2023	2.125	2.227	0,01	5,625 % fällig am 16.09.2031	€	7.900	14,059	0,08	
				3,750 % fällig am 15.05.2030	2.200	2.376	0,01	5,875 % fällig am 14.01.2038	\$	300	407	0,00	
				4,050 % fällig am 15.03.2025	300	329	0,00	6,150 % fällig am 07.08.2037	800	1.105	0,01		
				4,200 % fällig am 15.09.2023	100	108	0,00	6,875 % fällig am 10.01.2039	100	147	0,00		
								General Motors Co.					
								6,800 % fällig am 01.10.2027 (k)	1.800	2.316	0,01		







## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified 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
3,136 % fällig am 25.09.2035	\$ 158	\$ 153	0,00	4,009 % fällig am 25.04.2036 ^	\$ 15	\$ 15	0,00	0,122 % fällig am 26.01.2021 (f)(g)	\$ 250.000	\$ 249.994	1,34
3,201 % fällig am 25.09.2035	29	23	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	3.991	4.039	0,02	0,122 % fällig am 09.02.2021 (f)(g)	250.500	250.491	1,34
Structured Asset Mortgage Investments Trust				Summe USA		153.763	0,83	0,122 % fällig am 22.04.2021 (f)(g)	122.600	122.574	0,66
0,328 % fällig am 25.07.2046	202	174	0,00			3.599.673	19,31	0,137 % fällig am 21.01.2021 (f)(g)	76.500	76.499	0,41
0,328 % fällig am 25.09.2047	57	56	0,00	<b>URUGUAY</b>							
0,338 % fällig am 25.06.2036	111	110	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
0,338 % fällig am 25.09.2047	885	838	0,01	Uruguay Government International Bond							
0,448 % fällig am 25.08.2036 ^	587	516	0,00	7,625 % fällig am 21.03.2036	100	162	0,00	Summe kurzfristige Instrumente		2.736.474	14,68
0,568 % fällig am 25.04.2036	58	54	0,00	<b>VENEZUELA</b>							
0,568 % fällig am 25.05.2036	55	47	0,00	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
0,812 % fällig am 19.10.2034	49	49	0,00	Petroleos de Venezuela S.A.							
0,852 % fällig am 19.03.2034	6	6	0,00	6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	8.400	336	0,00	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	16.283.835	87,35
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates											
2,475 % fällig am 25.06.2033	9	9	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
SunTrust Alternative Loan Trust				Venezuela Government International Bond							
0,798 % fällig am 25.12.2035 ^	394	327	0,00	6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	2.651	257	0,00	<b>AKTIEN</b>			
5,750 % fällig am 25.12.2035 ^	453	448	0,00	7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	16.792	1.629	0,01	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Thornburg Mortgage Securities Trust				9,250 % fällig am 07.05.2028 ^	7.813	758	0,01	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
2,316 % fällig am 25.09.2037	51	52	0,00	Summe Venezuela		2.980	0,02	PIMCO Funds:			
VNDO Mortgage Trust								Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (i)	3.488.745	35.202	0,19
2,996 % fällig am 15.11.2030	4.100	4.244	0,02	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (i)	7.821.400	91.432	0,49
Wachovia Mortgage Loan Trust LLC				<b>COMMERCIAL PAPER</b>				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (i)	3.637.652	46.778	0,25
2,647 % fällig am 20.10.2035 ^	66	62	0,00	Bank of Nova Scotia				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (i)	52.112.364	531.546	2,85
3,045 % fällig am 20.03.2037 ^	59	55	0,00	0,222 % fällig am 13.01.2021	282.400	221.646	1,19	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)	11.805.719	117.609	0,63
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				0,222 % fällig am 14.01.2021	259.700	203.830	1,09	Summe Investmentfonds	\$	1.782.474	9,56
0,568 % fällig am 25.06.2044	424	414	0,00	Canadian Imperial Bank of Commerce							
0,728 % fällig am 25.10.2045	50	49	0,00	0,214 % fällig am 15.01.2021	46.400	36.418	0,20				
0,788 % fällig am 25.01.2045	472	471	0,00	0,219 % fällig am 15.01.2021	70.600	55.411	0,30				
0,888 % fällig am 25.11.2034	425	424	0,00	Royal Bank of Canada							
1,419 % fällig am 25.07.2047	619	536	0,00	0,227 % fällig am 15.01.2021	33.500	26.293	0,14	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
1,554 % fällig am 25.12.2046	85	80	0,00	0,231 % fällig am 06.01.2021	197.100	154.703	0,83	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (i)	9.439.840	959.907	5,15
1,609 % fällig am 25.08.2046	496	474	0,00	0,235 % fällig am 14.01.2021	33.500	26.293	0,14				
1,753 % fällig am 27.02.2034	234	235	0,00	Toronto-Dominion Bank							
1,809 % fällig am 25.11.2042	6	6	0,00	0,227 % fällig am 15.01.2021	92.800	72.835	0,39				
2,003 % fällig am 25.10.2046	29	28	0,00	Summe Argentinien		797.429	4,28				
2,009 % fällig am 25.04.2044	3	3	0,00	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>							
2,023 % fällig am 25.05.2046	96	91	0,00	(3,480) % fällig am 13.09.2021 (f)(g)	ARS	4.602	0,00				
2,722 % fällig am 25.12.2036 ^	12	12	0,00								
2,748 % fällig am 25.12.2035	103	102	0,00	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>							
2,966 % fällig am 25.01.2037 ^	48	17	0,00	(0,094) % fällig am 29.03.2021 (f)(g)	¥	66.280.000	3,44				
3,014 % fällig am 25.09.2036 ^	176	169	0,00								
3,097 % fällig am 25.07.2037 ^	691	670	0,01	<b>U.S. TREASURY BILLS</b>							
3,169 % fällig am 25.08.2036 ^	83	78	0,00	0,091 % fällig am 01.04.2021 (f)(g)(m)	\$	73.000	0,39				
3,208 % fällig am 25.04.2037 ^	12	11	0,00	0,106 % fällig am 21.01.2021 (f)(g)		54.400	0,29				
3,214 % fällig am 25.10.2036 ^	377	341	0,00	0,107 % fällig am 06.04.2021 (f)(g)		100.000	0,54				
3,324 % fällig am 25.12.2036 ^	35	35	0,00	0,113 % fällig am 18.02.2021 (c)(f)(g)		150.000	0,81				
3,329 % fällig am 25.02.2033	15	16	0,00	0,117 % fällig am 26.01.2021 (f)(g)		125.000	0,67				
3,348 % fällig am 25.05.2037 ^	20	18	0,00	0,117 % fällig am 29.04.2021 (f)(g)(m)		95.000	0,51				
3,566 % fällig am 25.04.2035	20	21	0,00								
3,651 % fällig am 25.03.2036	219	212	0,00								
3,675 % fällig am 25.02.2037 ^	45	43	0,00								
3,746 % fällig am 25.06.2033	48	48	0,00								
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust											
0,308 % fällig am 25.02.2037 ^	908	803	0,01								
0,598 % fällig am 25.05.2035 ^	311	256	0,00								
5,500 % fällig am 25.07.2035 ^	651	647	0,01								
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	171	175	0,00								
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	765	792	0,01								
Wells Fargo Alternative Loan Trust											
5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	78	78	0,00								
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust											
2,808 % fällig am 25.12.2036 ^	116	110	0,00								
2,833 % fällig am 25.11.2037 ^	142	131	0,00								
4,006 % fällig am 25.04.2036 ^	304	292	0,00								

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 46.261	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (47.186)	\$ 46.261	\$ 46.261	0,25
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (47.186)</b>	<b>\$ 46.261</b>	<b>\$ 46.261</b>	<b>0,25</b>

(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 March Futures	Long	03.2021	156	\$ 78	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2021	2.319	77	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	2.596	(76)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2021	9.852	1.685	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	23.861	826	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	1.518	(755)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	5.378	(7.135)	(0,04)
				\$ (5.300)	(0,03)
<b>Summe der an einem gereglten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ (5.300)</b>	<b>(0,03)</b>

## 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 35.000	\$ 547	0,00
Atlantia SpA	1,000	20.06.2025	€ 11.800	350	0,00
Casino Guichard Perrachon S.A.	1,000	20.12.2021	11.000	418	0,00
Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.06.2022	19.900	1.813	0,01
Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.12.2022	16.300	837	0,01
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2023	\$ 3.700	(402)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	5.400	372	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	14.300	457	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	9.300	214	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2025	29.200	87	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	€ 20.600	(219)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	69.500	(5.729)	(0,03)
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.12.2024	23.300	(173)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2024	4.900	63	0,00
				\$ (1.365)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 178.700	\$ (5.972)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000 %	20.12.2024	\$ 16.275	\$ 1.127	0,01
CDX.EM-33 5-Year Index	1,000	20.06.2025	432.440	31.058	0,17
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	624.200	25.102	0,13
iTraxx Crossover 34 5-Year Index	5,000	20.12.2025	€ 1.078.800	60.287	0,32
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	879.600	6.590	0,04
				\$ 124.164	0,67

## 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	2,500 %	19.06.2029	CAD 91.700	\$ 5.056	0,03
Erhalt	3-Month	USD-LIBOR	1,000	16.12.2025	\$ 793.600	(1.053)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month	EUR-EURIBOR	0,000	16.06.2051	€ 91.200	176	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month	EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2026	86.400	238	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month	GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	£ 115.700	(16)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month	GBP-LIBOR	0,250	16.06.2031	6.700	(45)	0,00
Erhalt	6-Month	GBP-LIBOR	0,500	16.09.2025	21.100	(732)	0,00
						\$ 3.624	0,02
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 120.451</b>	<b>0,65</b>

<sup>(1)</sup> 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 des Diversified Income 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 Rückzahlungswerts 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 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.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### 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 <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.01.2021	30.600	\$ (52)	\$ (4)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	14.900	(27)	(2)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	15.200	(23)	(2)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450	20.01.2021	77.900	(70)	(53)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	116.500	(186)	(17)	0,00	
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	21.04.2021	17.500	(26)	(23)	0,00	
	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	8.100	(59)	(5)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	43.700	(122)	(8)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	15.100	(20)	(2)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	12.600	(16)	(11)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	6.300	(7)	(5)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	38.400	(43)	(53)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	30.400	(57)	(5)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	38.400	(68)	(6)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	44.100	(83)	(3)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	37.900	(46)	(30)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	114.700	(90)	(66)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	39.700	(33)	(40)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	61.600	(82)	(82)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	114.700	(112)	(129)	(0,01)	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	39.700	(48)	(38)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	38.300	(23)	(19)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	38.300	(56)	(65)	0,00	
	BRC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	61.500	(130)	(6)	0,00
		Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	41.500	(54)	(33)	0,00
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,700	17.03.2021	39.000	(54)	(52)	0,00	
Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Kauf	0,375	21.04.2021	70.500	(34)	(34)	0,00	
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,750	21.04.2021	70.500	(124)	(120)	0,00	
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	18.100	(29)	(27)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,950	20.01.2021	15.700	(24)	(2)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	14.300	(18)	(5)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	6.700	(8)	(6)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	42.800	(68)	(6)	0,00	
FBF	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	43.900	(29)	(30)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	43.900	(52)	(24)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	14.800	(20)	(5)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	17.02.2021	13.800	(34)	(3)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	30.400	(47)	(24)	0,00	
GST	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	15.100	(17)	(2)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	6.300	(8)	(5)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	17.600	(14)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	40.700	(31)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 33 5-Year Index	Verkauf	4,250	16.06.2021	136.100	(159)	(1)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	46.800	(33)	(32)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	46.800	(50)	(25)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	74.400	(49)	(43)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	42.400	(29)	(42)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	74.400	(82)	(83)	0,00	
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	42.400	(53)	(35)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	39.900	(72)	(5)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	43.100	(87)	(5)	0,00	
MYC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	22.200	(43)	(2)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	28.300	(38)	(23)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	25.400	(32)	(18)	0,00	
						\$ (2.871)	\$ (1.366)	(0,01)	

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000 %	20.12.2025	\$ 34.400	\$ (1.545)	\$ 2.095	\$ 550	0,01
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 1.200	113	(7)	106	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 27.520	(1.082)	1.564	482	0,00
FBF	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 6.400	599	(37)	562	0,00
GST	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 41.200	4.387	(767)	3.620	0,02
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 29.580	(1.163)	1.681	518	0,00
JPM	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 1.000	92	(4)	88	0,00
MYC	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 6.400	650	(88)	562	0,00
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 8.200	893	(172)	721	0,01
					\$ 2.944	\$ 4.265	\$ 7.209	0,04

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

## DEWISENTERMIKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	¥ 245.899	\$ 2.360	\$ 0	\$ (21)	\$ (21)	0,00
	01.2021	\$ 88.095	AUD 119.308	3.973	0	3.973	0,02
	01.2021	€ 6.073	€ 4.969	10	(2)	8	0,00
	01.2021	¥ 79.748	¥ 8.284.647	498	0	498	0,00
	01.2021	401	PLN 1.551	15	0	15	0,00
	01.2021	ZAR 2.424	\$ 155	0	(10)	(10)	0,00
	03.2021	INR 49.680	€ 660	0	(15)	(15)	0,00
	03.2021	¥ 66.280.000	€ 642.061	0	(510)	(510)	0,00
BPS	01.2021	€ 2.371.932	€ 2.842.427	0	(59.764)	(59.764)	(0,32)
	01.2021	£ 15.065	€ 20.121	0	(473)	(473)	0,00
	01.2021	\$ 1.035	£ 761	5	0	5	0,00
	01.2021	136	PLN 526	5	0	5	0,00
	02.2021	€ 1.158.713	\$ 1.418.698	0	(12)	(12)	0,00
	03.2021	KRW 716.416	€ 647	0	(12)	(12)	0,00
	03.2021	SGD 539	€ 400	0	(9)	(9)	0,00
	03.2021	\$ 87.589	IDR 1.248.661.264	1.655	0	1.655	0,01
BRC	01.2021	BRL 2.943	\$ 555	0	(12)	(12)	0,00
	01.2021	€ 575.431	€ 689.133	0	(14.936)	(14.936)	(0,08)
	01.2021	¥ 14.900	€ 144	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 566	BRL 2.943	0	0	0	0,00
	02.2021	€ 1.701.765	\$ 2.083.595	0	(18)	(18)	0,00
CBK	01.2021	BRL 2.943	€ 566	0	0	0	0,00
	01.2021	£ 176.987	€ 235.852	0	(6.088)	(6.088)	(0,03)
	01.2021	¥ 61.220	€ 588	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	RUB 407	€ 5	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 582	BRL 2.943	0	(15)	(15)	0,00
	01.2021	9.801	€ 8.123	139	0	139	0,00
	01.2021	7	PLN 25	0	0	0	0,00
	01.2021	ZAR 2.054	\$ 131	0	(8)	(8)	0,00
	02.2021	BRL 2.943	€ 581	15	0	15	0,00
	03.2021	\$ 295	MXN 6.027	5	0	5	0,00
GLM	01.2021	BRL 465.406	\$ 89.558	0	(43)	(43)	0,00
	01.2021	£ 233.305	€ 311.520	0	(7.405)	(7.405)	(0,04)
	01.2021	¥ 7.364.132	€ 71.151	0	(179)	(179)	0,00
	01.2021	\$ 91.854	BRL 465.406	0	(2.253)	(2.253)	(0,01)
	01.2021	87.446	MXN 1.763.508	892	0	892	0,00
	02.2021	71.170	¥ 7.364.132	181	0	181	0,00
	02.2021	22.569	RUB 1.720.792	607	0	607	0,00
	03.2021	90.930	CNH 598.046	686	0	686	0,00
HUS	01.2021	BRL 465.406	\$ 91.543	1.942	0	1.942	0,01
	01.2021	CAD 818.900	€ 643.224	572	(162)	410	0,00
	01.2021	€ 89.486	€ 107.220	0	(2.280)	(2.280)	(0,01)
	01.2021	£ 18.092	€ 24.045	0	(687)	(687)	0,00
	01.2021	¥ 113.097	€ 1.085	0	(10)	(10)	0,00
	01.2021	\$ 89.558	BRL 465.406	43	0	43	0,00
	01.2021	34.293	€ 28.138	151	(13)	138	0,00
	01.2021	4.528	£ 3.346	45	0	45	0,00
	01.2021	342	PLN 1.303	8	0	8	0,00
	01.2021	88.185	SEK 750.235	3.172	0	3.172	0,02
	01.2021	1.447	\$ 92	0	(6)	(6)	0,00
	02.2021	\$ 91.491	BRL 465.406	0	(1.919)	(1.919)	(0,01)
	02.2021	15.331	RUB 1.146.231	106	0	106	0,00
	03.2021	87.502	CNH 579.557	1.281	0	1.281	0,01
	03.2021	1.525	IDR 21.832.249	35	0	35	0,00
JPM	01.2021	1.463	AUD 1.989	71	0	71	0,00
	01.2021	12.702	€ 10.421	50	0	50	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2021	\$ 87.474	ZAR 1.335.838	\$ 3.241	\$ 0	\$ 3.241	0,02
	03.2021	477	COP 1.749.275	33	0	33	0,00
MYI	01.2021	AUD 595	\$ 453	0	(6)	(6)	0,00
	01.2021	CAD 197.100	155.132	421	0	421	0,00
	01.2021	€ 11.194	13.730	34	0	34	0,00
	01.2021	£ 41	56	0	0	0	0,00
	01.2021	SGD 1.255	947	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 29	AUD 38	0	0	0	0,00
	01.2021	8.804	£ 6.468	39	0	39	0,00
	01.2021	88.116	NOK 780.115	2.998	0	2.998	0,01
	01.2021	25	PLN 97	1	0	1	0,00
RBC	03.2021	TWD 4.327	\$ 154	0	(2)	(2)	0,00
SCX	01.2021	£ 86.237	115.275	0	(2.611)	(2.611)	(0,02)
	01.2021	\$ 856	AUD 1.161	41	0	41	0,00
SSB	01.2021	£ 367.707	\$ 490.825	0	(11.828)	(11.828)	(0,06)
	01.2021	\$ 7.724	£ 5.734	115	0	115	0,00
TOR	01.2021	CAD 12.404	\$ 9.736	0	0	0	0,00
	01.2021	¥ 485.399	4.653	0	(49)	(49)	0,00
	01.2021	\$ 9.575	CAD 12.404	162	0	162	0,00
	02.2021	9.737	12.404	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	1.722	AUD 2.344	87	0	87	0,00
	02.2021	RUB 2.839	\$ 38	0	0	0	0,00
	02.2021	\$ 49.775	RUB 3.788.569	1.249	0	1.249	0,01
				\$ 24.583	\$ (111.365)	\$ (86.782)	(0,47)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen 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	01.2021	AUD 1.170	\$ 876	\$ 0	\$ (26)	\$ (26)	0,00
	01.2021	\$ 39.409	AUD 53.365	1.771	0	1.771	0,01
BPS	01.2021	3.542	4.815	174	0	174	0,00
BRC	01.2021	AUD 874	\$ 664	0	(11)	(11)	0,00
CBK	01.2021	11	8	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	1.410	1.056	0	(32)	(32)	0,00
	01.2021	\$ 16.717	AUD 22.650	761	0	761	0,01
JPM	01.2021	10.558	14.350	515	0	515	0,00
MYI	01.2021	AUD 1.034	\$ 765	0	(33)	(33)	0,00
SCX	01.2021	891	678	0	(10)	(10)	0,00
	01.2021	\$ 8.959	AUD 12.138	408	0	408	0,00
UAG	01.2021	38.963	52.907	1.864	0	1.864	0,01
				\$ 5.493	\$ (112)	\$ 5.381	0,03

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 45.510	CAD 59.048	\$ 840	\$ 0	\$ 840	0,01
BPS	01.2021	14.281	18.422	180	0	180	0,00
CBK	01.2021	107.530	139.743	2.161	0	2.161	0,01
HUS	01.2021	15.228	19.504	81	0	81	0,00
JPM	01.2021	18.236	23.738	397	0	397	0,00
SSB	01.2021	CAD 1.701	\$ 1.340	5	0	5	0,00
	01.2021	\$ 18.220	CAD 23.691	377	0	377	0,00
TOR	01.2021	CAD 140.205	\$ 110.051	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 108.224	CAD 140.205	1.827	0	1.827	0,01
	02.2021	110.063	140.205	0	0	0	0,00
				\$ 5.868	\$ (1)	\$ 5.867	0,03

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	CHF 68	\$ 77	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 18.203	CHF 16.440	396	0	396	0,00
BPS	01.2021	CHF 180	\$ 205	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 36	CHF 32	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	687	617	12	0	12	0,00
CBK	01.2021	CHF 58	\$ 65	0	0	0	0,00
GLM	01.2021	50	56	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	\$ 20.147	CHF 18.246	496	0	496	0,01

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SCX	01.2021	CHF 67	\$ 75	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 1.878	CHF 1.699	44	0	44	0,00
SSB	01.2021	20.445	18.424	400	0	400	0,00
UAG	01.2021	CHF 155	\$ 176	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 4.306	CHF 3.813	9	0	9	0,00
				\$ 1.357	\$ 0	\$ 1.357	0,01

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	€ 11.267	\$ 13.839	\$ 52	\$ 0	\$ 52	0,00
BPS	01.2021	\$ 73.560	€ 60.366	342	(35)	307	0,00
BRC	01.2021	5.034	4.119	7	0	7	0,00
CBK	01.2021	19.906	16.488	270	0	270	0,00
HUS	01.2021	€ 6.514	\$ 7.929	0	(43)	(43)	0,00
	01.2021	\$ 263.402	€ 219.450	5.142	(14)	5.128	0,03
JPM	01.2021	€ 576	\$ 704	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 2.089.503	€ 1.741.620	41.627	0	41.627	0,22
MYI	01.2021	€ 3.102	\$ 3.783	0	(12)	(12)	0,00
SCX	01.2021	\$ 2.540.467	€ 2.121.283	55.030	0	55.030	0,30
	02.2021	3.968.467	3.241.182	0	(16)	(16)	0,00
TOR	01.2021	2.395.297	2.000.067	51.884	0	51.884	0,28
	02.2021	1.077.667	880.168	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 154.354	\$ (126)	\$ 154.228	0,83

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen 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	01.2021	£ 747	\$ 998	\$ 0	\$ (23)	\$ (23)	0,00
	01.2021	\$ 33.769	£ 25.020	434	0	434	0,00
BRC	01.2021	£ 121	\$ 162	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 42	£ 31	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	£ 6.401	\$ 8.740	0	(10)	(10)	0,00
	01.2021	\$ 984.366	£ 736.395	22.281	0	22.281	0,12
HUS	01.2021	£ 95	\$ 129	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 1.164.596	£ 870.605	25.514	0	25.514	0,14
MYI	01.2021	110.072	82.465	2.657	0	2.657	0,01
SCX	01.2021	16.004	11.850	195	0	195	0,00
SSB	01.2021	1.200.022	899.011	28.919	0	28.919	0,16
				\$ 80.000	\$ (37)	\$ 79.963	0,43

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse 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	01.2021	MXN 1.795	\$ 89	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2021	\$ 88	MXN 1.777	1	0	1	0,00
	02.2021	89	1.795	1	0	1	0,00
BPS	01.2021	MXN 1.764	\$ 88	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$ 87	MXN 1.764	1	0	1	0,00
GLM	01.2021	88	1.777	1	0	1	0,00
SSB	01.2021	88	1.777	1	0	1	0,00
UAG	01.2021	MXN 1.774	\$ 88	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$ 88	MXN 1.774	1	0	1	0,00
				\$ 6	\$ (3)	\$ 3	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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
BRC	01.2021	\$ 9.106	SEK 76.822	\$ 248	\$ 0	\$ 248	0,00
CBK	01.2021	960	8.185	37	0	37	0,00
HUS	01.2021	9.960	84.734	358	0	358	0,01
MYI	01.2021	10.044	85.128	322	0	322	0,00
UAG	01.2021	SEK 116	\$ 14	0	0	0	0,00
				\$ 965	\$ 0	\$ 965	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W 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		
BPS	01.2021	SGD	100.666	\$ 75.883	\$ 0	\$ (284)	0,00		
	02.2021	\$	75.886	SGD 100.666	283	0	283		
BRC	01.2021		521	697	7	0	7		
	02.2021		324	430	2	0	2		
CBK	01.2021		70.704	95.200	1.327	0	1.327		
GLM	02.2021	SGD	787	\$ 595	0	0	0		
HUS	01.2021	\$	2.466	SGD 3.299	31	0	31		
	02.2021		2.264	3.004	9	0	9		
MYI	01.2021	SGD	44.970	\$ 33.794	0	(231)	(231)		
	02.2021	\$	33.796	SGD 44.970	231	0	231		
NGF	01.2021	SGD	101.090	\$ 75.865	0	(623)	(623)		
	01.2021	\$	70.448	SGD 94.433	1.003	0	1.003		
	02.2021		75.867	101.090	623	0	623		
SCX	01.2021		29.434	39.498	451	0	451		
SSB	01.2021		7.756	10.398	112	0	112		
	02.2021		138	183	1	0	1		
UAG	01.2021		2.388	3.199	32	0	32		
	02.2021		609	815	7	0	7		
						\$ 4.119	\$ (1.138)	\$ 2.981	0,01
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>								<b>\$ 169.806</b>	<b>0,91</b>
<b>Summe Anlagen</b>								<b>\$ 18.397.527</b>	<b>98,69</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>								<b>\$ 244.334</b>	<b>1,31</b>
<b>Nettovermögen</b>								<b>\$ 18.641.861</b>	<b>100,00</b>

### 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	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc. 2,572 % fällig am 03.06.2031	26.05.2020	\$ 8.000	\$ 8.534	0,05
General Motors Co. 6,800 % fällig am 01.10.2027	07.05.2020	1.796	2.316	0,01
Noble Corp. PLC	23.12.2020	0	738	0,00
Occidental Petroleum Corp. 5,500 % fällig am 01.12.2025	08.12.2020 - 11.12.2020	41.278	42.719	0,23
		<b>\$ 51.074</b>	<b>\$ 54.307</b>	<b>0,29</b>

(l) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 69.197 als Sicherheiten verpfändet.

(m) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 23.266 und Barmittel in Höhe von USD 72.080 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 498 und Barmittel in Höhe von USD 244 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 441.421 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(5.300)	290.257	0	284.957
<b>Summen</b>	<b>\$ 817.267</b>	<b>\$ 17.577.753</b>	<b>\$ 2.507</b>	<b>\$ 18.397.527</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 9.776.555	\$ 44.303	\$ 9.820.858
Investmentfonds	1.193.986	0	0	1.193.986
Pensionsgeschäfte	0	2.731.635	0	2.731.635
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(40.209)	188.416	13	148.220
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(1.088.744)	0	(1.088.744)
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.153.777</b>	<b>\$ 11.607.862</b>	<b>\$ 44.316</b>	<b>\$ 12.805.955</b>

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

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

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	(2,800) %	17.01.2020	16.10.2021	€ (687)	\$ (819)	(0,01)
	(2,800)	19.08.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.811)	(2.197)	(0,01)
	(2,800)	04.01.2021	TBD <sup>(1)</sup>	(568)	(695)	0,00
	(1,250)	16.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(4.144)	(5.068)	(0,03)
BRC	(1,250)	05.03.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(4.195)	(5.129)	(0,03)
	(1,250)	17.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(2.967)	(3.628)	(0,02)
	(0,800)	09.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	£ (5.214)	(7.124)	(0,04)
	0,900	11.08.2020	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (767)	(770)	(0,01)
CFR	(1,500)	04.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	€ (2.122)	(2.594)	(0,01)
	(1,250)	30.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.952)	(2.388)	(0,01)
	(1,150)	17.02.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(4.880)	(5.914)	(0,03)
	(1,150)	03.03.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(4.070)	(4.934)	(0,03)
JML	(1,150)	03.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.855)	(2.268)	(0,01)
	(2,800)	23.04.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(405)	(487)	0,00
	(2,800)	22.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.156)	(1.414)	(0,01)
	(2,600)	02.08.2019	TBD <sup>(1)</sup>	(10.029)	(11.847)	(0,06)
	(2,600)	16.08.2019	TBD <sup>(1)</sup>	(5.046)	(5.966)	(0,03)
	(2,000)	02.07.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(4.618)	(5.594)	(0,03)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (68.836)</b>	<b>(0,37)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 6.871	\$ (6.450)	\$ 421
BPS	(58.101)	71.760	13.659
BRC	(13.838)	17.202	3.364
CBK	20.109	(16.742)	3.367
DUB	(73)	190	117
FBF	530	(550)	(20)
GLM	(7.513)	6.065	(1.448)
GST	3.870	(3.880)	(10)
HUS	34.084	(30.900)	3.184
JLN	(12)	0	(12)
JPM	46.020	(55.630)	(9.610)
MYC	521	(520)	1
MYI	7.636	(7.343)	293
NGF	1.003	(610)	393
RBC	(2)	0	(2)
SCX	53.532	(66.450)	(12.918)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
SSB	\$ 18.102	\$ (15.080)	\$ 3.022
TOR	53.819	(66.080)	(12.261)
UAG	3.248	(2.320)	928

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	59,79	46,62
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,85	33,39
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,71	k. A.
Investmentfonds	9,56	9,73
Pensionsgeschäfte	0,25	22,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	(0,33)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,65	0,60
Freiverkehrsfinanzderivate	0,91	0,94
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(8,87)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,37)	(0,25)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Albanien	0,13	k. A.
Angola	0,09	0,15
Argentinien	0,56	0,76
Australien	0,02	0,01
Österreich	0,26	0,04
Weissrussland	0,08	k. A.
Bermuda	0,41	0,24
Brasilien	0,62	0,69
Kanada	0,38	0,20
Cayman-Inseln	2,55	2,49
Chile	0,25	0,04
China	0,91	k. A.
Kolumbien	0,42	0,57
Costa Rica	k. A.	0,02
Kroatien	k. A.	0,06
Curacao	0,21	0,32
Dominikanische Republik	0,55	0,27
Ecuador	0,19	0,37
Ägypten	0,46	0,42
Finnland	0,12	k. A.
Frankreich	2,71	2,05
Deutschland	3,57	2,43
Ghana	0,12	0,14
Guernsey, Kanalinseln	0,45	0,24
Hongkong	0,58	0,02
Indien	0,07	0,07
Indonesien	2,11	1,12
Irland	1,21	0,87
Insel Man	0,24	0,05
Israel	0,00	k. A.
Italien	3,30	1,80
Elfenbeinküste	0,06	0,07
Japan	0,78	0,15
Jersey, Kanalinseln	0,86	0,79
Jordanien	0,07	k. A.
Kasachstan	0,20	0,28
Kenia	0,05	0,07
Liberia	0,08	k. A.
Luxemburg	3,78	3,14
Mazedonien	0,06	0,02
Malaysia	0,07	k. A.
Mauritius	0,05	0,07
Mexiko	2,33	1,76
Marokko	0,04	k. A.
Multinational	0,28	0,24
Niederlande	2,87	2,88
Nigeria	0,23	0,23
Norwegen	0,16	0,07
Oman	0,42	0,39
Panama	0,20	0,27
Paraguay	0,09	k. A.
Peru	0,07	k. A.
Portugal	0,14	0,00
Katar	0,86	0,90
Rumänien	0,19	0,21
Russland	0,55	0,59

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Saudi-Arabien	1,23	0,90
Senegal	0,05	0,07
Serbien	0,01	k. A.
Singapur	0,20	k. A.
Slowenien	0,05	k. A.
Südafrika	0,59	0,68
Spanien	0,98	0,75
Sri Lanka	0,08	k. A.
Schweden	0,01	0,01
Schweiz	1,17	1,17
Trinidad und Tobago	0,02	0,03
Tunesien	0,02	0,02
Türkei	1,21	1,77
Ukraine	0,95	1,29
Vereinigte Arabische Emirate	0,57	k. A.
Großbritannien	9,14	6,81
USA	19,31	32,47
Uruguay	0,00	0,00
Venezuela	0,02	0,03
Kurzfristige Instrumente	14,68	6,44
Investmentfonds	9,56	9,73
Pensionsgeschäfte	0,25	22,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,03)	(0,33)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,03)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,67	0,53
Zinsswaps	0,02	0,04
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	0,00
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	0,08
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,47)	(0,34)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,35	1,21
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(8,87)
Sonstige Aktiva und Passiva	1,31	(4,33)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged 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		
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>								<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>ALBANIEN</b>								<b>ALBANIEN</b>					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
Albania Government International Bond				Petrobras Global Finance BV				4,500 % fällig am 15.03.2023	3.000	3.145	0,21		
3,500 % fällig am 16.06.2027	€	1.800	2,358	0,16	5,093 % fällig am 15.01.2030	\$	2.820	3,155	0,21	5,250 % fällig am 15.08.2022	270	283	0,02
				5,375 % fällig am 01.10.2029	£	1.400	2,213	0,15	5,500 % fällig am 15.02.2024	\$	500	546	0,04
				6,250 % fällig am 14.12.2026		500	814	0,06	<b>QNB Finance Ltd.</b>				
				6,625 % fällig am 16.01.2034		200	335	0,02	1,310 % fällig am 12.02.2022	6.900	6.926	0,47	
				6,900 % fällig am 19.03.2049	\$	400	508	0,03	<b>Sands China Ltd.</b>				
				Summe Brasilien		10.229	0,69	4,375 % fällig am 18.06.2030	300	335	0,02		
								4,600 % fällig am 08.08.2023	300	319	0,02		
								5,400 % fällig am 08.08.2028	400	470	0,03		
								<b>Seagate HDD Cayman</b>					
								4,125 % fällig am 15.01.2031	200	214	0,01		
								<b>Sunac China Holdings Ltd.</b>					
								6,500 % fällig am 09.07.2023	700	727	0,05		
								6,650 % fällig am 03.08.2024	800	835	0,06		
								7,000 % fällig am 09.07.2025	700	731	0,05		
								7,250 % fällig am 14.06.2022	3.100	3.204	0,22		
								7,500 % fällig am 01.02.2024	900	951	0,06		
								7,950 % fällig am 11.10.2023	300	320	0,02		
								8,350 % fällig am 19.04.2023	200	211	0,01		
								<b>Tencent Holdings Ltd.</b>					
								1,810 % fällig am 26.01.2026	1.700	1.740	0,12		
								<b>Trafford Centre Finance Ltd.</b>					
								0,773 % fällig am 28.07.2038	£	300	346	0,02	
								<b>Transocean Guardian Ltd.</b>					
								5,875 % fällig am 15.01.2024	\$	546	460	0,03	
								<b>Transocean Poseidon Ltd.</b>					
								6,875 % fällig am 01.02.2027	200	183	0,01		
								<b>Transocean, Inc.</b>					
								7,250 % fällig am 01.11.2025	300	155	0,01		
								7,500 % fällig am 15.01.2026	500	232	0,02		
								8,000 % fällig am 01.02.2027	4.800	2.286	0,15		
								<b>UPCB Finance Ltd.</b>					
								4,000 % fällig am 15.01.2027	€	630	786	0,05	
								<b>Wynn Macau Ltd.</b>					
								5,125 % fällig am 15.12.2029	\$	1.200	1.228	0,08	
								5,500 % fällig am 15.01.2026	300	312	0,02		
								5,625 % fällig am 26.08.2028	400	422	0,03		
										41.504	2,79		
										41.876	2,82		
								<b>Summe Cayman Inseln</b>					
								<b>CHILE</b>					
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
								<b>Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.</b>					
								3,650 % fällig am 07.05.2030	300	338	0,02		
								4,700 % fällig am 07.05.2050	800	1.008	0,07		
								<b>GNL Quintero S.A.</b>					
								4,634 % fällig am 31.07.2029	600	669	0,05		
										2.015	0,14		
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
								<b>Chile Government International Bond</b>					
								2,450 % fällig am 31.01.2031	2.100	2.252	0,15		
								<b>Summe Chile</b>			4.267	0,29	
								<b>CHINA</b>					
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
								<b>Bank of China Ltd.</b>					
								0,988 % fällig am 24.06.2023	2.400	2.393	0,16		
								1,250 % fällig am 24.06.2025	4.000	4.003	0,27		
								<b>CNPC Global Capital Ltd.</b>					
								1,125 % fällig am 23.06.2023	3.000	3.005	0,20		
								<b>Eastern Creation Investment Holdings Ltd.</b>					
								1,000 % fällig am 10.09.2023	1.200	1.196	0,08		
								<b>New Metro Global Ltd.</b>					
								4,800 % fällig am 15.12.2024	1.300	1.323	0,09		
								6,500 % fällig am 23.04.2021	300	303	0,02		
								<b>Sinopec Group Overseas Development Ltd.</b>					
								2,150 % fällig am 13.05.2025	2.900	2.990	0,20		
								2,750 % fällig am 03.05.2021	200	201	0,02		
								<b>Summe China</b>			15.414	1,04	
								<b>KOLUMBIEN</b>					
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
								<b>Colombia Government International Bond</b>					
								5,000 % fällig am 15.06.2045	4.600	5.630	0,38		
								5,625 % fällig am 26.02.2044	500	649	0,04		
								<b>Summe Kolumbien</b>			6.279	0,42	

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
<b>JURACAO</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Teva Pharmaceutical Finance Co. BV				Societe Generale S.A.				Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust			
3,850 % fällig am 10.11.2021	\$ 5.700	\$ 5.787	0,39	4,000 % fällig am 12.01.2027	\$ 300	\$ 339	0,02	5,125 % fällig am 30.11.2024	786	743	0,05
Summe Curacao		5.787	0,39			36.959	2,49	Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>HONGKONG</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Dominican Republic Government International Bond				Altice France S.A.				CNOOC Finance Ltd.			
4,875 % fällig am 23.09.2032	2.000	2.220	0,15	3,000 % fällig am 31.01.2026	€ 2.981	3.592	0,24	3,000 % fällig am 09.05.2023	\$ 1.700	1.769	0,12
6,500 % fällig am 15.02.2048	3.400	4.029	0,27	3,846 % fällig am 31.01.2026	\$ 194	193	0,01	Far East Horizon Ltd.			
6,850 % fällig am 27.01.2045	1.600	1.958	0,13	Casino Guichard Perrachon S.A.				3,375 % fällig am 18.02.2025	400	405	0,03
6,875 % fällig am 29.01.2026	500	604	0,04	5,500 % fällig am 31.01.2024	€ 2.000	2.442	0,16	Fortune Star BVI Ltd.			
Summe Dominikanische Republik		8.811	0,59	Numericable Group S.A.				5,950 % fällig am 19.10.2025	1.600	1.679	0,11
<b>ECUADOR</b>				<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>INDIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Ecuador Government International Bond				Deutsche Bank AG				Lenovo Group Ltd.			
0,000 % fällig am 31.07.2030 (e)	316	151	0,01	1,375 % fällig am 03.09.2026	€ 900	1.138	0,08	3,421 % fällig am 12.02.2030	600	631	0,04
0,500 % fällig am 31.07.2030	1.021	661	0,04	1,463 % fällig am 27.02.2023	\$ 400	399	0,03	Summe Hongkong		9.020	0,61
0,500 % fällig am 31.07.2035	2.675	1.461	0,10	1,625 % fällig am 20.01.2027	€ 300	384	0,03				
0,500 % fällig am 31.07.2040	1.226	623	0,04	1,750 % fällig am 17.01.2028	300	387	0,03				
Summe Ecuador		2.896	0,19	1,750 % fällig am 19.11.2030	2.800	3.604	0,24				
<b>ÄGYPTEN</b>				<b>INDONESIEN</b>				<b>INDONESIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Egypt Government International Bond				IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)							
4,750 % fällig am 11.04.2025	€ 2.000	2.554	0,17	3,625 % fällig am 15.05.2025 (c)	€ 1.000	1.251	0,08	Pelabuhan Indonesia Persero PT			
5,625 % fällig am 16.04.2030	100	128	0,01	IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				4,875 % fällig am 01.10.2024	700	774	0,05
6,375 % fällig am 11.04.2031	2.800	3.694	0,25	3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)	3.450	4.351	0,29	Pertamina Persero PT			
8,500 % fällig am 31.01.2047	\$ 900	1.023	0,07	INEOS Styrolution Group GmbH				4,875 % fällig am 03.05.2022	400	421	0,03
Summe Ägypten		7.399	0,50	2,250 % fällig am 16.01.2027	1.500	1.784	0,12	6,500 % fällig am 07.11.2048	3.500	4.936	0,33
<b>FINNLAND</b>				<b>IRLAND</b>				<b>IRLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Nokia Oyj				Infineon Technologies AG				Fair Oaks Loan Funding DAC			
3,125 % fällig am 15.05.2028	€ 1.500	2.022	0,14	1,125 % fällig am 14.10.2021	200	259	0,02	1,900 % fällig am 15.07.2031	€ 400	493	0,03
<b>FRANKREICH</b>				<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>				<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Altice France S.A.				Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust				ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC			
7,375 % fällig am 01.05.2026	\$ 6.400	6.744	0,45	5,250 % fällig am 30.05.2025	61	57	0,00	2,700 % fällig am 11.06.2023	2.800	3.486	0,23
Auchan Holding S.A.											
3,250 % fällig am 23.07.2027	€ 2.600	3.673	0,25								
BNP Paribas S.A.											
1,904 % fällig am 30.09.2028	\$ 1.100	1.120	0,07								
2,219 % fällig am 09.06.2026	600	628	0,04								
2,819 % fällig am 19.11.2025	500	533	0,04								
3,500 % fällig am 16.11.2027	600	674	0,04								
4,705 % fällig am 10.01.2025	5.600	6.229	0,42								
5,198 % fällig am 10.01.2030	700	869	0,06								
BPCE S.A.											
2,375 % fällig am 14.01.2025	300	317	0,02								
3,000 % fällig am 22.05.2022	300	311	0,02								
3,500 % fällig am 23.10.2027	400	447	0,03								
Credit Agricole S.A.											
1,907 % fällig am 16.06.2026	1.600	1.661	0,11								
Electricite de France S.A.											
4,500 % fällig am 21.09.2028	1.200	1.433	0,10								
Holding d'Infrastructures de Transport SASU											
1,625 % fällig am 18.09.2029	€ 100	130	0,01								
La Mondiale SAM											
5,050 % fällig am 17.12.2025 (g)	800	1.134	0,08								
Loxam S.A.S.											
3,250 % fällig am 14.01.2025	800	984	0,07								
3,750 % fällig am 15.07.2026	200	250	0,02								
Mercialys S.A.											
4,625 % fällig am 07.07.2027	900	1.215	0,08								
RCI Banque S.A.											
1,125 % fällig am 15.01.2027	200	250	0,02								
Renault S.A.											
1,250 % fällig am 24.06.2025	1.100	1.320	0,09								
2,375 % fällig am 25.05.2026	5.400	6.698	0,45								

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged 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
<b>AerCap Ireland Capital DAC</b> 3,150 % fällig am 15.02.2024	\$ 3.800	\$ 3.986	0,27	<b>JERSEY, KANALINSELN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Logicor Financing SARL</b> 3,250 % fällig am 13.11.2028	1.600	2.308	0,15
<b>AIB Group PLC</b> 6,250 % fällig am 23.06.2025 (g)(i)	€ 600	814	0,06	<b>AA Bond Co. Ltd.</b> 2,750 % fällig am 31.07.2043	£ 1.400	\$ 1.887	0,13	<b>Nielsen Co. Luxembourg SARL</b> 5,500 % fällig am 01.10.2021	\$ 1.224	1.231	0,08
<b>Bank of Ireland Group PLC</b> 7,500 % fällig am 19.05.2025 (g)(i)	1.600	2.246	0,15	2,875 % fällig am 31.07.2043	1.029	1.409	0,09	<b>Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.</b> 6,125 % fällig am 07.02.2022	2.200	2.319	0,16
<b>GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.</b> 3,373 % fällig am 15.11.2025	\$ 300	333	0,02	4,875 % fällig am 31.07.2043	500	708	0,05	<b>SIG Combibloc Purchase Co. SARL</b> 2,125 % fällig am 18.06.2025	€ 500	645	0,04
4,418 % fällig am 15.11.2035	300	358	0,02	5,500 % fällig am 31.07.2050	2.271	3.301	0,22	<b>Stena International S.A.</b> 6,125 % fällig am 01.02.2025	\$ 500	495	0,03
<b>GE Capital UK Funding Unlimited Co.</b> 5,875 % fällig am 18.01.2033	€ 800	1.508	0,10	<b>Adient Global Holdings Ltd.</b> 3,500 % fällig am 15.08.2024	€ 100	122	0,01	<b>Summer BC Holdco SARL</b> 5,750 % fällig am 31.10.2026	€ 2.400	3.106	0,21
<b>James Hardie International Finance DAC</b> 3,625 % fällig am 01.10.2026	€ 900	1.139	0,08	<b>Atrium European Real Estate Ltd.</b> 3,000 % fällig am 11.09.2025	1.800	2.255	0,15	<b>Telecom Italia Capital S.A.</b> 6,000 % fällig am 30.09.2034	\$ 600	732	0,05
<b>Perrigo Finance Unlimited Co.</b> 3,150 % fällig am 15.06.2030	\$ 200	214	0,01	<b>Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.</b> 3,950 % fällig am 30.06.2022	£ 2.700	3.743	0,25				
<b>Smurfit Kappa Acquisitions ULC</b> 2,875 % fällig am 15.01.2026	€ 500	678	0,05	<b>Summe Jersey, Kanalinseln</b>		13.425	0,90				
<b>Summe Irland</b>		16.359	1,10	<b>JORDANIEN</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
<b>INSEL MAN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Jordan Government International Bond</b> 4,950 % fällig am 07.07.2025	\$ 400	426	0,03	<b>Alice Financing S.A.</b> 2,897 % fällig am 31.01.2026	1.382	1.355	0,09
<b>NE Property BV</b> 2,625 % fällig am 22.05.2023	700	892	0,06	5,850 % fällig am 07.07.2030	800	884	0,06	<b>Summe Luxemburg</b>		67.359	4,53
3,375 % fällig am 14.07.2027	2.400	3.187	0,21	<b>Summe Jordanien</b>		1.310	0,09	<b>MAZEDONIEN</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Summe Isle of Man</b>		4.079	0,27	<b>KASACHSTAN</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>North Macedonia Government International Bond</b> 2,750 % fällig am 18.01.2025	€ 300	390	0,02
<b>ITALIEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Kazakhstan Government International Bond</b> 5,125 % fällig am 21.07.2025	4.200	4.975	0,33	3,675 % fällig am 03.06.2026	400	549	0,04
<b>Atlantia SpA</b> 1,625 % fällig am 03.02.2025	300	367	0,03	<b>KENIA</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Summe Mazedonien</b>		939	0,06
1,875 % fällig am 13.07.2027	300	364	0,02	<b>Kenya Government International Bond</b> 8,000 % fällig am 22.05.2032	600	701	0,05	<b>MALAYSIA</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>Banca Monte dei Paschi di Siena SpA</b> 2,625 % fällig am 28.04.2025	1.500	1.890	0,13	<b>LIBERIA</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Petronas Capital Ltd.</b> 7,875 % fällig am 22.05.2022	\$ 1.200	1.322	0,09
3,625 % fällig am 24.09.2024	1.600	2.070	0,14	<b>Royal Caribbean Cruises Ltd.</b> 10,875 % fällig am 01.06.2023	1.300	1.482	0,10	<b>MAURITIUS</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,000 % fällig am 10.07.2022	2.900	3.692	0,25	<b>LUXEMBURG</b> <b>WANDELANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Greenko Solar Mauritius Ltd.</b> 5,550 % fällig am 29.01.2025	1.400	1.456	0,10
5,375 % fällig am 18.01.2028	1.200	1.279	0,09	<b>Corestate Capital Holding S.A.</b> 1,375 % fällig am 28.11.2022	€ 1.200	1.173	0,08	<b>MEXIKO</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
8,000 % fällig am 22.01.2030	3.000	3.631	0,24	<b>ADLER Group S.A.</b> 2,750 % fällig am 13.11.2026	700	879	0,06	<b>Petroleos Mexicanos</b> 2,750 % fällig am 21.04.2027	€ 2.600	3.002	0,20
8,500 % fällig am 10.09.2030	2.500	3.094	0,21	<b>Alice Financing S.A.</b> 7,500 % fällig am 15.05.2026	\$ 6.860	7.248	0,49	3,750 % fällig am 21.02.2024	2.500	3.108	0,21
<b>Immobiliare Grande Distribuzione SIQ SpA</b> 2,125 % fällig am 28.11.2024	200	232	0,02	<b>Alice France Holding S.A.</b> 4,000 % fällig am 15.02.2028	€ 2.500	2.925	0,20	4,750 % fällig am 26.02.2029	2.400	2.970	0,20
<b>Intesa Sanpaolo SpA</b> 5,017 % fällig am 26.06.2024	\$ 1.800	1.970	0,13	6,000 % fällig am 15.02.2028	\$ 700	710	0,05	4,875 % fällig am 21.02.2028	1.500	1.879	0,13
5,710 % fällig am 15.01.2026	1.600	1.832	0,12	8,000 % fällig am 15.05.2027	€ 400	533	0,04	5,625 % fällig am 23.01.2046	\$ 1.616	1.393	0,09
6,500 % fällig am 24.02.2021	6.100	6.149	0,41	<b>Aroundtown S.A.</b> 5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 1.800	2.151	0,14	5,950 % fällig am 28.01.2031	3.300	3.297	0,22
7,000 % fällig am 19.01.2021 (g)(i)	€ 2.100	2.580	0,17	<b>Bevco Lux SARL</b> 1,500 % fällig am 16.09.2027	€ 700	904	0,06	6,500 % fällig am 13.03.2027	2.900	3.059	0,21
<b>UniCredit SpA</b> 1,200 % fällig am 20.01.2026	1.000	1.244	0,08	<b>Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK)</b> 10,000 % fällig am 09.11.2024 ^ (c)	\$ 507	130	0,01	6,625 % fällig am 15.06.2035	6.500	6.445	0,43
2,200 % fällig am 22.07.2027	4.200	5.463	0,37	<b>Corestate Capital Holding S.A.</b> 3,500 % fällig am 15.04.2023 (k)	€ 6.400	6.533	0,44	6,625 % fällig am 15.06.2038	400	386	0,03
2,569 % fällig am 22.09.2026	\$ 1.300	1.328	0,09	<b>CPI Property Group S.A.</b> 1,625 % fällig am 23.04.2027	400	504	0,03	6,750 % fällig am 21.09.2047	2.400	2.254	0,15
4,129 % fällig am 14.01.2022	350	360	0,02	2,750 % fällig am 12.05.2026	2.300	3.059	0,21	6,840 % fällig am 23.01.2030	3.300	3.460	0,23
6,572 % fällig am 14.01.2022	1.450	1.528	0,10	4,750 % fällig am 08.03.2023	\$ 3.300	3.540	0,24	7,690 % fällig am 23.01.2050	3.884	3.923	0,27
7,500 % fällig am 03.06.2026 (g)(i)	€ 1.000	1.424	0,10	<b>Eurofins Scientific SE</b> 3,750 % fällig am 17.07.2026	€ 3.300	4.746	0,32	<b>Trust Fibra Uno</b> 6,390 % fällig am 15.01.2050	300	352	0,02
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 9.600	11.398	0,77	<b>FEL Energy SARL</b> 5,750 % fällig am 01.12.2040	\$ 4.900	5.224	0,35	<b>Summe Mexiko</b>		35.528	2,39
<b>Unipol Gruppo SpA</b> 3,250 % fällig am 23.09.2030	€ 1.400	1.817	0,12	<b>Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.</b> 4,250 % fällig am 06.04.2024	£ 2.900	4.235	0,28	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Summe Italien</b>		53.712	3,61	4,950 % fällig am 19.07.2022	\$ 900	950	0,06	<b>Mexico Government International Bond</b> 3,771 % fällig am 24.05.2061	500	522	0,03
<b>ELFENBEINKÜSTE</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>				5,150 % fällig am 11.02.2026	200	228	0,02	5,750 % fällig am 12.10.2110	1.100	1.467	0,10
<b>Ivory Coast Government International Bond</b> 5,875 % fällig am 17.10.2031	250	339	0,02	6,510 % fällig am 07.03.2022	500	531	0,04				
6,875 % fällig am 17.10.2040	450	627	0,04	<b>Intelsat Jackson Holdings S.A.</b> 5,500 % fällig am 01.08.2023 ^	1.025	697	0,05				
<b>Summe Elfenbeinküste</b>		966	0,06	8,500 % fällig am 15.10.2024 ^	\$ 400	287	0,02				
<b>JAPAN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				9,750 % fällig am 15.07.2025 ^	100	72	0,00				
<b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b> 3,407 % fällig am 07.03.2024	\$ 700	761	0,05	<b>Lincoln Financing SARL</b> 3,625 % fällig am 01.04.2024	€ 4.600	5.704	0,38				
<b>Nissan Motor Co. Ltd.</b> 2,652 % fällig am 17.03.2026	€ 300	389	0,03	3,875 % fällig am 01.04.2024	1.800	2.205	0,15				
3,201 % fällig am 17.09.2028	1.000	1.329	0,09								
4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 7.800	8.625	0,58								
4,810 % fällig am 17.09.2030	400	451	0,03								
<b>Summe Japan</b>		11.555	0,78								

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
<b>MULTINATIONAL</b>				<b>OMAN</b>				<b>SENEGAL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Ardagh Packaging Finance PLC				Oman Government International Bond				Senegal Government International Bond			
4,125 % fällig am 15.08.2026	\$ 1.700	\$ 1.778	0,12	6,500 % fällig am 08.03.2047	\$ 1.200	\$ 1.181	0,08	4,000 % fällig am 17.04.2025	\$ 1.600	\$ 1.790	0,12
Connect Finco SARL				6,750 % fällig am 17.01.2048	5.300	5.264	0,35	4,500 % fällig am 26.10.2046	11.300	13.743	0,92
6,750 % fällig am 01.10.2026	2.600	2.805	0,19	Summe Oman		6.445	0,43	4,625 % fällig am 04.10.2047	200	248	0,02
Delta Air Lines, Inc.								5,250 % fällig am 16.01.2050	400	546	0,04
4,500 % fällig am 20.10.2025	400	428	0,03					Summe Saudi-Arabien		16.759	1,13
Summe multinational		5.011	0,34	<b>PANAMA</b>				<b>SENEGAL</b>			
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Airbus SE				Panama Government International Bond				Senegal Government International Bond			
1,625 % fällig am 09.06.2030	€ 800	1.077	0,07	6,700 % fällig am 26.01.2036	1.400	2.085	0,14	4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 500	654	0,05
Athora Netherlands NV				8,125 % fällig am 28.04.2034	100	147	0,01	6,250 % fällig am 23.05.2033	\$ 300	338	0,02
7,000 % fällig am 19.06.2025 (g)(i)	400	549	0,04	Summe Panama		2.232	0,15	Summe Senegal		992	0,07
Conti-Gummi Finance BV				<b>PARAGUAY</b>				<b>SERBIEN</b>			
1,125 % fällig am 25.09.2024	500	634	0,04	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
2,125 % fällig am 27.11.2023	1.100	1.424	0,10	Paraguay Government International Bond				Serbia Government International Bond			
Cooperative Rabobank UA				5,600 % fällig am 13.03.2048	1.000	1.290	0,08	3,125 % fällig am 15.05.2027	€ 100	138	0,01
6,625 % fällig am 29.06.2021 (g)(i)	2.600	3.275	0,22	6,100 % fällig am 11.08.2044	300	403	0,03	Summe Serbien			
ING Groep NV				Summe Paraguay		1.693	0,11	<b>SINGAPUR</b>			
5,750 % fällig am 16.11.2026 (g)(i)	\$ 500	544	0,04	<b>PORTUGAL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,500 % fällig am 16.04.2025 (g)(i)	1.700	1.873	0,13	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,750 % fällig am 16.04.2024 (g)	1.500	1.641	0,11	Galp Energia SGPS S.A.				Flex Ltd.			
MDGH - GMTN BV				2,000 % fällig am 15.01.2026	€ 2.100	2.655	0,18	3,750 % fällig am 01.02.2026	\$ 3.000	3.359	0,23
3,950 % fällig am 21.05.2050	800	961	0,06	<b>KATAR</b>				<b>SLOWENIEN</b>			
NN Group NV				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,500 % fällig am 15.01.2026 (g)	€ 2.300	3.253	0,22	Nakilat, Inc.				Nova Ljubljanska Banka d.d.			
NXP BV				6,067 % fällig am 31.12.2033	\$ 1.600	2.052	0,14	3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 700	777	0,05
5,350 % fällig am 01.03.2026	\$ 1.150	1.387	0,09	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.				Summe Slowenien			
Syngenta Finance NV				5,838 % fällig am 30.09.2027	2.700	3.162	0,21	<b>SUDAFRIKA</b>			
3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 2.000	2.643	0,18	Summe Katar		10.046	0,68	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,441 % fällig am 24.04.2023	\$ 2.000	2.100	0,14	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,892 % fällig am 24.04.2025	2.100	2.255	0,15	Qatar Government International Bond				AngloGold Ashanti Holdings PLC			
5,182 % fällig am 24.04.2028	2.000	2.147	0,14	4,400 % fällig am 16.04.2050	5.900	7.705	0,52	3,750 % fällig am 01.10.2030	\$ 200	215	0,01
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				4,817 % fällig am 14.03.2049	1.300	1.777	0,12	Growthpoint Properties International Pty. Ltd.			
1,125 % fällig am 15.10.2024	€ 1.600	1.823	0,12	5,103 % fällig am 23.04.2048	400	564	0,04	5,872 % fällig am 02.05.2023	400	425	0,03
1,250 % fällig am 31.03.2023	730	865	0,06	Summe Katar		15.260	1,03	SASOL Financing USA LLC			
4,500 % fällig am 01.03.2025	400	508	0,03	<b>RUMÄNIEN</b>				5,875 % fällig am 27.03.2024	500	533	0,04
Upjohn Finance BV				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Südafrika		1.173	0,08
0,816 % fällig am 23.06.2022	900	1.117	0,08	RCS & RDS S.A.				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Volkswagen Financial Services NV				3,250 % fällig am 05.02.2028	€ 100	123	0,01	South Africa Government International Bond			
1,125 % fällig am 18.09.2023	€ 2.800	3.867	0,26	Summe Rumänien		3.189	0,21	4,850 % fällig am 30.09.2029	1.600	1.703	0,11
Volkswagen International Finance NV				<b>RUSSLAND</b>				4,875 % fällig am 14.04.2026	1.000	1.096	0,07
3,500 % fällig am 17.06.2025 (g)	€ 1.100	1.423	0,10	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,750 % fällig am 30.09.2049	1.000	1.006	0,07
3,875 % fällig am 17.06.2029 (g)	1.600	2.121	0,14	ALROSA Finance S.A.				5,875 % fällig am 16.09.2025	4.600	5.278	0,36
Summe Niederlande		37.487	2,52	3,100 % fällig am 25.06.2027	\$ 2.200	2.270	0,15	Summe Südafrika		10.256	0,69
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>SPANIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Sigma Bidco BV				Romania Government International Bond				Abertis Infraestructuras S.A.			
3,500 % fällig am 02.07.2025	2.500	3.014	0,20	4,125 % fällig am 11.03.2039	2.000	3.066	0,20	1,625 % fällig am 15.07.2029	€ 300	387	0,03
Ziggo BV				Summe Rumänien		3.189	0,21	1,875 % fällig am 26.03.2032	800	1.039	0,07
3,000 % fällig am 31.01.2029	1.700	2.079	0,14	<b>RUSSLAND</b>				2,250 % fällig am 29.03.2029	1.100	1.480	0,10
Ziggo Financing Partnership				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,000 % fällig am 27.03.2031	500	714	0,05
2,659 % fällig am 30.04.2028	\$ 1.902	1.889	0,13	ALROSA Finance S.A.				3,375 % fällig am 27.11.2026	€ 2.800	4.214	0,28
Summe Niederlande		44.469	2,99	3,100 % fällig am 25.06.2027	\$ 2.200	2.270	0,15	ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A.			
<b>NIGERIA</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Nigeria Government International Bond				4,650 % fällig am 09.04.2024	700	758	0,05	1,375 % fällig am 17.06.2025	€ 900	1.132	0,08
7,143 % fällig am 23.02.2030	700	757	0,05	MMK International Capital DAC				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
7,875 % fällig am 16.02.2032	2.300	2.536	0,17	4,375 % fällig am 13.06.2024	1.500	1.621	0,11	6,000 % fällig am 29.03.2024 (g)(i)	200	263	0,02
Summe Nigeria		3.293	0,22	Summe Russland		10.502	0,71	6,000 % fällig am 15.01.2026 (g)(i)	1.000	1.354	0,09
<b>NORWEGEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Aker BP ASA				Russia Government International Bond				Banco de Sabadell S.A.			
3,750 % fällig am 15.01.2030	500	527	0,04	2,875 % fällig am 04.12.2025	€ 3.300	4.465	0,30	1,125 % fällig am 27.03.2025	400	499	0,03
4,750 % fällig am 15.06.2024	1.400	1.449	0,10	4,750 % fällig am 27.05.2026	\$ 1.200	1.388	0,10	1,125 % fällig am 11.03.2027	300	380	0,03
Yara International ASA				Summe Russland		10.502	0,71	1,750 % fällig am 29.06.2023	700	879	0,06
3,148 % fällig am 04.06.2030	200	217	0,01	<b>SAUDI-ARABIEN</b>				1,750 % fällig am 10.05.2024	100	127	0,01
Summe Norwegen		2.193	0,15	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Banco Santander S.A.			
<b>NORWEGEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Aker BP ASA				Saudi Government International Bond				3,490 % fällig am 28.05.2030	\$ 200	224	0,01
3,750 % fällig am 15.01.2030	500	527	0,04	2,900 % fällig am 22.10.2025	400	432	0,03	4,375 % fällig am 14.01.2026 (g)(i)	€ 400	492	0,03
4,750 % fällig am 15.06.2024	1.400	1.449	0,10	Summe Saudi-Arabien				6,250 % fällig am 11.09.2021 (g)(i)	1.800	2.259	0,15
Yara International ASA				<b>SAUDI-ARABIEN</b>				CaixaBank S.A.			
3,148 % fällig am 04.06.2030	200	217	0,01	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				5,875 % fällig am 09.10.2027 (g)(i)	600	812	0,05
Summe Norwegen		2.193	0,15	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Spanien		16.255	1,09

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Diversified Income Duration Hedged 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	
<b>SRI LANKA</b>				<b>Barclays PLC</b>				<b>NatWest Markets PLC</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>3,375 % fällig am 02.04.2025</b>				<b>2,375 % fällig am 21.05.2023</b>				
Sri Lanka Government International Bond				€	700	946	0,06		1.900	1.977	0,13	
7,550 % fällig am 28.03.2030	\$	924	0,06	\$	800	835	0,06					
7,850 % fällig am 14.03.2029		600	0,02	£	300	436	0,03	Pearson Funding PLC				
					1.800	2.623	0,18	3,750 % fällig am 04.06.2030	£	100	158	0,01
Summe Sri Lanka		1.272	0,08	<b>British Telecommunications PLC</b>				<b>Rolls-Royce PLC</b>				
<b>SCHWEDEN</b>				<b>9,625 % fällig am 15.12.2030</b>				<b>0,875 % fällig am 09.05.2024</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>2,625 % fällig am 25.02.2030</b>				<b>4,625 % fällig am 16.02.2026</b>				
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	€	300	0,03		700	1.162	0,08	5,750 % fällig am 15.10.2027	\$	200	222	0,01
1,750 % fällig am 14.01.2025								5,750 % fällig am 15.10.2027	£	200	303	0,02
<b>SCHWEIZ</b>				<b>easyJet PLC</b>				<b>Santander UK Group Holdings PLC</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>1,750 % fällig am 09.02.2023</b>				<b>0,309 % fällig am 27.03.2024</b>				
Credit Suisse AG	\$	7.600	0,58		300	379	0,03	3,373 % fällig am 05.01.2024	€	700	861	0,06
6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)								3,625 % fällig am 14.01.2026	\$	200	211	0,01
								3,823 % fällig am 03.11.2028	£	200	307	0,02
Credit Suisse Group AG		334	0,02		500	611	0,04	6,750 % fällig am 24.06.2024 (g)(i)	\$	2.100	2.370	0,16
3,750 % fällig am 26.03.2025					3.000	3.673	0,25		£	2.100	3.127	0,21
					300	368	0,02	<b>Swiss Re Finance UK PLC</b>				
UBS AG		221	0,01					<b>2,714 % fällig am 04.06.2052</b>				
7,625 % fällig am 17.08.2022 (i)		5.370	0,36									
								<b>Tesco Property Finance PLC</b>				
UBS Group AG		1.273	0,09					<b>5,411 % fällig am 13.07.2044</b>				
4,125 % fällig am 15.04.2026								<b>5,744 % fällig am 13.04.2040</b>				
5,125 % fällig am 29.07.2026 (g)		536	0,04									
								<b>TP ICAP PLC</b>				
Summe Schweiz		16.312	1,10					<b>5,250 % fällig am 26.01.2024</b>				
<b>TRINIDAD UND TOBAGO</b>				<b>Hammerson PLC</b>				<b>Travis Perkins PLC</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>1,750 % fällig am 15.03.2023</b>				<b>3,750 % fällig am 17.02.2026</b>				
Trinidad & Tobago Government International Bond								<b>4,500 % fällig am 07.09.2023</b>				
4,500 % fällig am 04.08.2026		772	0,05					<b>Unique Pub Finance Co. PLC</b>				
								<b>5,659 % fällig am 30.06.2027</b>				
<b>TUNESIEN</b>				<b>2,000 % fällig am 01.07.2022</b>				<b>Valaris PLC</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>6,500 % fällig am 20.05.2024</b>				<b>5,750 % fällig am 01.10.2044 ^</b>				
Banque Centrale de Tunisie Government International Bond	€	400	0,03					<b>8,000 % fällig am 31.01.2024 ^</b>				
5,625 % fällig am 17.02.2024								<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b>				
								<b>4,125 % fällig am 15.08.2030</b>				
<b>TURKEI</b>				<b>Informa PLC</b>				<b>4,250 % fällig am 15.01.2030</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>1,250 % fällig am 22.04.2028</b>				<b>5,000 % fällig am 15.04.2027</b>				
Turkey Government International Bond								<b>Virgin Money UK PLC</b>				
4,875 % fällig am 09.10.2026	\$	3.649	0,24					<b>2,875 % fällig am 24.06.2025</b>				
4,875 % fällig am 16.04.2043		2.459	0,17					<b>3,375 % fällig am 24.04.2026</b>				
5,125 % fällig am 17.02.2028		3.958	0,27					<b>4,000 % fällig am 25.09.2026</b>				
5,600 % fällig am 14.11.2024		2.940	0,20					<b>4,000 % fällig am 03.09.2027</b>				
5,750 % fällig am 11.05.2047		4.489	0,30					<b>Vmed O2 UK Financing PLC</b>				
6,125 % fällig am 24.10.2028		962	0,06					<b>3,250 % fällig am 31.01.2031</b>				
6,750 % fällig am 30.05.2040		321	0,02					<b>4,000 % fällig am 31.01.2029</b>				
6,875 % fällig am 17.03.2036		437	0,03					<b>Vodafone Group PLC</b>				
Summe Türkei		19.215	1,29					<b>7,000 % fällig am 04.04.2079</b>				
<b>UKRAINE</b>				<b>Legal &amp; General Group PLC</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>5,625 % fällig am 24.03.2031 (g)</b>				<b>Connect Finco SARL</b>				
Ukraine Government International Bond	€	4.900	0,39					<b>0,375 % - 5,500 % fällig am 11.12.2026</b>				
4,375 % fällig am 27.01.2030		5.746	0,43					<b>Valaris PLC</b>				
6,750 % fällig am 20.06.2026		1.216	0,08					<b>TBD % fällig am 17.08.2021</b>				
7,375 % fällig am 25.09.2032	\$	661	0,04					<b>112 111 0,01</b>				
7,750 % fällig am 01.09.2021		1.453	0,10					<b>1.708 0,11</b>				
7,750 % fällig am 01.09.2022		2.894	0,20					<b>NON-AGENCY-MBS</b>				
8,994 % fällig am 01.02.2024		340	0,02					<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>				
Summe Ukraine		12.310	0,83					<b>1,073 % fällig am 20.10.2051</b>				
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				<b>Lloyds Bank Corporate Markets PLC</b>				<b>USA</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>1,500 % fällig am 23.06.2023</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				
DAE Sukuk Dific Ltd.								<b>Ames Mortgage Investment Trust</b>				
3,750 % fällig am 15.02.2026		1.133	0,08					<b>0,928 % fällig am 25.10.2035</b>				
								<b>1,348 % fällig am 25.06.2035</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Lloyds Banking Group PLC</b>				<b>Accredited Mortgage Loan Trust</b>				
<b>Emirate of Abu Dhabi Government International Bond</b>				<b>1,875 % fällig am 15.01.2026</b>				<b>0,628 % fällig am 25.09.2035</b>				
1,700 % fällig am 02.03.2031		1.402	0,09					<b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>				
2,700 % fällig am 02.09.2070		4.678	0,31					<b>0,748 % fällig am 25.02.2036</b>				
3,875 % fällig am 16.04.2050		1.589	0,11					<b>Aircraft Certificate Owner Trust</b>				
								<b>7,001 % fällig am 20.09.2022</b>				
Summe Vereinigte Arabische Emirate		7.669	0,51					<b>Ameriquec Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>				
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>Mitchells &amp; Butlers Finance PLC</b>				<b>0,853 % fällig am 25.11.2035</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>0,493 % fällig am 15.12.2030</b>				<b>3,523 % fällig am 25.11.2032 ^</b>				
Barclays Bank PLC	\$	1.025	0,08					<b>159 159 0,01</b>				
7,625 % fällig am 21.11.2022 (i)		1.141	0,08					<b>677 686 0,05</b>				
10,000 % fällig am 21.05.2021	£	10.736	0,72									



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged 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		
Delta Air Lines, Inc.				GLP Capital LP				Newell Brands, Inc.					
2,900 % fällig am 28.10.2024	\$	75	0,00	3,350 % fällig am 01.09.2024	100	105	0,01	4,875 % fällig am 01.06.2025	200	220	0,01		
7,000 % fällig am 01.05.2025		2.100	0,16	5,750 % fällig am 01.06.2028	600	712	0,05	NGPL PipeCo LLC					
7,375 % fällig am 15.01.2026		25	0,00	Goldman Sachs Group, Inc.				7,768 % fällig am 15.12.2037	\$	2.340	\$	3.172	0,21
Digital Euro Finco LLC				0,041 % fällig am 21.04.2023				Nissan Motor Acceptance Corp.					
2,500 % fällig am 16.01.2026	€	500	0,05	0,079 % fällig am 26.09.2023				2,600 % fällig am 28.09.2022					
Doctors Co.				3,375 % fällig am 27.03.2025				3,875 % fällig am 21.09.2023					
6,500 % fällig am 15.10.2023	\$	1.800	0,13	3,500 % fällig am 23.01.2025				Noble Corp.					
El Paso Natural Gas Co. LLC				3,750 % fällig am 22.05.2025				15,000 % fällig am 16.02.2028 (b)					
8,375 % fällig am 15.06.2032				3,850 % fällig am 08.07.2024				NuStar Logistics LP					
Enable Midstream Partners LP				Gray Oak Pipeline LLC				5,625 % fällig am 28.04.2027					
4,150 % fällig am 15.09.2029				3,450 % fällig am 15.10.2027				6,000 % fällig am 01.06.2026					
4,950 % fällig am 15.05.2028				Greif, Inc.				Occidental Petroleum Corp.					
Energy Transfer Operating LP				6,500 % fällig am 01.03.2027				3,200 % fällig am 15.08.2026					
3,600 % fällig am 01.02.2023				Hawaiian Airlines Pass-Through Certificates				3,400 % fällig am 15.04.2026					
6,625 % fällig am 15.10.2036				7,375 % fällig am 15.09.2027				3,500 % fällig am 15.08.2029					
7,500 % fällig am 01.07.2038				HCA, Inc.				5,500 % fällig am 01.12.2025 (j)					
Energy Transfer Partners LP				4,500 % fällig am 15.02.2027				5,875 % fällig am 01.09.2025					
4,500 % fällig am 01.11.2023				4,750 % fällig am 01.05.2023				OneMain Finance Corp.					
5,000 % fällig am 01.10.2022				Howard Hughes Corp.				4,000 % fällig am 15.09.2030					
5,875 % fällig am 01.03.2022				5,375 % fällig am 15.03.2025				6,125 % fällig am 15.03.2024					
EPR Properties				Huntington Ingalls Industries, Inc.				6,875 % fällig am 15.03.2025					
3,750 % fällig am 15.08.2029				3,844 % fällig am 01.05.2025				7,125 % fällig am 15.03.2026					
EQM Midstream Partners LP				Hyatt Hotels Corp.				7,750 % fällig am 01.10.2021					
4,000 % fällig am 01.08.2024				3,225 % fällig am 01.09.2022				ONEOK, Inc.					
EQT Corp.				Infor, Inc.				5,850 % fällig am 15.01.2026					
7,875 % fällig am 01.02.2025				1,750 % fällig am 15.07.2025				Oxford Finance LLC					
8,750 % fällig am 01.02.2030				Ingram Micro, Inc.				6,375 % fällig am 15.12.2022					
Fidelity National Financial, Inc.				5,000 % fällig am 10.08.2022				Pacific Gas & Electric Co.					
3,400 % fällig am 15.06.2030				International Lease Finance Corp.				1,750 % fällig am 16.06.2022					
FirstEnergy Corp.				5,875 % fällig am 15.08.2022				2,500 % fällig am 01.02.2031					
7,375 % fällig am 15.11.2031				8,625 % fällig am 15.01.2022				3,150 % fällig am 01.01.2026					
Ford Motor Credit Co. LLC				IPALCO Enterprises, Inc.				3,300 % fällig am 15.03.2027 ^					
0,000 % fällig am 14.05.2021				4,250 % fällig am 01.05.2030				3,300 % fällig am 01.12.2027 ^					
0,000 % fällig am 01.12.2021				IQVIA, Inc.				3,300 % fällig am 01.08.2040					
0,000 % fällig am 07.12.2022				3,250 % fällig am 15.03.2025				3,400 % fällig am 15.08.2024 ^					
1,104 % fällig am 12.10.2021				Jefferies Finance LLC				3,450 % fällig am 01.07.2025					
1,456 % fällig am 15.02.2023				6,250 % fällig am 03.06.2026				3,500 % fällig am 15.06.2025 ^					
2,748 % fällig am 14.06.2024				JetBlue Pass-Through Trust				3,750 % fällig am 15.02.2024 ^					
3,021 % fällig am 06.03.2024				4,000 % fällig am 15.05.2034				3,750 % fällig am 01.07.2028					
3,096 % fällig am 04.05.2023				Kinder Morgan Energy Partners LP				3,850 % fällig am 15.11.2023 ^					
3,336 % fällig am 18.03.2021				6,500 % fällig am 01.02.2037				3,950 % fällig am 01.12.2047 ^					
3,350 % fällig am 01.11.2022				6,950 % fällig am 15.01.2038				4,250 % fällig am 01.08.2023					
3,360 % fällig am 07.01.2022				Kinder Morgan, Inc.				4,250 % fällig am 15.03.2046 ^					
4,063 % fällig am 01.11.2024				5,300 % fällig am 01.12.2034				4,450 % fällig am 15.04.2042 ^					
5,584 % fällig am 18.03.2024				7,750 % fällig am 15.01.2032				4,550 % fällig am 01.07.2030					
5,596 % fällig am 07.01.2022				7,800 % fällig am 01.08.2031				4,650 % fällig am 01.08.2028					
5,875 % fällig am 02.08.2021				Kraft Heinz Foods Co.				Pacific Life Global Funding					
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				4,625 % fällig am 30.01.2029				1,200 % fällig am 24.06.2025					
6,500 % fällig am 01.10.2025				L Brands, Inc.				Patterson-UTI Energy, Inc.					
6,750 % fällig am 15.03.2022				6,875 % fällig am 01.11.2035				5,150 % fällig am 15.11.2029					
Freedom Mortgage Corp.				Las Vegas Sands Corp.				Piper Sandler Cos.					
7,625 % fällig am 01.05.2026				3,200 % fällig am 08.08.2024				4,740 % fällig am 15.10.2021					
8,125 % fällig am 15.11.2024				3,500 % fällig am 18.08.2026				5,200 % fällig am 15.10.2023					
8,250 % fällig am 15.04.2025				3,900 % fällig am 08.08.2029				Plains All American Pipeline LP					
GE Capital Funding LLC				Marriott International, Inc.				4,300 % fällig am 31.01.2043					
4,550 % fällig am 15.05.2032				4,625 % fällig am 15.06.2030				4,500 % fällig am 15.12.2026					
General Electric Co.				Marriott Ownership Resorts, Inc.				4,900 % fällig am 15.02.2045					
0,875 % fällig am 17.05.2025				6,500 % fällig am 15.09.2026				5,150 % fällig am 01.06.2042					
4,125 % fällig am 19.09.2035				7,750 % fällig am 15.03.2022				6,650 % fällig am 15.01.2037					
5,550 % fällig am 05.01.2026				Micron Technology, Inc.				Puget Energy, Inc.					
5,625 % fällig am 16.09.2031				4,663 % fällig am 15.02.2030				4,100 % fällig am 15.06.2030					
6,875 % fällig am 10.01.2039				Midwest Connector Capital Co. LLC				QEP Resources, Inc.					
General Motors Co.				3,900 % fällig am 01.04.2024				5,625 % fällig am 01.03.2026					
6,800 % fällig am 01.10.2027 (j)				Morgan Stanley				Quicken Loans LLC					
General Motors Financial Co., Inc.				4,000 % fällig am 23.07.2025				5,250 % fällig am 15.01.2028					
0,167 % fällig am 10.05.2021				MPLX LP				QVC, Inc.					
5,100 % fällig am 17.01.2024				3,500 % fällig am 01.12.2022				4,375 % fällig am 15.03.2023					
Global Atlantic Fin Co.				4,250 % fällig am 01.12.2027				5,450 % fällig am 15.08.2034					
4,400 % fällig am 15.10.2029				MPT Operating Partnership LP				Rio Oil Finance Trust					
				3,692 % fällig am 05.06.2028				9,250 % fällig am 06.07.2024					
				4,000 % fällig am 19.08.2022				9,750 % fällig am 06.01.2027					
				National Fuel Gas Co.				Rockies Express Pipeline LLC					
				5,200 % fällig am 15.07.2025				3,600 % fällig am 15.05.2025					
				Navient Corp.				4,800 % fällig am 15.05.2030					
				5,500 % fällig am 25.01.2023				4,950 % fällig am 15.07.2029					
				6,500 % fällig am 15.06.2022				Sabine Pass Liquefaction LLC					
				6,625 % fällig am 26.07.2021				4,500 % fällig am 15.05.2030					
				7,250 % fällig am 25.01.2022				5,000 % fällig am 15.03.2027					
								5,625 % fällig am 15.04.2023					
								5,625 % fällig am 01.03.2025					

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
5,750 % fällig am 15.05.2024 5,875 % fällig am 30.06.2026	\$ 2.700	3.088	0,21	CenturyLink, Inc. 2,397 % fällig am 15.03.2027	4.038	3.997	0,27	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 3,300 % fällig am 26.04.2038	253	253	0,02
Santander Holdings USA, Inc. 3,450 % fällig am 02.06.2025	600	656	0,04	Charter Communications Operating LLC 1,900 % fällig am 01.02.2027	6.341	6.317	0,42	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust 2,906 % fällig am 25.09.2035	20	20	0,00
Sensata Technologies, Inc. 4,375 % fällig am 15.02.2030	100	108	0,01	CommScope, Inc. 3,397 % fällig am 06.04.2026	494	492	0,03	HarborView Mortgage Loan Trust 0,592 % fällig am 19.05.2035	236	224	0,02
Service Properties Trust 4,350 % fällig am 01.10.2024	300	297	0,02	Dell International LLC 2,750 % fällig am 19.09.2025	5.605	5.615	0,38	0,632 % fällig am 19.06.2035	6	6	0,00
4,750 % fällig am 01.10.2026	500	495	0,03	Envision Healthcare Corp. 3,897 % fällig am 10.10.2025	784	658	0,04	0,692 % fällig am 20.10.2045	594	565	0,04
Southwest Airlines Co. 5,125 % fällig am 15.06.2027	1.300	1.548	0,10	Financial & Risk U.S. Holdings, Inc. 3,250 % fällig am 01.10.2025	€ 1.287	1.574	0,11	0,772 % fällig am 19.11.2035	10	10	0,00
5,250 % fällig am 04.05.2025	1.300	1.507	0,10	Hilton Worldwide Finance LLC 1,898 % fällig am 22.06.2026	\$ 5.185	5.135	0,35	HSI Asset Securitization Corp. Trust 0,588 % fällig am 25.11.2035	1.985	1.839	0,12
Sprint Corp. 7,250 % fällig am 15.09.2021	100	104	0,01	INEOS Finance PLC 2,500 % fällig am 01.04.2024	€ 9.870	11.937	0,80	Impac Secured Assets Trust 0,308 % fällig am 25.03.2037 ^	75	74	0,01
7,875 % fällig am 15.09.2023	100	116	0,01	Jefferies Finance LLC 3,147 % fällig am 03.06.2026	\$ 197	196	0,01	IndyMac Mortgage Loan Trust 0,328 % fällig am 25.07.2047	78	61	0,00
Sprint Spectrum Co. LLC 5,152 % fällig am 20.09.2029	800	928	0,06	Level 3 Financing, Inc. 1,897 % fällig am 01.03.2027	4.163	4.107	0,28	2,981 % fällig am 25.06.2037 ^	16	15	0,00
Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 2.600	3.224	0,22	MPH Acquisition Holdings LLC 3,750 % fällig am 07.06.2023	864	862	0,06	3,025 % fällig am 25.12.2036 ^	3	3	0,00
4,750 % fällig am 15.01.2028	\$ 1.450	1.528	0,10	Nielsen Finance LLC 2,146 % fällig am 04.10.2023	2.128	2.124	0,14	Lehman Mortgage Trust 6,000 % fällig am 25.09.2037 ^	150	152	0,01
Sunoco Logistics Partners Operations LP 5,350 % fällig am 15.05.2045	100	111	0,01	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 0,808 % fällig am 25.11.2029	1	1	0,00
Synchrony Financial 2,850 % fällig am 25.07.2022	200	207	0,01	American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010 8,084 % fällig am 15.02.2050	600	1.128	0,07	3,359 % fällig am 25.05.2036	6	5	0,00
Synovus Bank 2,289 % fällig am 10.02.2023	250	253	0,02	Erie Tobacco Asset Securitization Corp., New York Revenue Bonds, Series 2005 6,000 % fällig am 01.06.2028	100	100	0,01	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 3,236 % fällig am 25.03.2036 ^	52	44	0,00
Sysco Corp. 5,650 % fällig am 01.04.2025	1.700	2.023	0,14	Illinois State General Obligation Bonds, (BABS), Series 2010 6,630 % fällig am 01.02.2035	400	459	0,03	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust 3,385 % fällig am 25.08.2035	2	2	0,00
T-Mobile USA, Inc. 3,750 % fällig am 15.04.2027	1.000	1.140	0,08	6,725 % fällig am 01.04.2035	220	254	0,02	Residential Accredit Loans, Inc. Trust 0,348 % fällig am 25.05.2047	105	98	0,01
3,875 % fällig am 15.04.2030	300	348	0,02	7,350 % fällig am 01.07.2035	350	418	0,03	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 0,368 % fällig am 25.06.2037	339	321	0,02
Tallgrass Energy Partners LP 5,500 % fällig am 15.01.2028	700	717	0,05	Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABS), Series 2010 6,655 % fällig am 01.04.2057	981	1.518	0,10	SunTrust Asset Mortgage Investments Trust 0,358 % fällig am 25.09.2047 ^	808	854	0,06
6,000 % fällig am 31.12.2030	700	722	0,05	Texas Public Finance Authority Revenue Notes, Series 2014 8,250 % fällig am 01.07.2024	165	166	0,01	0,548 % fällig am 25.05.2036	589	556	0,04
Targa Resources Partners LP 5,500 % fällig am 01.03.2030	900	978	0,07	Tobacco Settlement Financing Corp., Virginia Revenue Bonds, Series 2007 6,706 % fällig am 01.06.2046	95	99	0,01	SunTrust Alternative Loan Trust 0,798 % fällig am 25.12.2035 ^	5	4	0,00
Time Warner Cable LLC 5,875 % fällig am 15.11.2040	800	1.071	0,07	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Thornburg Mortgage Securities Trust 1,398 % fällig am 25.06.2037 ^	19	18	0,00
6,750 % fällig am 15.06.2039	100	143	0,01	Banc of America Alternative Loan Trust 0,548 % fällig am 25.01.2037 ^	130	97	0,01	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 1,809 % fällig am 25.11.2042	11	10	0,00
Toil Brothers Finance Corp. 4,875 % fällig am 15.03.2027	1.000	1.146	0,08	Banc of America Funding Trust 3,500 % fällig am 20.01.2047 ^	76	72	0,00	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 4,170 % fällig am 25.09.2036 ^	142	60	0,00
U.S. Airways Pass-Through Trust 3,950 % fällig am 15.05.2027	232	216	0,01	BCAP LLC Trust 1,584 % fällig am 26.11.2046	138	140	0,01	Summe USA 354.626	23,85		
United Airlines Pass-Through Trust 3,450 % fällig am 01.06.2029	156	157	0,01	6,250 % fällig am 26.08.2036	2.312	1.376	0,09	<b>VENEZUELA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
3,450 % fällig am 07.01.2030	168	167	0,01	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 2,370 % fällig am 25.02.2036	13	13	0,00	Petroleos de Venezuela S.A. 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	1.600	64	0,01
3,500 % fällig am 01.09.2031	182	181	0,01	Bear Stearns ALT-A Trust 0,588 % fällig am 25.04.2035	28	28	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
5,875 % fällig am 15.04.2029	4.500	4.874	0,33	Citigroup Mortgage Loan Trust 2,530 % fällig am 25.10.2035	97	99	0,01	Venezuela Government International Bond 6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	241	24	0,00
VEREIT Operating Partnership LP 4,875 % fällig am 01.06.2026	100	117	0,01	2,900 % fällig am 25.10.2046 ^	38	36	0,00	7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	1.528	148	0,01
VICI Properties LP 3,500 % fällig am 15.02.2025	300	307	0,02	Countrywide Alternative Loan Trust 0,548 % fällig am 25.07.2038 ^	4	2	0,00	7,750 % fällig am 13.10.2019 ^	1.900	184	0,01
VMware, Inc. 4,500 % fällig am 15.05.2025	700	802	0,05	0,572 % fällig am 20.05.2046 ^	401	336	0,02	Summe Venezuela 420	0,03		
4,650 % fällig am 15.05.2027	1.300	1.523	0,10	0,648 % fällig am 25.04.2036	655	227	0,02	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
4,700 % fällig am 15.05.2030	100	120	0,01	2,089 % fällig am 25.01.2036	16	16	0,00	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
Washington Prime Group LP 6,450 % fällig am 15.08.2024	1.400	844	0,06	6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	166	130	0,01	(3,480) % fällig am			
Wells Fargo & Co. 1,338 % fällig am 04.05.2025	€ 200	255	0,02	6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	1.025	674	0,05	13.09.2021 (e)(f) ARS	6.717	49	0,00
1,741 % fällig am 04.05.2030	300	408	0,03	6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	257	203	0,01	<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
2,393 % fällig am 02.06.2028	\$ 1.000	1.066	0,07	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0,688 % fällig am 25.04.2046	1.925	734	0,05	0,086 % fällig am			
2,406 % fällig am 30.10.2025	5.200	5.500	0,37	1,569 % fällig am 25.04.2046	19	8	0,00	09.02.2021 (e)(f)(l) \$	2.200	2.200	0,15
Western Midstream Operating LP 4,100 % fällig am 01.02.2025	1.500	1.548	0,10	3,220 % fällig am 25.03.2037 ^	16	15	0,00	0,122 % fällig am	15.000	15.000	1,01
6,250 % fällig am 01.02.2050	2.900	3.195	0,21	6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	6	301	0,02	09.02.2021 (e)(f)(l)			
Westinghouse Air Brake Technologies Corp. 3,200 % fällig am 15.06.2025	100	108	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2037	77	47	0,00	Summe kurzfristige Instrumente		17.249	1,16
Wynn Resorts Finance LLC 5,125 % fällig am 01.10.2029	1.300	1.363	0,09	6,500 % fällig am 25.11.2036 ^	138	87	0,01	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$1.228.715	82,63	
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 3,250 % fällig am 01.12.2027	2.200	2.204	0,15								

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>INVESTMENTFONDS</b>							
<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>							
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (h)	250.000	\$ 2.522	0,17	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (h)	5.023.076	51.235	3,45
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)	651.264	7.613	0,51	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	7.393	\$ 74	0,00
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (h)	538.168	6.921	0,47			68.365	4,60
				<b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>			
				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)	771.770	78.479	5,28
				Summe Investmentfonds		\$ 146.844	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 <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 11.970	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (12.209)	\$ 11.970	\$ 11.970	0,81
NOM	0,100	31.12.2020	04.01.2021	27.200	U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.05.2048	(27.868)	27.200	27.200	1,83
				Summe Pensionsgeschäfte		\$ (40.077)	\$ 39.170	\$ 39.170	2,64

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### 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	
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2021	667	\$ (111)	(0,01)	
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	230	17	0,00	
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2021	1.165	141	0,01	
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	39	(26)	0,00	
				\$ 21	0,00	
				Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate	\$ 21	0,00

### 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 3.800	\$ 60	0,00
Atlantia SpA	1,000	20.06.2025	€ 700	19	0,00
Casino Guichard Perrachon S.A.	1,000	20.12.2021	1.600	55	0,00
Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.06.2022	1.200	110	0,01
Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.12.2022	1.100	77	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	\$ 2.800	191	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	800	21	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	1.100	27	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2025	2.600	8	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2023	€ 400	0	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	4.100	(44)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	6.800	(559)	(0,04)
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.12.2024	4.600	(34)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2024	300	4	0,00
				\$ (65)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 15.200	\$ (508)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000 %	20.12.2024	\$ 4.836	\$ 334	0,02
CDX.EM-33 5-Year Index	1,000	20.06.2025	37.335	2.973	0,20
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	46.500	1.871	0,13
iTraxx Crossover 34 5-Year Index	5,000	20.12.2025	€ 89.400	5.051	0,34
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	72.500	569	0,04
				\$ 10.798	0,73

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		0,750 %	16.12.2022	\$ 60.200	\$ 19	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2025	60.700	38	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2030	122.500	1.167	0,08
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,250	17.06.2025	95.400	(712)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,250	16.12.2050	32.400	317	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,500	18.12.2024	58.300	(2.773)	(0,19)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,500	17.06.2050	20.100	2.009	0,14
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,750	21.12.2026	21.300	(2.531)	(0,17)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,500	18.12.2024	33.600	(1.719)	(0,11)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,750	19.12.2023	58.300	(5.215)	(0,36)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,750	18.12.2029	1.900	(86)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,000	17.03.2051	€ 1.200	4	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,000	16.06.2051	8.500	29	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,250	17.03.2031	13.300	(141)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,250	16.06.2031	11.900	12	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,500	16.06.2026	32.700	90	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,000	16.06.2023	£ 17.600	(3)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,000	16.06.2026	21.800	(3)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,250	16.06.2031	6.700	(44)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,500	16.06.2051	1.000	(24)	0,00
						\$ (9.566)	(0,65)
						\$ 659	0,04

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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.01.2021	2.600	\$ (4)	\$ 0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450	20.01.2021	6.600	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	9.900	(16)	(2)	0,00
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	1.400	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	700	(5)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	3.900	(11)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775 %	17.03.2021	1.000	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	500	(1)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	3.200	(4)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	2.500	(5)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	3.200	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	3.600	(7)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	3.100	(4)	(2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	9.600	(8)	(6)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	3.300	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	5.100	(7)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	9.600	(9)	(11)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	3.300	(4)	(3)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	3.200	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	3.200	(5)	(5)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	5.300	(11)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	3.400	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	3.200	(4)	(4)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	5.800	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	5.800	(10)	(10)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	1.400	(2)	(2)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,950	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	1.200	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	3.600	(6)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	3.600	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	3.600	(4)	(2)	0,00
FBF	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	1.200	(2)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	17.02.2021	1.200	(3)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	2.500	(4)	(2)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	1.300	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	1.800	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	3.900	(3)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 33 5-Year Index	Verkauf	4,250	16.06.2021	12.700	(15)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	3.900	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	3.900	(4)	(2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	6.200	(4)	(4)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	3.500	(2)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	6.200	(7)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	3.500	(4)	(3)	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	3.300	(6)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	3.600	(7)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	1.800	(3)	0	0,00
MYC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	2.300	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	2.100	(3)	(1)	0,00
						\$ (242)	\$ (113)	(0,01)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Mexico Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 100	(2)	\$ 4	\$ 2	0,00
BRC	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 200	19	(2)	17	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 1.490	(59)	85	26	0,00
CBK	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	€ 600	(10)	21	11	0,00
FBF	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 700	66	(5)	61	0,00
GST	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 3.400	365	(66)	299	0,02
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 2.010	(67)	102	35	0,00
HUS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	€ 200	(3)	7	4	0,00
MYC	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 1.100	109	(12)	97	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 1.200	(8)	29	21	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	€ 900	(12)	21	9	0,00
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 900	100	(21)	79	0,01
					\$ 498	\$ 163	\$ 661	0,04

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	01.2021	\$ 7.785	AUD 10.543	\$ 351	\$ 0	\$ 351	0,02
	01.2021	817	€ 667	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	6.151	¥ 639.000	38	0	38	0,00
BPS	01.2021	14	PLN 54	1	0	1	0,00
	01.2021	€ 10.938	\$ 13.265	0	(120)	(120)	(0,01)
	01.2021	£ 1.264	\$ 1.688	0	(40)	(40)	0,00
BRC	01.2021	\$ 5	PLN 18	0	0	0	0,00
	03.2021	7.225	IDR 102.995.351	137	0	137	0,01
	01.2021	BRL 3.418	\$ 644	0	(14)	(14)	0,00
CBK	01.2021	\$ 658	BRL 3.418	0	0	0	0,00
	01.2021	BRL 3.418	\$ 658	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 675	BRL 3.418	0	(17)	(17)	0,00
GLM	01.2021	149	MXN 3.176	10	0	10	0,00
	01.2021	7	PLN 25	0	0	0	0,00
	02.2021	BRL 3.418	\$ 675	17	0	17	0,00
HUS	01.2021	75.678	14.890	320	0	320	0,02
	01.2021	¥ 639.000	6.174	0	(15)	(15)	0,00
	01.2021	\$ 7.468	BRL 37.839	0	(183)	(183)	(0,01)
JPM	01.2021	7.213	MXN 145.473	74	0	74	0,00
	02.2021	7.441	BRL 37.839	0	(158)	(158)	(0,01)
	02.2021	6.176	¥ 639.000	16	0	16	0,00
MYI	02.2021	1.869	RUB 142.484	50	0	50	0,00
	03.2021	7.573	CNH 49.806	57	0	57	0,00
	01.2021	€ 7.203	\$ 8.745	0	(69)	(69)	0,00
SCX	01.2021	£ 67.514	€ 90.286	0	(2.005)	(2.005)	(0,14)
	01.2021	\$ 3.196	€ 2.619	11	(3)	8	0,00
	01.2021	1.108	£ 819	11	0	11	0,00
UAG	01.2021	6	PLN 24	0	0	0	0,00
	01.2021	7.274	SEK 61.880	262	0	262	0,02
	02.2021	1.269	RUB 94.897	9	0	9	0,00
BPS	03.2021	7.218	CNH 47.808	106	0	106	0,01
	01.2021	7.216	ZAR 110.194	267	0	267	0,02
	01.2021	€ 119	\$ 146	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	\$ 296	€ 240	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	2.245	£ 1.650	10	0	10	0,00
	01.2021	7.268	NOK 64.350	247	0	247	0,02
SCX	01.2021	€ 248.691	\$ 297.831	0	(6.455)	(6.455)	(0,43)
	02.2021	248.691	304.491	0	(3)	(3)	0,00
	02.2021	\$ 4.121	RUB 313.677	104	0	104	0,01
				\$ 2.098	\$ (9.085)	\$ (6.987)	(0,47)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend II, 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	01.2021	€ 688	\$ 845	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
BPS	01.2021	5.000	6.109	3	(13)	(10)	0,00
	01.2021	\$ 124.096	€ 103.610	2.677	(1)	2.676	0,18
CBK	01.2021	€ 7	\$ 8	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 107	€ 89	2	0	2	0,00
HUS	01.2021	€ 418	\$ 507	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	\$ 16.510	€ 13.745	309	0	309	0,02
JPM	01.2021	205	168	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	1.372	1.125	5	0	5	0,00
SCX	01.2021	150.685	125.822	3.264	0	3.264	0,23
	02.2021	231.775	189.299	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2021	142.075	118.632	3.078	0	3.078	0,20
	02.2021	193.887	158.354	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 9.341	\$ (20)	\$ 9.321	0,63

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	£ 235	\$ 317	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
BRC	01.2021	3	4	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	1.655	2.260	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 278.344	£ 208.227	6.300	0	6.300	0,42
HUS	01.2021	£ 71	\$ 93	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 313.062	£ 234.080	6.923	0	6.923	0,47
MYI	01.2021	24.601	18.432	596	0	596	0,04
SCX	01.2021	£ 37.669	\$ 50.879	0	(614)	(614)	(0,04)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
SSB	01.2021	\$ 333.150	£ 249.584	\$ 8.028	\$ 0	\$ 8.028	0,54
				\$ 21.847	\$ (624)	\$ 21.223	1,43
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 24.105	1,62
Summe Anlagen						\$ 1.439.514	96,81
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 47.417	3,19
Nettovermögen						\$ 1.486.931	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.
- (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
Citigroup, Inc. 2,572 % fällig am 03.06.2031	26.05.2020	\$ 800	\$ 853	0,06
General Motors Co. 6,800 % fällig am 01.10.2027	07.05.2020	200	257	0,02
Noble Corp. PLC	23.12.2020	0	170	0,01
Occidental Petroleum Corp. 5,500 % fällig am 01.12.2025	08.12.2020 - 11.12.2020	3.300	3.447	0,23
		\$ 4.300	\$ 4.727	0,32

- (k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 31. Dezember 2020 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.021 als Sicherheiten verpfändet.
- (l) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 4.289 und Barmittel in Höhe von USD 70 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 52.906 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	21	24.764	0	24.785
Summen	\$ 68.386	\$ 1.370.719	\$ 409	\$ 1.439.514

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 1.090.756	\$ 5.192	\$ 1.095.948
Investmentfonds	125.162	0	0	125.162
Pensionsgeschäfte	0	135.908	0	135.908
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(22)	23.912	7	23.897
Summen	\$ 125.140	\$ 1.250.576	\$ 5.199	\$ 1.380.915

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

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

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BPS	(2.800) %	24.04.2020	TBD <sup>(1)</sup>	€ (823)	\$ (989)	(0,07)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (989)	(0,07)

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 383	\$ (300)	\$ 83
BPS	2.594	(3.050)	(456)
BRC	6	0	6
CBK	6.320	(5.087)	1.233
DUB	(6)	(60)	(66)
FBF	59	0	59
GLM	161	0	161
GST	311	(280)	31
HUS	5.551	(4.650)	901
JPM	267	(270)	(3)
MYC	124	70	194
MYI	935	(590)	345
SCX	(3.809)	4.289	480
SSB	8.028	(6.630)	1.398
TOR	3.077	(3.820)	(743)
UAG	104	0	104

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	60,58	55,72
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	19,32	30,58
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,73	k. A.
Investmentfonds	9,88	9,86
Pensionsgeschäfte	2,64	10,70
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,04	0,38
Freiverkehrsfinanzderivate	1,62	1,50
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	0,07	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Albanien	0,16	k. A.
Angola	0,09	0,16
Argentinien	0,59	1,10
Australien	0,01	0,02
Österreich	0,26	0,07
Weissrussland	0,10	k. A.
Bermuda	0,38	0,21
Brasilien	0,69	0,58
Kanada	0,49	0,27
Cayman-Inseln	2,82	3,58
Chile	0,29	0,05
China	1,04	k. A.
Kolumbien	0,42	0,58
Costa Rica	k. A.	0,02
Kroatien	k. A.	0,07
Curacao	0,39	0,49
Dominikanische Republik	0,59	0,29
Ecuador	0,19	0,35
Ägypten	0,50	0,38
Finnland	0,14	k. A.
Frankreich	3,00	2,23
Deutschland	3,51	2,90
Ghana	0,15	0,15
Guernsey, Kanalinseln	0,52	0,38
Hongkong	0,61	0,05
Indien	0,12	0,13
Indonesien	2,47	1,30
Irland	1,10	1,38

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Insel Man	0,27	0,06
Italien	3,61	2,12
Elfenbeinküste	0,06	0,06
Japan	0,78	0,20
Jersey, Kanalinseln	0,90	0,88
Jordanien	0,09	k. A.
Kasachstan	0,33	0,38
Kenia	0,05	0,05
Liberia	0,10	k. A.
Luxemburg	4,53	3,91
Mazedonien	0,06	0,03
Malaysia	0,09	k. A.
Mauritius	0,10	0,11
Mexiko	2,52	1,81
Marokko	0,05	k. A.
Multinational	0,34	0,31
Niederlande	2,99	2,94
Nigeria	0,22	0,23
Norwegen	0,15	0,11
Oman	0,43	0,39
Panama	0,15	0,28
Paraguay	0,11	k. A.
Portugal	0,18	k. A.
Katar	1,03	0,93
Rumänien	0,21	0,21
Russland	0,71	0,68
Saudi-Arabien	1,13	0,72
Senegal	0,07	0,07
Serbien	0,01	k. A.
Singapur	0,23	k. A.
Slowenien	0,05	k. A.
Südafrika	0,69	0,73
Spanien	1,09	1,27
Sri Lanka	0,08	k. A.
Schweden	0,03	0,02
Schweiz	1,10	1,51
Trinidad und Tobago	0,05	0,06
Tunesien	0,03	0,04
Türkei	1,29	1,91
Ukraine	0,83	1,40
Vereinigte Arabische Emirate	0,59	k. A.
Großbritannien	9,63	8,53
USA	23,85	33,59
Venezuela	0,03	0,04
Kurzfristige Instrumente	1,16	3,98
Investmentfonds	9,88	9,86
Pensionsgeschäfte	2,64	10,70
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und		
US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	0,05
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,03)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,73	0,38
Zinsswaps	(0,65)	(0,05)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und		
US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	0,10
Devisenterminkontrakte	(0,47)	(0,43)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	2,06	1,85
Sonstige Aktiva und Passiva	3,19	(8,74)
Nettovermögen	100,00	100,00











**Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Bond 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
EMC Mortgage Loan Trust 0,888 % fällig am 25.05.2040	\$ 133	\$ 131	0,00	0,408 % fällig am 25.05.2037	\$ 1.262	\$ 932	0,03	0,488 % fällig am 25.11.2036	\$ 3.149	\$ 2.973	0,09
Euro-Galaxy CLO BV 0,750 % fällig am 17.01.2031 0,820 % fällig am 10.11.2030	€ 1.800 2.800	2.202 3.427	0,07 0,11	0,468 % fällig am 25.03.2037 0,670 % fällig am 25.04.2037 0,733 % fällig am 25.12.2036	1.227 1.664 833	1.131 1.156 830	0,04 0,04 0,03	0,668 % fällig am 25.07.2036 0,688 % fällig am 25.07.2036 0,973 % fällig am 25.07.2034	1.005 1.295 534	889 1.138 525	0,03 0,04 0,02
Fieldstone Mortgage Investment Trust 0,470 % fällig am 25.11.2036 0,488 % fällig am 25.04.2047	\$ 1.303 5.240	951 4.345	0,03 0,14	Monroe Capital BSL CLO Ltd. 1,333 % fällig am 22.05.2027	5.267	5.266	0,16	Saxon Asset Securities Trust 0,318 % fällig am 25.10.2046	667	650	0,02
First Franklin Mortgage Loan Trust 0,868 % fällig am 25.11.2035 0,943 % fällig am 25.09.2035 0,958 % fällig am 25.04.2035 1,033 % fällig am 25.03.2035 1,048 % fällig am 25.07.2035	1.833 11 90 136 2.400	1.748 11 90 136 2.387	0,05 0,00 0,00 0,00 0,07	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,208 % fällig am 25.12.2036 0,278 % fällig am 25.10.2036 0,288 % fällig am 25.10.2036 0,288 % fällig am 25.11.2036 0,288 % fällig am 25.05.2037 0,298 % fällig am 25.09.2036 0,298 % fällig am 25.10.2036 0,298 % fällig am 25.11.2036 0,298 % fällig am 25.12.2036 0,328 % fällig am 25.03.2037	1.341 890 32 812 4.023 74 7.650 1.293 289 1.233	860 834 20 507 3.522 37 5.020 958 187 644	0,03 0,03 0,00 0,02 0,11 0,00 0,16 0,03 0,01 0,02	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 0,808 % fällig am 25.08.2035 0,913 % fällig am 25.02.2034 1,108 % fällig am 25.01.2036 SG Mortgage Securities Trust 0,358 % fällig am 25.10.2036 Shackleton CLO Ltd. 1,348 % fällig am 20.10.2028	2.621 457 407	2.044 452 355	0,06 0,01 0,01
First NLC Trust 0,328 % fällig am 25.08.2037	8.062	5.121	0,16	Morgan Stanley Capital, Inc. Trust 0,508 % fällig am 25.03.2036	1.304	1.141	0,04	Sierra Madre Funding Ltd. 0,533 % fällig am 07.09.2039 0,553 % fällig am 07.09.2039	3.134 17.983	2.868 16.455	0,09 0,51
Fremont Home Loan Trust 0,248 % fällig am 25.08.2036 0,278 % fällig am 25.11.2036 0,283 % fällig am 25.10.2036 0,398 % fällig am 25.05.2036 0,428 % fällig am 25.02.2037 0,488 % fällig am 25.02.2037 0,763 % fällig am 25.11.2035 0,883 % fällig am 25.07.2035 1,018 % fällig am 25.05.2034	710 2.050 2.374 1.408 9.455 1.848 6.788 1.436 2.091	304 1.033 2.167 1.064 7.547 946 6.324 1.429 2.052	0,01 0,03 0,07 0,03 0,24 0,03 0,20 0,04 0,06	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust 0,448 % fällig am 25.07.2036	1.874	1.013	0,03	SLM Student Loan Trust 1,715 % fällig am 25.04.2023 SoFi Consumer Loan Program LLC 2,770 % fällig am 25.05.2026	379 207	379 207	0,01 0,01
GE-WMC Mortgage Securities Trust 0,298 % fällig am 25.08.2036	11.688	7.399	0,23	Morgan Stanley Capital, Inc. Trust 0,508 % fällig am 25.03.2036	1.304	1.141	0,04	Soundview Home Loan Trust 0,208 % fällig am 25.11.2036 0,318 % fällig am 25.08.2037 0,358 % fällig am 25.06.2037 0,428 % fällig am 25.06.2037	290 2.070 3.360 4.860	119 1.899 2.712 3.955	0,00 0,06 0,08 0,12
Greystones Commercial Real Estate Notes 1,399 % fällig am 15.09.2037	9.200	9.131	0,28	New Century Home Equity Loan Trust 0,868 % fällig am 25.03.2035	536	518	0,02	0,708 % fällig am 25.10.2036 1,048 % fällig am 25.10.2037	669 4.741	659 4.140	0,02 0,13
Grosvenor Place CLO BV 0,720 % fällig am 30.10.2029	€ 3.395	4.149	0,13	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 0,478 % fällig am 25.10.2036 1,033 % fällig am 25.09.2035	2.229 818	624 823	0,02 0,03	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 0,300 % fällig am 25.09.2037 0,748 % fällig am 25.12.2036 0,973 % fällig am 25.05.2035 3,490 % fällig am 25.02.2037	563 2.088 314 1.744	303 2.054 311 932	0,01 0,06 0,01 0,03
GSA Home Equity Trust 0,598 % fällig am 25.08.2037 5,985 % fällig am 25.06.2036	\$ 290 6.969	288 2.853	0,01 0,09	NovaStar Mortgage Funding Trust 0,308 % fällig am 25.09.2037 0,318 % fällig am 25.11.2036 0,358 % fällig am 25.01.2037 2,023 % fällig am 25.03.2035	1.981 2.405 1.514 1.350	1.953 1.093 691 1.352	0,06 0,03 0,02 0,04	Structured Asset Investment Loan Trust 0,868 % fällig am 25.05.2035 1,123 % fällig am 25.01.2035 1,273 % fällig am 25.01.2035 1,723 % fällig am 25.01.2035 1,873 % fällig am 25.01.2035	2.417 5.219 397 456 244	2.419 4.952 385 306 56	0,08 0,15 0,01 0,01 0,00
GSAMP Trust 0,348 % fällig am 25.11.2036 0,408 % fällig am 25.06.2036 0,688 % fällig am 25.04.2036	3.331 4.162 713	2.113 4.029 584	0,07 0,13 0,02	OAK Hill European Credit Partners Designated Activity Co. 0,720 % fällig am 21.02.2030	€ 9.600	11.720	0,37	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 0,303 % fällig am 25.09.2036 0,328 % fällig am 25.01.2037 0,648 % fällig am 25.11.2037 1,153 % fällig am 25.11.2035 1,655 % fällig am 25.04.2035	8.882 950 3.017 6.400 134	7.094 579 2.884 6.259 132	0,22 0,02 0,09 0,20 0,00
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd. 1,138 % fällig am 20.04.2027	2.091	2.083	0,07	Option One Mortgage Loan Trust 0,368 % fällig am 25.04.2037 0,368 % fällig am 25.05.2037 0,883 % fällig am 25.08.2035	\$ 5.909 4.749 771	4.698 3.483 768	0,15 0,11 0,02	Structured Asset Securities Corp. Trust 0,838 % fällig am 25.09.2035	6.272	6.162	0,19
Home Equity Asset Trust 1,243 % fällig am 25.05.2035	423	422	0,01	Orwell Park CLO Designated Activity Co. 0,780 % fällig am 18.07.2029	€ 760	930	0,03	Tikehau CLO BV 0,880 % fällig am 07.12.2029	€ 11.000	13.454	0,42
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 0,308 % fällig am 25.07.2037 0,388 % fällig am 25.04.2037	887 1.046	613 803	0,02 0,03	Ownit Mortgage Loan Trust 0,448 % fällig am 25.05.2037	\$ 799	699	0,02	Toro European CLO DAC 0,650 % fällig am 15.04.2030	2.000	2.443	0,08
HSI Asset Securitization Corp. Trust 0,338 % fällig am 25.01.2037 0,368 % fällig am 25.12.2036 0,588 % fällig am 25.12.2036 0,928 % fällig am 25.01.2036	1.020 1.771 2.690 9.268	858 713 1.108 8.606	0,03 0,02 0,03 0,27	OZLME BV 0,820 % fällig am 18.01.2030	€ 2.000	2.446	0,08	Tralee CLO Ltd. 1,248 % fällig am 20.10.2027	\$ 3.793	3.784	0,12
IXIS Real Estate Capital Trust 0,378 % fällig am 25.01.2037	305	157	0,00	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 0,868 % fällig am 25.08.2035 1,093 % fällig am 25.06.2035 1,468 % fällig am 25.01.2036	\$ 900 3.800 1.600	899 3.790 1.563	0,03 0,12 0,05	Triaxx Prime CDO Ltd. 0,413 % fällig am 15.01.2039	3.008	1.128	0,04
Jamestown CLO Ltd. 0,927 % fällig am 15.07.2026	93	93	0,00	People's Choice Home Loan Securities Trust 1,093 % fällig am 25.05.2035 1,498 % fällig am 25.01.2035	4.700 926	4.523 918	0,14 0,03	Venture CLO Ltd. 1,087 % fällig am 15.01.2028	2.828	2.818	0,09
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,298 % fällig am 25.07.2036 0,418 % fällig am 25.05.2036 0,418 % fällig am 25.07.2036 4,582 % fällig am 25.01.2037	725 3.142 3.100 1.088	435 3.137 2.980 776	0,01 0,10 0,09 0,02	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 0,358 % fällig am 25.01.2037	1.848	1.809	0,06	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust 0,373 % fällig am 25.05.2037	4.631	4.325	0,14
Lehman XS Trust 0,468 % fällig am 25.05.2036	3.010	3.185	0,10	RAAC Trust 0,748 % fällig am 25.06.2044 0,908 % fällig am 25.10.2046 1,348 % fällig am 25.10.2045	192 1.992 1.716	171 1.947 1.730	0,01 0,06 0,05	Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust 0,448 % fällig am 25.05.2036 0,628 % fällig am 25.05.2036	1.095 895	954 791	0,03 0,02
Long Beach Mortgage Loan Trust 0,258 % fällig am 25.11.2036 0,588 % fällig am 25.02.2036 0,748 % fällig am 25.02.2036 0,828 % fällig am 25.01.2046 0,908 % fällig am 25.08.2045	9.992 3.319 316 2.273 631	4.509 3.243 276 2.268 629	0,14 0,10 0,01 0,07 0,02	Renaissance Home Equity Loan Trust 0,848 % fällig am 25.08.2032 3,269 % fällig am 25.09.2037 5,612 % fällig am 25.04.2037	9 789 2.967	9 665 1.236	0,00 0,02 0,04	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 0,448 % fällig am 25.04.2037 1,198 % fällig am 25.10.2034 1,873 % fällig am 25.11.2035	2.867 281 7.389	2.365 279 7.434	0,07 0,01 0,23
Man GLG Euro CLO DAC 0,870 % fällig am 15.01.2030	€ 700	854	0,03	Residential Asset Mortgage Products Trust 0,308 % fällig am 25.02.2037 0,518 % fällig am 25.05.2037 0,708 % fällig am 25.06.2037 1,078 % fällig am 25.05.2035	172 4.052 3 702	172 3.713 3 703	0,01 0,12 0,00 0,02	Zais CLO Ltd. 1,387 % fällig am 15.04.2028	4.067	4.054	0,13
Massachusetts Educational Financing Authority 1,165 % fällig am 25.04.2038	\$ 861	865	0,03	Residential Asset Securities Corp. Trust 0,448 % fällig am 25.07.2036	1.281	1.271	0,04	541.097	16,88		
MASTR Specialized Loan Trust 0,498 % fällig am 25.05.2037 0,518 % fällig am 25.01.2037	111 1.307	103 740	0,00 0,02	Residential Asset Mortgage Products Trust 0,308 % fällig am 25.02.2037 0,518 % fällig am 25.05.2037 0,708 % fällig am 25.06.2037 1,078 % fällig am 25.05.2035	172 4.052 3 702	172 3.713 3 703	0,01 0,12 0,00 0,02	STAAITSEMISSIONEN Angolan Government International Bond 0,125 % fällig am 09.07.2030 0,125 % fällig am 09.07.2035	1.238 812	496 292	0,02 0,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 0,388 % fällig am 25.08.2037 0,408 % fällig am 25.03.2037	13.799 3.523	9.136 3.236	0,29 0,10	Residential Asset Mortgage Products Trust 0,308 % fällig am 25.02.2037 0,518 % fällig am 25.05.2037 0,708 % fällig am 25.06.2037 1,078 % fällig am 25.05.2035	172 4.052 3 702	172 3.713 3 703	0,01 0,12 0,00 0,02	Argentina Government International Bond 0,125 % fällig am 09.07.2030 0,125 % fällig am 09.07.2035 1,000 % fällig am 09.07.2029	2.637 9.377 483	1.079 3.455 212	0,03 0,11 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
15,500 % fällig am 17.10.2026 ARS	17.300	\$ 41	0,00	Saudi Government International Bond				U.S. TREASURY BILLS			
34,109 % fällig am 04.10.2022	3.300	21	0,00	2,375 % fällig am 26.10.2021	550	559	0,02	0,081 % fällig am			
36,174 % fällig am 03.04.2022	20.060	134	0,00	3,625 % fällig am 04.03.2028	4.000	4.490	0,14	28.01.2021 (d)(e)(k)	\$ 2.300	2.300	0,07
Argentina Treasury Bond				South Africa Government International Bond				Summe kurzfristige Instrumente		10.731	0,33
1,000 % fällig am 05.08.2021	42.742	305	0,01	4,850 % fällig am 30.09.2029	10.100	\$ 10.751	0,33				
2,500 % fällig am 22.07.2021	130.687	945	0,03	10,500 % fällig am 21.12.2026 ZAR	894.100	72.220	2,25	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 3.984.661	124,33	
Autonomous City of Buenos Aires Argentina				Turkey Government International Bond							
37,981 % fällig am 23.01.2022	29.780	198	0,01	5,750 % fällig am 22.03.2024	1.800	1.900	0,06				
China Development Bank				6,350 % fällig am 10.08.2024	9.400	10.110	0,31				
3,230 % fällig am 10.01.2025 CNY	258.200	39.598	1,24	7,250 % fällig am 23.12.2023	4.000	4.382	0,14				
3,340 % fällig am 14.07.2025	230.200	35.395	1,10								
Israel Government International Bond											
2,750 % fällig am 03.07.2030	4.000	4.418	0,14								
3,800 % fällig am 13.05.2060	8.600	10.239	0,32								
Kuwait International Government Bond											
2,750 % fällig am 20.03.2022	1.550	1.596	0,05								
3,500 % fällig am 20.03.2027	8.600	9.793	0,31								
Peru Government International Bond											
5,940 % fällig am 12.02.2029 PEN	16.300	5.624	0,18								
6,150 % fällig am 12.08.2032	53.300	18.092	0,56								
6,350 % fällig am 12.08.2028	41.300	14.513	0,45								
8,200 % fällig am 12.08.2026	11.900	4.468	0,14								
Provincia de Buenos Aires											
34,187 % fällig am 31.05.2022 ARS	17.888	109	0,00								
36,050 % fällig am 12.04.2025	315.510	1.583	0,05								
Qatar Government International Bond											
3,875 % fällig am 23.04.2023	4.900	5.272	0,16								
4,500 % fällig am 23.04.2028	5.100	6.188	0,19								
Republic of Greece Government International Bond											
3,500 % fällig am 30.01.2023	154	202	0,01								
3,750 % fällig am 30.01.2028	360	542	0,02								
3,900 % fällig am 30.01.2033	2.035	3.384	0,11								
4,000 % fällig am 30.01.2037	1.120	1.982	0,06								
4,200 % fällig am 30.01.2042	1.732	3.351	0,10								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$20.613	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (21.025)	\$ 20.613	\$ 20.613	0,64
NOM	0,100	31.12.2020	04.01.2021	29.200	U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.05.2048	(29.917)	29.200	29.200	0,91
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (50.942)	\$ 49.813	\$ 49.813	1,55

(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-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	857	\$ 847	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	139	(10)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	97	28	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	1.539	2.183	0,07
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 3.048	0,10

## 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<sup>(1)</sup>

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 8.300	\$ 154	0,01
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.03.2023	1.600	4	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	€ 7.000	107	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Bond Fund (Forts.)

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
DISH DBS Corp.	5,000 %	20.09.2021	\$ 2.500	\$ (225)	(0,01)
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2021	8.800	(91)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2022	7.200	(29)	0,00
				\$ (80)	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	\$ 95	\$ (6)	0,00
CDX.HY-34 5-Year Index	(5,000)	20.06.2025	2.392	(107)	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000)	20.12.2025	203.500	(10.703)	(0,34)
iTraxx Europe Senior 27 5-Year Index	(1,000)	20.06.2022	€ 21.300	179	0,01
				\$ (10.637)	(0,33)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-33 5-Year Index	5,000 %	20.12.2024	\$ 1.958	\$ 40	0,00
CDX.IG-33 5-Year Index	1,000	20.12.2024	8.000	33	0,00
CDX.IG-34 5-Year Index	1,000	20.06.2025	2.500	22	0,00
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	7.000	16	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 3.900	22	0,00
				\$ 133	0,00

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,840 %	03.01.2022	BRL 69.920	\$ (2)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,850	03.01.2022	250.000	(5)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,865	03.01.2022	86.180	(7)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	76.500	(6)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,871	03.01.2022	67.600	(5)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,880	03.01.2022	13.700	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,330	03.01.2022	693.500	892	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	1.448.100	2.208	0,07
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 9.200	165	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	13.600	233	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,270	03.03.2022	10.200	96	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025	8.300	165	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	5.000	100	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,290	03.03.2025	2.500	51	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,400	29.12.2050	\$ 29.700	147	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	03.02.2050	13.000	(733)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.12.2026	45.090	(2.379)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.01.2030	24.500	(1.851)	(0,06)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,875	07.02.2050	7.600	(939)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.12.2029	51.100	(4.712)	(0,15)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.02.2030	14.200	(1.308)	(0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.03.2030	7.100	(765)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	191.270	(33.178)	(1,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	11.12.2049	2.600	(552)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	12.03.2050	6.000	(1.307)	(0,04)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	£ 239.400	(33)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,015	17.09.2029	¥ 671.000	(16)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,068	25.09.2029	1.628.000	(116)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,085	27.09.2029	1.324.000	(114)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.03.2026	6.050.000	106	0,00
Zahlung	UKRPI	3,579	15.10.2033	£ 19.400	2.626	0,08
Zahlung	UKRPI	3,596	15.05.2034	6.900	811	0,02
					\$ (40.429)	(1,26)
					\$ (51.013)	(1,59)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,306 %	29.10.2021	850	\$ 62	\$ 40	(0,01)
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,306	29.10.2021	850	62	71	0,00
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,370	25.10.2021	3.200	229	172	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,370	25.10.2021	3.200	229	234	0,01
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,365	22.10.2021	4.000	286	212	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,365	22.10.2021	4.000	286	295	0,01
							\$ 1.154	\$ 1.024	0,03

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000 %	20.01.2021	20.400	\$ (57)	\$ (4)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	11.600	(27)	(1)	0,00
FBF	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	6.100	(9)	(5)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	6.600	(4)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	4.900	(4)	0	0,00
						\$ (101)	\$ (10)	0,00

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,013 %	25.01.2021	30.000	\$ (181)	\$ (253)	(0,01)
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,016	25.01.2021	30.000	(182)	(106)	0,00
							\$ (363)	\$ (359)	(0,01)

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 101,563	07.01.2021	3.800	\$ (13)	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	101,672	07.01.2021	6.400	(22)	0	0,00
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,906	11.03.2021	5.500	(19)	(38)	(0,01)
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2050	103,367	14.01.2021	7.900	(35)	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2051	103,594	14.01.2021	9.200	(36)	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	8.700	(14)	(8)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	3.200	(6)	(15)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	3.600	(9)	(9)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	99,688	04.02.2021	6.600	(39)	(33)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,188	04.02.2021	7.800	(20)	(18)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,266	04.02.2021	8.700	(21)	(20)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	9.100	(28)	(9)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,406	04.02.2021	9.100	(28)	(36)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,703	04.02.2021	5.200	(13)	(22)	0,00
					\$ (303)	\$ (210)	(0,01)

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

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.06.2021	\$ 400	\$ (13)	\$ 15	\$ 2	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	600	(19)	22	3	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2021	100	(4)	5	1	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	2.600	(84)	95	11	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
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(3)	8	5	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.000	4	11	15	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	400	(6)	4	(2)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	2.000	(61)	70	9	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2023	2.700	(11)	54	43	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
HUS	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	\$ 1.600	\$ (24)	\$ 51	\$ 27	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	15.500	(686)	404	(282)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(36)	19	(17)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(6)	7	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.700	(50)	49	(1)	0,00
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	300	(10)	11	1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	400	(13)	15	2	0,00
MYC	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(12)	10	(2)	0,00
	California State General Obligation Bonds, Series 2003	1,000	20.09.2024	2.900	23	41	64	0,01
					\$ (1.019)	\$ 899	\$ (120)	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 800	\$ (24)	\$ 34	\$ 10	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	11.000	(379)	521	142	0,01
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	10.900	(378)	520	142	0,00
					\$ (781)	\$ 1.075	\$ 294	0,01

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	01.2021	¥ 172.517	\$ 1.659	\$ 0	\$ (12)	\$ (12)	0,00
	01.2021	MXN 101.259	5.074	1	0	1	0,00
	01.2021	\$ 484	MXN 10.193	27	0	27	0,00
	01.2021	23	PLN 90	1	0	1	0,00
	01.2021	4.996	ZAR 76.381	191	0	191	0,01
	01.2021	ZAR 89.525	\$ 5.706	0	(373)	(373)	(0,01)
	02.2021	PEN 18.680	5.188	23	0	23	0,00
	02.2021	\$ 8.179	RUB 611.871	62	0	62	0,00
	03.2021	HKD 7.300	\$ 942	0	0	0	0,00
	03.2021	\$ 11.926	COP 43.153.436	676	0	676	0,02
BPS	03.2021	5.040	MXN 101.259	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	€ 4.726	\$ 5.750	0	(33)	(33)	0,00
	01.2021	\$ 1.077	AUD 1.464	53	0	53	0,00
	01.2021	1.670	£ 1.237	21	0	21	0,00
	01.2021	6.523	MXN 129.352	0	(43)	(43)	0,00
	01.2021	8	PLN 30	0	0	0	0,00
	02.2021	DKK 4.255	\$ 685	0	(15)	(15)	0,00
	03.2021	\$ 1.190	INR 89.266	23	0	23	0,00
	01.2021	¥ 16.819	\$ 161	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	ZAR 361.601	23.077	0	(1.479)	(1.479)	(0,04)
CBK	03.2021	MXN 101.259	4.957	0	(79)	(79)	0,00
	05.2021	\$ 213	COP 780.676	14	0	14	0,00
	01.2021	BRL 4.740	\$ 912	0	0	0	0,00
DUB	01.2021	PEN 39.135	10.861	41	0	41	0,00
	01.2021	\$ 1.081	BRL 4.740	0	(169)	(169)	(0,01)
	01.2021	BRL 164.101	\$ 32.288	695	0	695	0,02
GLM	01.2021	\$ 16.235	BRL 82.051	0	(438)	(438)	(0,01)
	01.2021	3.418	¥ 353.760	9	0	9	0,00
	02.2021	¥ 353.760	\$ 3.419	0	(9)	(9)	0,00
	02.2021	\$ 16.135	BRL 82.051	0	(343)	(343)	(0,01)
	02.2021	1.869	RUB 142.475	50	0	50	0,00
	03.2021	CNH 492.859	\$ 74.647	0	(855)	(855)	(0,03)
	01.2021	BRL 4.740	731	0	(182)	(182)	(0,01)
HUS	01.2021	€ 1.472	1.792	0	(10)	(10)	0,00
	01.2021	£ 98.212	131.313	0	(2.942)	(2.942)	(0,09)
	01.2021	¥ 31.071	298	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 912	BRL 4.740	0	0	0	0,00
	01.2021	1.170	€ 964	9	0	9	0,00
	01.2021	1.066	£ 788	11	0	11	0,00
	01.2021	6.484	MXN 133.442	200	0	200	0,01
	01.2021	20	PLN 76	0	0	0	0,00
	01.2021	ZAR 480.046	\$ 30.496	0	(2.104)	(2.104)	(0,06)
	02.2021	\$ 1.269	RUB 94.891	9	0	9	0,00
MYI	03.2021	PEN 2.251	\$ 627	5	0	5	0,00
	01.2021	€ 166	204	1	0	1	0,00
	01.2021	£ 1.415	1.917	0	(17)	(17)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2021	\$ 421	AUD 546	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	1.410	£ 1.036	6	0	6	0,00
RBC	03.2021	TWD 5.215	\$ 186	0	(2)	(2)	0,00
SCX	01.2021	€ 274.374	€ 328.589	0	(7.122)	(7.122)	(0,22)
	01.2021	\$ 1.556	£ 1.152	19	0	19	0,00
	01.2021	3.195	ZAR 46.940	0	(7)	(7)	0,00
	02.2021	€ 274.374	\$ 335.936	0	(3)	(3)	0,00
	02.2021	ILS 486	141	0	(10)	(10)	0,00
SSB	01.2021	AUD 1.083	817	0	(19)	(19)	0,00
	03.2021	KRW 360.142	324	0	(8)	(8)	0,00
TOR	01.2021	CAD 13.946	10.765	0	(182)	(182)	(0,01)
	01.2021	¥ 133.354	1.278	0	(13)	(13)	0,00
	01.2021	\$ 10.947	CAD 13.946	0	0	0	0,00
	02.2021	CAD 13.946	\$ 10.948	0	0	0	0,00
UAG	02.2021	\$ 4.121	RUB 313.658	103	0	103	0,00
				\$ 2.250	\$ (16.477)	\$ (14.227)	(0,44)

## ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 8.764	AUD 11.868	\$ 395	\$ 0	\$ 395	0,01
BPS	01.2021	37	50	2	0	2	0,00
CBK	01.2021	53	70	1	0	1	0,00
FBF	01.2021	12	16	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	AUD 1.119	\$ 842	0	(21)	(21)	0,00
	01.2021	\$ 4.448	AUD 6.025	201	0	201	0,01
JPM	01.2021	2.360	3.208	115	0	115	0,01
MYI	01.2021	AUD 94	\$ 71	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 116	AUD 156	5	0	5	0,00
SCX	01.2021	AUD 78	\$ 58	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 2.126	AUD 2.884	99	0	99	0,00
UAG	01.2021	8.724	11.846	417	0	417	0,01
				\$ 1.235	\$ (25)	\$ 1.210	0,04

Zum 31. Dezember 2020 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 Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	\$ 2.423	CAD 3.144	\$ 45	\$ 0	\$ 45	0,00
BPS	01.2021	77	98	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	4.780	6.211	96	0	96	0,01
JPM	01.2021	905	1.176	18	0	18	0,00
SSB	01.2021	810	1.053	17	0	17	0,00
UAG	01.2021	4.782	6.212	93	0	93	0,00
				\$ 270	\$ 0	\$ 270	0,01

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 30.171	CHF 27.252	\$ 662	\$ 0	\$ 662	0,02
BRC	01.2021	128	114	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	CHF 21	24	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	\$ 30.476	CHF 27.602	752	0	752	0,02
SCX	01.2021	128	116	3	0	3	0,00
SSB	01.2021	30.896	27.839	600	0	600	0,02
UAG	01.2021	CHF 4	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 724	CHF 639	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 2.018	\$ (1)	\$ 2.017	0,06

Zum 31. Dezember 2020 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	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	€ 114	\$ 140	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BPS	01.2021	2.035	2.491	4	(2)	2	0,00
	01.2021	\$ 224.472	€ 187.317	4.728	(8)	4.720	0,14
CBK	01.2021	8.639	7.192	161	0	161	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
HUS	01.2021	€ 5.228	\$ 6.348	\$ 0	\$ (48)	\$ (48)	0,00
	01.2021	\$ 9.971	€ 8.279	161	(2)	159	0,00
JPM	01.2021	493	404	1	0	1	0,00
MYI	01.2021	€ 231	\$ 281	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2021	\$ 248.572	€ 207.557	5.384	0	5.384	0,17
	02.2021	383.697	313.378	0	(2)	(2)	0,00
TOR	01.2021	234.368	195.697	5.077	0	5.077	0,16
	02.2021	332.881	271.875	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 15.517	\$ (64)	\$ 15.453	0,48

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 4.358	£ 3.254	\$ 91	\$ 0	\$ 91	0,00
BRC	01.2021	2.060	1.534	36	0	36	0,00
CBK	01.2021	£ 669	\$ 911	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	\$ 444.078	£ 332.211	10.052	0	10.052	0,31
HUS	01.2021	£ 440	\$ 588	0	(15)	(15)	0,00
	01.2021	\$ 481.245	£ 359.886	10.715	0	10.715	0,34
MYI	01.2021	5.383	3.993	76	0	76	0,00
SCX	01.2021	2.879	2.166	82	0	82	0,00
SSB	01.2021	488.771	366.169	11.778	0	11.778	0,37
				\$ 32.830	\$ (19)	\$ 32.811	1,02

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 5.242	NOK 46.323	\$ 169	\$ 0	\$ 169	0,01
BRC	01.2021	5.109	44.866	131	0	131	0,00
CBK	01.2021	NOK 16	\$ 2	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	\$ 5.150	NOK 45.593	175	0	175	0,01
				\$ 475	\$ 0	\$ 475	0,02

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	SEK 127	\$ 15	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2021	\$ 0	SEK 3	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	23.261	196.230	635	0	635	0,02
CBK	01.2021	154	1.313	6	0	6	0,00
HUS	01.2021	23.242	197.729	836	0	836	0,03
MYI	01.2021	23.383	198.182	749	0	749	0,02
SCX	01.2021	SEK 1.475	\$ 176	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 466	SEK 3.947	15	0	15	0,00
SSB	01.2021	SEK 97	\$ 11	0	0	0	0,00
				\$ 2.241	\$ (4)	\$ 2.237	0,07

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 40.865 1,28

Summe Anlagen

\$ 4.337.742 135,35

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (1.132.882) (35,35)

Nettovermögen

\$ 3.204.860 100,00

## 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 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) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 205.977 als Sicherheiten verpfändet.
- (k) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 924 und Barmittel in Höhe von USD 2.100 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 423 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 57.156 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	3.048	(10.139)	(9)	(7.100)
<b>Summen</b>	<b>\$ 178.350</b>	<b>\$ 4.159.347</b>	<b>\$ 45</b>	<b>\$ 4.337.742</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 4.433.932	\$ 6.943	\$ 4.440.875
Investmentfonds	381.672	0	0	381.672
Pensionsgeschäfte	0	221.289	0	221.289
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(2.768)	59.298	0	56.530
<b>Summen</b>	<b>\$ 378.904</b>	<b>\$ 4.714.519</b>	<b>\$ 6.943</b>	<b>\$ 5.100.366</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
RCY	0,160 %	02.12.2020	02.02.2021	\$ (137.316)	\$ (137.334)	(4,28)
	0,180	10.11.2020	11.01.2021	(68.484)	(68.502)	(2,14)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (205.836)</b>	<b>(6,42)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 1.865	\$ (1.810)	\$ 55
BPS	4.933	(5.910)	(977)
BRC	813	(890)	(77)
CBK	9.193	(7.100)	2.093
DUB	(128)	180	52
FBF	(5)	0	(5)
GLM	(384)	311	(73)
GST	(212)	140	(72)
HUS	6.821	(5.250)	1.571
JPM	(18)	230	212
MYC	(153)	(659)	(812)
MYI	1.744	(1.670)	74
RBC	(2)	0	(2)
SAL	(58)	0	(58)
SCX	(1.547)	1.963	416
SSB	12.368	(10.380)	1.988
TOR	4.881	(6.130)	(1.249)
UAG	754	(570)	184

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere		
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	71,04	67,55
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,62	k. A.
Investmentfonds	9,68	9,82
Pensionsgeschäfte	1,55	5,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	(0,07)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,59)	0,28
Freiverkehrsfinanzderivate	1,28	1,24
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(6,42)	(0,12)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,45	0,84
Unternehmensanleihen und Wechsel	29,52	26,32
Wandelanleihen & Wechsel	0,55	k. A.
Kommunalanleihen und Wechsel	0,37	0,32
US-Regierungsbehörden	34,50	38,63
US-Schatzobligationen	23,64	21,50
Non-Agency-MBS	8,10	7,07
Forderungsbesicherte Wertpapiere	16,88	15,43
Staatsemissionen	8,67	3,90
Stammaktien	0,03	0,03
Vorzugswertpapiere	0,29	0,07
Kurzfristige Instrumente	0,33	0,10
Investmentfonds	9,68	9,82
Pensionsgeschäfte	1,55	5,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,10	(0,07)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,33)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,03
Zinsswaps	(1,26)	0,25
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswaptionen	0,03	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	k. A.
Zinsswaptionen	(0,01)	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,09)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,44)	(0,15)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,70	1,47
Sonstige Aktiva und Passiva	(35,35)	(31,17)
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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				<b>BANKEN UND FINANZEN</b>			
ABN AMRO Bank NV 0,000 % fällig am 03.12.2021	€ 5.200	€ 5.224	0,10	Nasdaq, Inc. 3,850 % fällig am 30.06.2026	\$ 100	€ 94	0,00	British Telecommunications PLC 0,625 % fällig am 10.03.2021	€ 9.900	€ 9.917	0,19
Akefius Residential Property AB 1,500 % fällig am 23.01.2022	400	407	0,01	Natwest Group PLC 2,000 % fällig am 04.03.2025 2,500 % fällig am 22.03.2023	€ 7.000 3.000	7.400 3.170	0,14 0,06	Contemporary Ruiding Development Ltd. 1,875 % fällig am 17.09.2025	\$ 4.800	3.966	0,08
Ally Financial, Inc. 4,125 % fällig am 13.02.2022 4,250 % fällig am 15.04.2021	\$ 100 100	85 83	0,00 0,00	NatWest Markets PLC 0,072 % fällig am 01.03.2021 0,359 % fällig am 27.09.2021	1.400 2.900	1.401 2.916	0,03 0,06	E.ON SE 0,375 % fällig am 23.08.2021	€ 900	902	0,02
Atrium European Real Estate Ltd. 3,625 % fällig am 17.10.2022	€ 3.500	3.596	0,07	Nykredit Realkredit A/S 0,044 % fällig am 02.06.2022	2.800	2.817	0,05	IE2 Holdco S.A.U. 2,375 % fällig am 27.11.2023	300	319	0,01
Banco Santander S.A. 1,375 % fällig am 09.02.2022	900	917	0,02	PKO Bank Hipoteczny S.A. 0,250 % fällig am 23.11.2021	800	805	0,02	Optus Finance Pty. Ltd. 1,000 % fällig am 20.06.2029	700	738	0,01
Bank of America Corp. 0,189 % fällig am 25.04.2024	4.500	4.532	0,09	QNB Finance Ltd. 1,214 % fällig am 02.05.2022	\$ 5.000	4.102	0,08	Sprint Communications, Inc. 6,000 % fällig am 15.11.2022	\$ 100	89	0,00
Barclays PLC 1,500 % fällig am 03.09.2023	7.000	7.306	0,14	RCI Banque S.A. 0,124 % fällig am 14.03.2022 0,144 % fällig am 12.04.2021 0,750 % fällig am 12.01.2022	€ 1.200 4.900 4.000	1.202 4.904 4.027	0,02 0,10 0,08			15.931	0,31
Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 1,400 % fällig am 06.07.2022	3.800	3.861	0,08	Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.01.2022	DKK 30.000	4.089	0,08	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		226.605	4,42
Cajamar Caja Rural SCC 0,875 % fällig am 18.06.2023	1.700	1.747	0,03	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,750 % fällig am 14.01.2025	€ 200	210	0,00	<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>			
Castellum AB 2,125 % fällig am 20.11.2023	2.600	2.750	0,05	Societe Generale S.A. 0,000 % fällig am 27.05.2022 (b)	5.000	5.024	0,10	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,125 % fällig am 15.07.2030	227.995	209.210	4,08
Commerzbank AG 0,125 % fällig am 09.01.2024	5.500	5.606	0,11	Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % (e)	1.051	1.396	0,03	1,375 % fällig am 15.02.2044	19.552	23.050	0,45
Cooperative Rabobank UA 6,625 % fällig am 29.06.2021 (e)(g)	400	412	0,01	UBS AG 4,750 % fällig am 12.02.2026 (g) 7,625 % fällig am 17.08.2022 (g)	\$ 4.400 250	4.428 226	0,09 0,00	2,125 % fällig am 15.02.2041	56.835	72.953	1,42
Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	\$ 200	185	0,00	UBS Group AG 0,159 % fällig am 20.09.2022	€ 800	803	0,02			305.213	5,95
Dexia Credit Local S.A. 0,250 % fällig am 01.06.2023	€ 8.100	8.247	0,16	Vesteda Finance BV 2,500 % fällig am 27.10.2022	100	104	0,00	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Digital Dutch Finco BV 0,125 % fällig am 15.10.2022	100	100	0,00	Volkswagen Bank GmbH 0,000 % fällig am 15.06.2021 0,168 % fällig am 08.12.2021 0,955 % fällig am 01.08.2022	500 900 400	501 903 407	0,01 0,02 0,01	Adjustable Rate Mortgage Trust 2,929 % fällig am 25.04.2035	49	40	0,00
Digital Euro Finco LLC 2,500 % fällig am 16.01.2026	900	1.004	0,02	Volkswagen Financial Services AG 0,287 % fällig am 15.02.2021 0,625 % fällig am 01.04.2022	700 1.000	701 1.009	0,01 0,02	American Home Mortgage Assets Trust 6,250 % fällig am 25.11.2046	89	68	0,00
DNB Boligkreditt A/S 0,375 % fällig am 14.11.2023	3.800	3.894	0,08	Volkswagen Leasing GmbH 0,000 % fällig am 06.07.2021 0,250 % fällig am 16.02.2021	2.100 4.000	2.103 4.003	0,04 0,08	BCAP LLC Trust 1,448 % fällig am 25.09.2047 4,861 % fällig am 26.03.2037	253 701	204 578	0,01 0,01
Euroclear Bank S.A. 0,000 % fällig am 08.03.2021	3.000	3.003	0,06	Apple, Inc. 0,555 % fällig am 11.05.2022	\$ 7.000	5.745	0,11	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,706 % fällig am 25.07.2036 ^	659	498	0,01
Fastighets AB Balder 1,125 % fällig am 14.03.2022	200	202	0,00	AstraZeneca PLC 0,250 % fällig am 12.05.2021	€ 1.100	1.101	0,02	Bear Stearns ALT-A Trust 1,873 % fällig am 25.07.2034 3,254 % fällig am 25.09.2047 ^	840 6.573	709 3.667	0,01 0,07
First Abu Dhabi Bank PJSC 1,180 % fällig am 16.04.2022	\$ 5.000	4.111	0,08	BAT Capital Corp. 0,000 % fällig am 16.08.2021	4.000	4.006	0,08	Canada Square Funding PLC 1,156 % fällig am 17.10.2051	€ 4.016	4.492	0,09
Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 14.05.2021 0,000 % fällig am 01.12.2021 0,000 % fällig am 07.12.2022	€ 200 100 800	199 99 774	0,00 0,00 0,01	BAT International Finance PLC 0,875 % fällig am 13.10.2023 1,000 % fällig am 23.05.2022 3,625 % fällig am 09.11.2021	2.200 5.100 2.600	2.249 5.169 2.685	0,04 0,10 0,05	Citigroup Mortgage Loan Trust 3,361 % fällig am 25.09.2037 ^	\$ 83	66	0,00
General Motors Financial Co., Inc. 0,009 % fällig am 26.03.2022 0,167 % fällig am 10.05.2021 1,080 % fällig am 09.04.2021	400 300 \$ 800	400 300 654	0,01 0,01 0,01	Bayer Capital Corp. BV 0,009 % fällig am 26.06.2022	5.000	5.019	0,10	Countrywide Alternative Loan Trust 0,308 % fällig am 25.02.2047 0,472 % fällig am 20.12.2035 0,748 % fällig am 25.08.2035 3,446 % fällig am 25.06.2037 ^ 6,000 % fällig am 25.01.2037 6,000 % fällig am 25.07.2037	87 142 919 1.055 336 129	65 108 714 784 221 76	0,00 0,00 0,01 0,02 0,01 0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 0,096 % fällig am 09.09.2022	€ 4.500	4.513	0,09	BMW Finance NV 0,250 % fällig am 14.01.2022 0,625 % fällig am 06.10.2023	800 900	805 920	0,02 0,02	Countrywide Asset-Backed Certificates 0,628 % fällig am 25.04.2036 ^	415	309	0,01
IMMOFINANZ AG 2,625 % fällig am 27.01.2023	1.700	1.758	0,03	Essity AB 0,500 % fällig am 26.05.2021	3.600	3.610	0,07	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0,728 % fällig am 25.04.2035 0,748 % fällig am 25.05.2035 3,105 % fällig am 25.11.2037 6,000 % fällig am 25.07.2036 6,500 % fällig am 25.12.2037	2.499 211 112 97 105	1.868 147 89 63 54	0,04 0,00 0,00 0,00 0,00
ING Bank NV 0,000 % fällig am 08.04.2021 0,750 % fällig am 22.02.2021	3.000 3.000	3.004 3.005	0,06 0,06	Imperial Brands Finance PLC 1,125 % fällig am 14.08.2023	2.700	2.771	0,05	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 4,874 % fällig am 25.01.2034 ^	806	665	0,01
Intesa Sanpaolo SpA 7,000 % fällig am 19.01.2021 (e)(g)	1.600	1.607	0,03	Medtronic Global Holdings S.C.A. 0,375 % fällig am 07.03.2023	300	304	0,01	Dilosk RBMS DAC 0,241 % fällig am 20.10.2057	€ 433	434	0,01
JPMorgan Chase & Co. 2,625 % fällig am 23.04.2021	2.500	2.524	0,05	Origin Energy Finance Ltd. 3,500 % fällig am 04.10.2021	1.500	1.541	0,03	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 0,342 % fällig am 19.10.2036	\$ 124	88	0,00
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,500 % fällig am 15.09.2027	10.000	10.701	0,21	ProSiebenSat.1 Media SE 2,625 % fällig am 15.04.2021	800	801	0,02	FWD Securitization Trust 2,240 % fällig am 25.01.2050	398	334	0,01
LeasePlan Corp. NV 0,125 % fällig am 13.09.2023 1,000 % fällig am 24.05.2021 1,000 % fällig am 02.05.2023	300 12.500 3.300	301 12.560 3.379	0,01 0,24 0,07	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875 % fällig am 15.01.2026	500	554	0,01	GreenPoint Mortgage Funding Trust 0,388 % fällig am 25.10.2045	1.480	1.180	0,02
Logicor Financing SARL 0,500 % fällig am 30.04.2021 1,500 % fällig am 14.11.2022	3.200 2.800	3.206 2.870	0,06 0,06	UCB S.A. 1,875 % fällig am 02.04.2022	200	204	0,00	GSMPS Mortgage Loan Trust 0,498 % fällig am 25.03.2035	2.795	2.083	0,04
Merlin Properties Socimi S.A. 2,375 % fällig am 23.05.2022	300	309	0,01					HarborView Mortgage Loan Trust 0,357 % fällig am 19.12.2036 2,609 % fällig am 19.10.2035	665 106	489 63	0,01 0,00
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 21.05.2021	5.000	5.010	0,10					Impac CMB Trust 0,788 % fällig am 25.03.2035	92	75	0,00
								IndyMac Mortgage Loan Trust 0,328 % fällig am 25.02.2037 ^	114	90	0,00
						37.484	0,73				

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Multi-Asset 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
0,728 % fällig am 25.01.2036	\$ 655	€ 432	0,01	0,398 % fällig am 25.02.2036	\$ 150	€ 115	0,00	Residential Asset Securities Corp. Trust			
3,233 % fällig am 25.08.2037	3.403	2.198	0,04	1,018 % fällig am 25.04.2034	833	680	0,01	0,488 % fällig am 25.05.2037	\$ 3.000	€ 2.381	0,05
3,624 % fällig am 25.06.2036	2.614	1.869	0,04	CVC Cordatus Loan Fund DAC				Saxon Asset Securities Trust			
Lehman XS Trust				0,650 % fällig am 21.07.2030	€ 5.000	4.977	0,10	0,438 % fällig am 25.09.2036	7.500	5.784	0,11
0,398 % fällig am 25.08.2037	3.720	2.832	0,06	CVC Cordatus Loan Fund Ltd.				SC Germany Auto UG			
Mortgage Equity Conversion Asset Trust				0,970 % fällig am 22.04.2030	1.500	1.500	0,03	0,000 % fällig am 13.12.2026	€ 93	93	0,00
0,590 % fällig am 25.05.2042	171	131	0,00	Dartry Park CLO DAC				Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
New Residential Mortgage Loan Trust				0,830 % fällig am 28.04.2029	491	491	0,01	0,793 % fällig am 25.10.2035	\$ 1.744	1.425	0,03
4,500 % fällig am 25.05.2058	700	621	0,01	Driver Espana Five				Silver Arrow S.A.			
Residential Accredited Loans, Inc. Trust				0,000 % fällig am 21.12.2028	458	459	0,01	0,000 % fällig am 16.03.2026	€ 608	609	0,01
1,641 % fällig am 25.10.2037	494	379	0,01	Driver Espana Four				0,146 % fällig am 15.09.2027	1.074	1.063	0,02
6,500 % fällig am 25.07.2036	141	114	0,00	0,000 % fällig am 21.04.2028	142	142	0,00	Soundview Home Loan Trust			
Shamrock Residential DAC				Driver Multi-Compartment S.A.				0,298 % fällig am 25.03.2037	\$ 94	74	0,00
0,276 % fällig am 24.11.2057	€ 431	432	0,01	0,000 % fällig am 21.08.2026	1.264	1.270	0,03	0,318 % fällig am 25.07.2037	1.073	774	0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC				Dryden Euro CLO BV				0,318 % fällig am 25.08.2037	1.133	849	0,02
0,956 % fällig am 20.07.2045	£ 4.539	5.072	0,10	0,880 % fällig am 15.01.2030	2.600	2.601	0,05	0,398 % fällig am 25.10.2036	200	157	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Dryden Senior Loan Fund				1,048 % fällig am 25.10.2037	2.577	1.840	0,04
0,548 % fällig am 25.06.2044	\$ 504	402	0,01	1,137 % fällig am 15.10.2027	\$ 757	617	0,01	St Paul's CLO DAC			
2,003 % fällig am 25.08.2046	10.663	8.339	0,16	Ellington Loan Acquisition Trust				0,850 % fällig am 20.08.2030	€ 4.995	5.002	0,10
3,451 % fällig am 25.02.2037	^ 67	54	0,00	1,248 % fällig am 25.05.2037	133	109	0,00	Tikehau CLO BV			
		43.196	0,84	Elm Park CLO DAC				0,600 % fällig am 04.08.2028	339	339	0,01
				0,620 % fällig am 16.04.2029	€ 1.052	1.053	0,02	0,880 % fällig am 07.12.2029	1.500	1.499	0,03
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>								<b>STAAEMISSIOMEN</b>			
Accredited Mortgage Loan Trust				Euro-Galaxy CLO BV				Cyprus Government International Bond			
0,728 % fällig am 25.09.2035	2.800	2.189	0,04	0,750 % fällig am 17.01.2031	400	400	0,01	3,750 % fällig am 26.07.2023	€ 1.400	1.545	0,03
Accunia European CLO BV				0,820 % fällig am 10.11.2030	600	600	0,01	3,875 % fällig am 06.05.2022	7.300	7.719	0,15
0,950 % fällig am 15.07.2030	€ 1.400	1.401	0,03	FACT Titrisocram				France Government International Bond			
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				0,000 % fällig am 25.07.2036	196	196	0,00	0,000 % fällig am 25.02.2021 (b)	2.000	2.002	0,04
0,298 % fällig am 25.04.2036	\$ 480	385	0,01	First Franklin Mortgage Loan Trust				0,000 % fällig am 15.10.2030	5.000	4.999	0,10
0,298 % fällig am 25.07.2036	254	101	0,00	0,853 % fällig am 25.11.2036	\$ 10.000	7.632	0,15	Tymon Park CLO Ltd.			
Adagio CLO Ltd.				Fremont Home Loan Trust				0,590 % fällig am 21.01.2029	168	168	0,00
0,660 % fällig am 15.10.2029	€ 247	247	0,01	0,288 % fällig am 25.01.2037	485	261	0,01	VCL Multi-Compartment S.A.			
ALME Loan Funding DAC				Grosvenor Place CLO BV				0,000 % fällig am 21.08.2024	1.013	1.015	0,02
0,750 % fällig am 15.01.2031	600	597	0,01	0,720 % fällig am 30.10.2029	€ 485	484	0,01	0,000 % fällig am 21.01.2025	285	286	0,01
Arbour CLO DAC				GSAH Home Equity Trust				Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
0,870 % fällig am 15.01.2030	1.600	1.601	0,03	0,248 % fällig am 25.12.2046	\$ 1.374	715	0,01	1,198 % fällig am 25.10.2034	\$ 160	130	0,00
Asset-Backed European Securitisation Transaction				5,985 % fällig am 25.06.2036	1.317	441	0,01				
0,000 % fällig am 21.12.2028	1.137	1.138	0,02	Harvest CLO DAC						122.004	2,38
Aurium CLO DAC				0,630 % fällig am 18.11.2029	€ 439	438	0,01	<b>STAMMAKTIE</b>			
0,670 % fällig am 16.04.2030	600	598	0,01	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
0,680 % fällig am 13.10.2029	566	566	0,01	0,358 % fällig am 25.10.2036	\$ 270	216	0,00	Alphabet, Inc. 'C' (a)	22.300	31.929	0,62
Babson Euro CLO BV				0,448 % fällig am 25.03.2037	16.300	12.495	0,24	Billibili, Inc. ADR (a)	284.900	19.960	0,39
0,309 % fällig am 25.10.2029	365	363	0,01	Jubilee CLO BV				Electronic Arts, Inc.	162.920	19.121	0,37
0,309 % fällig am 25.10.2029	365	363	0,01	0,257 % fällig am 15.12.2029	€ 700	697	0,01	Momo, Inc. ADR	905.783	10.334	0,20
Barings Euro CLO BV				0,334 % fällig am 12.07.2028	589	585	0,01	NetEase, Inc.	1.337.400	20.876	0,41
0,680 % fällig am 27.07.2030	569	569	0,01	Man GLG Euro CLO DAC				Nexon Co. Ltd.	796.000	20.075	0,39
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				0,870 % fällig am 15.01.2030	1.000	997	0,02	Nintendo Co. Ltd.	45.300	23.769	0,46
1,198 % fällig am 25.08.2037	\$ 230	172	0,00	Marlay Park CLO DAC				Take-Two Interactive Software, Inc. (a)	74.400	12.635	0,25
Black Diamond CLO Designated Activity Co.				0,740 % fällig am 15.10.2030	1.000	995	0,02	Tencent Holdings Ltd.	352.600	20.732	0,41
0,650 % fällig am 03.10.2029	€ 625	624	0,01	MASTR Asset-Backed Securities Trust						179.431	3,50
BlueMountain Fuji Eur CLO DAC				0,928 % fällig am 25.02.2034	\$ 1.721	1.375	0,03	<b>LUXUSGÜTER</b>			
0,910 % fällig am 15.01.2033	1.000	999	0,02	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				Alibaba Group Holding Ltd. (a)	689.450	16.386	0,32
BNPP AM Euro CLO BV				0,398 % fällig am 25.07.2036	192	141	0,00	ANTA Sports Products Ltd.	1.494.750	19.381	0,38
0,650 % fällig am 15.10.2031	250	249	0,01	0,448 % fällig am 25.07.2036	304	134	0,00	Aptiv PLC	240.200	25.578	0,50
Cairn CLO BV				Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				BYD Co. Ltd. 'H'	1.888.800	40.636	0,79
0,650 % fällig am 20.10.2028	337	337	0,01	0,348 % fällig am 25.09.2037	238	187	0,00	Garmin Ltd.	100.600	9.838	0,19
0,670 % fällig am 31.01.2030	700	699	0,01	OAK Hill European Credit Partners Designated Activity Co.				JD Health International, Inc. (a)	1.637.524	25.890	0,50
0,790 % fällig am 25.07.2029	4.850	4.848	0,09	0,720 % fällig am 21.02.2030	€ 2.000	1.996	0,04				
0,930 % fällig am 30.04.2031	100	100	0,00	Option One Mortgage Loan Trust							
Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC				0,288 % fällig am 25.03.2037	\$ 246	186	0,00				
0,680 % fällig am 16.09.2025	£ 2.892	3.234	0,06	0,368 % fällig am 25.04.2037	630	409	0,01				
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				0,368 % fällig am 25.05.2037	457	274	0,01				
0,870 % fällig am 18.01.2030	€ 2.500	2.498	0,05	0,928 % fällig am 25.11.2034	406	331	0,01				
Carrington Mortgage Loan Trust				Orwell Park CLO Designated Activity Co.							
0,548 % fällig am 25.01.2036	\$ 13.500	10.644	0,21	0,780 % fällig am 18.07.2029	€ 228	228	0,00				
CIT Mortgage Loan Trust				OZLME BV							
1,648 % fällig am 25.10.2037	400	326	0,01	0,820 % fällig am 18.01.2030	800	800	0,02				
Citigroup Mortgage Loan Trust				Penta CLO BV							
4,298 % fällig am 25.10.2037	1.100	903	0,02	0,790 % fällig am 04.08.2028	779	779	0,02				
6,750 % fällig am 25.05.2036	141	82	0,00	Pepper Iberia Unsecured DAC							
Contego CLO BV				0,000 % fällig am 07.04.2028	500	501	0,01				
0,397 % fällig am 15.11.2026	€ 196	194	0,00	Renaissance Home Equity Loan Trust							
0,770 % fällig am 15.10.2030	1.000	1.001	0,02	5,285 % fällig am 25.01.2037	\$ 229	93	0,00				
Countrywide Asset-Backed Certificates				5,545 % fällig am 25.01.2037	336	144	0,00				
0,288 % fällig am 25.08.2037	\$ 7.287	5.879	0,12								
0,338 % fällig am 25.11.2037	567	460	0,01								
0,368 % fällig am 25.09.2037	^ 105	82	0,00								

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS		BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS		BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
			GENS	GENS				GENS	GENS					
JD.com, Inc. 'A' (a)	379.100 €	13.643	0,27		FANUC Corp.	78.900 €	15.920	0,31		NXP Semiconductors NV	156.100 €	20.286	0,39	
Meituan Dianping 'B' (a)	303.700	9.342	0,18		Generac Holdings, Inc. (a)	54.300	10.092	0,20		Otsuka Corp.	125.000	5.389	0,10	
New Oriental Education & Technology Group, Inc. (a)	53.100	7.791	0,15		Makita Corp.	299.000	12.258	0,24		Power Integrations, Inc.	215.900	14.445	0,28	
NIO, Inc. ADR (a)	835.900	33.298	0,85		Mitsubishi Electric Corp.	1.056.470	13.051	0,25		Realtek Semiconductor Corp.	817.000	9.302	0,18	
Panasonic Corp.	2.630.500	25.064	0,49		NEL ASA (a)	4.155.700	11.509	0,22		Rohm Co. Ltd.	180.300	14.286	0,28	
Pinduoduo, Inc. ADR (a)	206.300	29.956	0,58		PowerCell Sweden AB (a)	313.263	10.234	0,20		Samsung Electronics Co. Ltd.	892.200	54.454	1,06	
Shimano, Inc.	45.800	8.763	0,17		Rockwell Automation, Inc.	76.000	15.579	0,30		Skyworks Solutions, Inc.	189.300	23.653	0,46	
Sony Corp.	191.270	15.754	0,31		Schneider Electric SE	225.800	26.713	0,52		SMA Solar Technology AG (a)	250.223	14.000	0,27	
Subaru Corp.	510.720	8.353	0,16		Secom Co. Ltd.	57.460	4.333	0,08		SolarEdge Technologies, Inc. (a)	202.100	52.711	1,03	
Suzuki Motor Corp.	75.910	2.876	0,06		SMC Corp.	20.600	10.284	0,20		Synopsys, Inc. (a)	25.600	5.424	0,11	
TAL Education Group ADR (a)	93.900	5.488	0,11		Sunrun, Inc. (a)	152.200	8.630	0,17		Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	2.987.000	46.182	0,90	
Tesla, Inc. (a)	68.900	39.737	0,77		Valmet Oyj	949.400	22.343	0,44		Teradyne, Inc.	92.300	9.044	0,18	
Trip.com Group Ltd. ADR (a)	253.300	6.983	0,14		Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd. 'H'	13.734.700	22.616	0,44		Tokyo Electron Ltd.	101.170	30.891	0,60	
		344.757	6,72				208.299	4,06		Trimble, Inc. (a)	277.700	15.154	0,30	
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>					<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>					United Microelectronics Corp.	3.157.000	4.339	0,08	
3SBio, Inc. (a)	6.913.000	5.157	0,10		Advantech Co. Ltd.	1.361.183	13.888	0,27		Win Semiconductors Corp.	464.000	4.681	0,09	
Alibaba Health Information Technology Ltd. (a)	14.719.900	35.604	0,69		Advantest Corp.	347.600	21.281	0,41		Xinyi Solar Holdings Ltd.	23.707.973	50.800	0,99	
Anthem, Inc.	91.930	24.125	0,47		ANSYS, Inc. (a)	17.100	5.084	0,10		Zebra Technologies Corp. 'A' (a)	57.000	17.904	0,35	
BeiGene Ltd. (a)	624.500	10.339	0,20		Apple, Inc.	150.280	16.297	0,32				1.022.665	19,94	
Biogen, Inc. (a)	30.100	6.024	0,12		Applied Materials, Inc.	208.500	14.706	0,29		<b>BAUSTOFFE</b>				
China Biologic Products Holdings, Inc. (a)	22.500	2.172	0,04		Arista Networks, Inc. (a)	110.300	26.194	0,51		Barrick Gold Corp.	891.400	16.596	0,32	
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	6.603.488	5.494	0,11		Automatic Data Processing, Inc.	109.700	15.798	0,31		Holmen AB 'B'	539.400	21.180	0,41	
Genscript Biotech Corp.	8.526.500	10.137	0,20		Baidu, Inc. SP - ADR (a)	240.200	42.451	0,83		LG Chem Ltd.	38.600	23.989	0,47	
Gilead Sciences, Inc.	167.540	7.978	0,15		Cadence Design Systems, Inc. (a)	77.100	8.597	0,17		Mondi PLC	1.520.600	29.109	0,57	
Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd. 'H' (a)	744.400	14.107	0,27		Chipbond Technology Corp.	2.300.000	4.450	0,09		Newmont Goldcorp Corp.	390.200	19.099	0,37	
Humana, Inc.	96.770	32.448	0,63		Cirrus Logic, Inc. (a)	122.200	8.210	0,16		Nitto Denko Corp.	193.100	14.139	0,28	
Illumina, Inc. (a)	30.100	9.102	0,18		Cisco Systems, Inc.	672.810	24.607	0,48		Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	165.960	23.809	0,47	
Incyte Corp. (a)	119.900	8.523	0,17		Cognex Corp.	198.500	13.025	0,25		Stora Enso Oyj 'R'	3.242.700	50.825	0,99	
Innovent Biologics, Inc. (a)	1.167.900	10.078	0,20		Cognizant Technology Solutions Corp. 'A'	76.190	5.103	0,10		UPM-Kymmene Oyj	1.593.800	48.652	0,95	
Intuitive Surgical, Inc. (a)	19.100	12.771	0,25		Daqo New Energy Corp. ADR (a)	402.500	18.869	0,37				247.398	4,83	
Legend Biotech Corp. ADR (a)	1.214	28	0,00		Delta Electronics, Inc.	2.582.500	19.794	0,39		<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				
Luye Pharma Group Ltd.	22.983.400	8.736	0,17		Elan Microelectronics Corp.	1.169.000	4.550	0,09		Xinyi Energy Holdings Ltd.	34.520.700	19.158	0,37	
Otsuka Holdings Co. Ltd.	178.100	6.237	0,12		Enphase Energy, Inc. (a)	83.550	11.982	0,23				2.343.898	45,70	
Ping An Healthcare and Technology Co. Ltd. (a)	1.367.900	13.576	0,26		First Solar, Inc. (a)	410.200	33.163	0,65						
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (a)	45.600	18.005	0,35		Flat Glass Group Co. Ltd. 'H'	3.949.200	13.613	0,26						
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd. 'H'	2.198.300	4.064	0,08		Fujitsu Ltd.	89.000	10.514	0,20		<b>PARI (000S)</b>				
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co. Ltd. 'H'	1.784.700	6.971	0,14		Globalwafers Co. Ltd.	485.800	10.030	0,20		<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				
Shionogi & Co. Ltd.	362.350	16.192	0,32		Hexagon AB 'B'	86.300	6.478	0,13		<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				
Sino Biopharmaceutical Ltd.	3.930.900	3.098	0,06		Infineon Technologies AG	682.300	21.329	0,42		Treasury Bills des europäischen Stabilitätsmechanismus (0,613) % fällig am 18.03.2021 (b) €	36.570	36.614	0,71	
Varian Medical Systems, Inc. (a)	58.800	8.410	0,16		Intel Corp.	173.300	7.056	0,14		<b>FRANCE TREASURY BILLS</b>				
Vertex Pharmaceuticals, Inc. (a)	86.600	16.728	0,33		IPG Photonics Corp. (a)	29.100	5.322	0,10		(0,757) % fällig am 27.01.2021 (b)(c)	25.000	25.015	0,49	
WuXi AppTec Co. Ltd. 'H'	786.540	12.608	0,25		JinkoSolar Holding Co. Ltd. ADR (a)	728.312	36.828	0,72		(0,680) % fällig am 10.03.2021 (b)(c)	38.000	38.050	0,74	
Wuxi Biologics Cayman, Inc. (a)	1.243.800	13.478	0,26		Keyence Corp.	38.100	17.518	0,34		(0,673) % fällig am 10.03.2021 (b)(c)	9.100	9.112	0,18	
		322.190	6,28		Kyocera Corp.	231.400	11.609	0,23		(0,671) % fällig am 10.03.2021 (b)(c)	49.000	49.065	0,96	
<b>INDUSTRIEWERTE</b>					Lam Research Corp.	90.270	34.843	0,68		(0,669) % fällig am 10.03.2021 (b)(c)	29.400	29.439	0,57	
51job, Inc. ADR (a)	34.416	1.969	0,04		Lotes Co. Ltd.	346.000	4.792	0,09		(0,656) % fällig am 08.04.2021 (b)(c)	9.200	9.217	0,18	
Daifuku Co. Ltd.	69.100	6.989	0,14		Marvell Technology Group Ltd.	417.600	16.226	0,32		(0,652) % fällig am 08.04.2021 (b)(c)	3.900	3.907	0,07	
Eaton Corp. PLC	160.700	15.779	0,31		Maxim Integrated Products, Inc.	295.700	21.424	0,42		(0,652) % fällig am 08.04.2021 (b)(c)	4.500	4.508	0,09	
					MediaTek, Inc.	224.000	4.882	0,09						
					Microsoft Corp.	71.885	13.067	0,25						
					Nanya Technology Corp.	3.575.000	9.059	0,18						
					NetApp, Inc.	459.600	24.882	0,48						
					Novatek Microelectronics Corp.	515.000	5.538	0,11						
					Nuance Communications, Inc. (a)	327.700	11.809	0,23						
					NVIDIA Corp.	81.660	34.852	0,68						

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Multi-Asset 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	
(0,634) % fällig am 08.04.2021 (b)(c) €	27.000	27.049	0,53	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>				
(0,629) % fällig am 10.02.2021 (b)(c)	38.850	38.882	0,76	(0,129) % fällig am 06.01.2021 (b)(c) ¥	4.340.000	34.356	0,67	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				
(0,624) % fällig am 10.02.2021 (b)(c)	15.010	15.022	0,29	(0,129) % fällig am 12.01.2021 (b)(c)	4.340.000	34.356	0,67	PIMCO Funds: Global Investors				
(0,508) % fällig am 10.02.2021 (b)(c)	61.070	61.120	1,19	(0,105) % fällig am 01.02.2021 (b)(c)	3.300.000	26.125	0,51	Series plc - Income Fund (f)	1.375.302	€	19.547	0,38
(0,441) % fällig am 24.03.2021 (b)(c)	290	290	0,01	(0,105) % fällig am 08.02.2021 (b)(c)	3.300.000	26.126	0,51	PIMCO Funds: Global Investors				
(0,437) % fällig am 24.03.2021 (b)(c)	5.670	5.679	0,11	(0,100) % fällig am 15.02.2021 (b)(c)	3.470.000	27.472	0,53	Series plc - PIMCO Capital				
(0,422) % fällig am 24.03.2021 (b)(c)	35.760	35.817	0,70	(0,095) % fällig am 18.01.2021 (b)(c)	4.000.000	31.666	0,62	Securities Fund (f)	1.262.689		13.003	0,26
		352.172	6,87	(0,090) % fällig am 08.03.2021 (b)(c)	5.700.000	45.129	0,88				32.550	0,64
				(0,087) % fällig am 22.03.2021 (b)(c)	6.000.000	47.507	0,93					
				(0,086) % fällig am 15.03.2021 (b)(c)	6.000.000	47.506	0,93	<b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>				
<b>GERMANY TREASURY BILLS</b>						320.243	6,25	Invesco Physical Gold ETC	687.500	103.079	2,01	
(0,765) % fällig am 09.06.2021 (b)(c)	40.620	40.752	0,79	Summe kurzfristige Instrumente		973.210	18,98	Invesco Physical Gold ETC	1.302.900	195.737	3,82	
(0,760) % fällig am 14.04.2021 (b)(c)	41.380	41.467	0,81	Summe Übertragbare Wertpapiere	€	4.042.122	78,81	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro				
(0,756) % fällig am 14.04.2021 (b)(c)	8.990	9.009	0,18					Short Maturity UCITS				
(0,746) % fällig am 14.04.2021 (b)(c)	12.840	12.867	0,25					ETF (f)	3.415.400	340.638	6,64	
(0,740) % fällig am 09.06.2021 (b)(c)	25.280	25.362	0,49					PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro				
(0,736) % fällig am 14.04.2021 (b)(c)	2.950	2.956	0,06					Short-Term High Yield				
(0,735) % fällig am 09.06.2021 (b)(c)	12.750	12.791	0,25					Corporate Bond Index UCITS				
(0,730) % fällig am 14.04.2021 (b)(c)	11.770	11.795	0,23					ETF (f)	1.532.400	16.131	0,31	
(0,726) % fällig am 14.04.2021 (b)(c)	37.910	37.990	0,74							655.585	12,78	
(0,669) % fällig am 03.03.2021								Summe Investmentfonds	€	688.135	13,42	
(b)(c)(h)	60.500	60.578	1,18									
(0,639) % fällig am 03.03.2021												
(b)(c)(h)	4.170	4.175	0,08									
(0,615) % fällig am 14.04.2021 (b)(c)	4.430	4.439	0,09									
		264.181	5,15									

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	(2,400) %	31.12.2020	04.01.2021	€ 178.900	Belgium Government International Bond 0,800 % fällig am 22.06.2028	€ (179.205)	€ 178.900	€ 178.852	3,49
	(2,200)	31.12.2020	04.01.2021	85.200	European Investment Bank 1,000 % fällig am 14.11.2042	(36.820)	85.200	85.179	1,66
FICC	0,000	31.12.2020	04.01.2021	\$ 8.931	Landwirtschaftliche Rentenbank 0,500 % fällig am 28.02.2029	(53.152)			
					U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	(7.445)	7.299	7.299	0,14
Summe Pensionsgeschäfte						€ (276.622)	€ 271.399	€ 271.330	5,29

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### 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
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	1.593	€ 304	0,01
E-mini S&P 500 Index March Futures	Short	03.2021	452	(1.656)	(0,03)
Euro STOXX 50 March Futures	Short	03.2021	10.240	(4.439)	(0,09)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	855	(19)	0,00
Nikkei 225 Yen-Denominated March Futures	Long	03.2021	841	2.362	0,04
				€ (3.448)	(0,07)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (3.448)	(0,07)

### 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 INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Rolls-Royce PLC	1,000 %	20.06.2024	€ 5.000	€ (303)	(0,01)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-34 5-Year Index	1,000 %	20.06.2025	\$ 40.600	€ 21	0,00
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	416.100	36	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 17.000	48	0,00
				€ 105	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220 %	03.03.2025	CAD 5.692	€ 83	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	10.835	153	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025	5.150	84	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	3.072	50	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,290	03.03.2025	1.536	26	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	102.600	1.618	0,03
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	150.600	126	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	181	1	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2029	123.500	1.993	0,04
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,200	19.06.2029	¥ 5.710.000	(229)	0,00
					€ 3.905	0,08
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>€ 3.707</b>	<b>0,07</b>

(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

## VERKAUFSOPTIEN

## CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.01.2021	12.300	€ (18)	€ (1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	6.000	(9)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	6.800	(9)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	9.000	(14)	(1)	0,00
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	6.600	(8)	(7)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	2.200	(14)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	15.000	(35)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	6.800	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	7.800	(8)	(5)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	3.900	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	7.100	(11)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	10.700	(17)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	10.700	(11)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	17.400	(19)	(19)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	23.000	(41)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	11.700	(13)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	11.000	(13)	(12)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	6.900	(9)	(8)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,950	20.01.2021	6.800	(9)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	6.200	(6)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	3.900	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	10.100	(14)	(1)	0,00
FBF	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	6.600	(7)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	17.02.2021	4.100	(9)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	16.400	(21)	(10)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	6.800	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	3.900	(4)	(2)	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	9.700	(15)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	10.500	(18)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	5.400	(9)	0	0,00
MYC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	15.400	(17)	(10)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	15.800	(16)	(9)	0,00
						€ (416)	€ (124)	0,00

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	China Government International Bond	(1,000) %	20.12.2023	\$ 17.130	€ (303)	€ (70)	€ (373)	(0,01)
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.12.2023	16.800	(309)	(56)	(365)	(0,01)
					€ (612)	€ (126)	€ (738)	(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) 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 Netto- vermögens
BPS	Erhalt	SXIE Index	149.173	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	€ 38.977	06.01.2021	€ 0	€ (16)	€ (16)	0,00
BRC	Erhalt	SXIE Index	283.631	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	74.110	21.07.2021	0	0	0	0,00
							€ 0	€ (16)	€ (16)	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	01.2021	€	478 CAD	740	€	(4)	0,00
	01.2021		881 ¥	111.900		4	0,00
	01.2021		12.093 NZD	20.679		75	0,00
	01.2021		6.885 \$	8.407		0	0,00
	01.2021	¥	483.273 €	3.875		49	0,00
	01.2021		11.410 NOK	1.086		0	0,00
	01.2021		109.985 PLN	\$ 28.439		(3)	(3)
	01.2021		36.835 SEK	€ 3.607		(885)	(0,02)
	01.2021	\$	29.195 CLP	21.739.267	1.142	(59)	(59)
	01.2021		72.430 €	59.568	386	0	0,00
	02.2021	ILS	149.139 \$	44.075		(10)	376
BPS	01.2021	€	62.293 NZD	106.064	119	(1.964)	(1.964)
	01.2021		1.623 \$	1.990	3	0	3
	01.2021	£	3.123 €	3.449	0	(40)	(40)
	01.2021		26.705 NOK	2.520	0	(29)	(29)
	01.2021		37.318 PLN	\$ 9.628	0	(318)	(318)
	01.2021	\$	42.126 CLP	33.133.880	3.678	0	3.678
	01.2021		278.396 €	232.231	4.700	0	4.700
	03.2021	HKD	1.568.977 \$	202.437	38	0	38
	03.2021	PEN	25.309	7.009	8	0	8
BRC	01.2021	BRL	615	116	0	(2)	(2)
	01.2021	€	2.261 CHF	2.448	3	0	3
	01.2021		1.834 ¥	232.600	7	0	7
	01.2021		10.536 \$	12.872	0	(17)	(17)
	01.2021	£	5.969 €	6.614	0	(54)	(54)
	01.2021	¥	12.197.127	97.743	1.193	0	1.193
	01.2021		27.820 NOK	2.631	0	(25)	(25)
	01.2021	\$	118	BRL 615	0	0	0
	01.2021		73.700 €	60.744	514	0	514
	03.2021	¥	11.700.000	92.475	0	(72)	(72)
CBK	01.2021	BRL	615	\$ 118	0	0	0
	01.2021	€	27.059 NOK	286.636	300	0	300
	01.2021		348.185 HUF	\$ 1.135	0	(32)	(32)
	01.2021		16.000 PEN	4.433	8	0	8
	01.2021		1.809 PLN	479	0	(5)	(5)
	01.2021	\$	122	BRL 615	0	(3)	(3)
	01.2021		30.894 CLP	23.428.006	1.695	0	1.695
	02.2021	BRL	615	\$ 121	3	0	3
	02.2021	PEN	201.512	56.216	403	0	403
	05.2021		15.859	4.351	0	(26)	(26)
GLM	01.2021	£	5.453 €	6.094	4	(1)	3
	01.2021		4.081.998 HUF	\$ 13.059	0	(582)	(582)
	01.2021		58.827 SEK	€ 5.787	0	(67)	(67)
	03.2021	HKD	207.923	\$ 26.827	5	0	5
	03.2021		2.521	HKD 19.543	0	0	0
HUS	01.2021	€	38.684 NOK	408.792	335	0	335
	01.2021		82	\$ 100	0	0	0
	01.2021		92.438 PLN	24.225	0	(479)	(479)
	01.2021	\$	2.776 €	2.291	23	0	23
	02.2021	PEN	61.774	\$ 17.236	126	0	126
	03.2021	HKD	1.306	169	0	0	0
	03.2021		1.220	CNY 8.094	14	0	14
	04.2021	PEN	78.205	\$ 21.644	21	0	21
IND	01.2021	€	148	180	0	(1)	(1)
	03.2021		10.971	HKD 85.038	0	(1)	(1)
JPM	01.2021	SEK	148.048	€ 14.607	0	(126)	(126)
	01.2021		171.019	\$ 140.936	1.204	(29)	1.175
	02.2021	DKK	955	128	0	0	0
MYI	01.2021	€	2.397	CHF 2.589	0	(3)	(3)
	01.2021		1	£ 1	0	0	0

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens						
	01.2021	€	23.424	NOK	250.415	€	477	€	477	0,01			
	01.2021		23.588	NZD	40.430		203		203	0,00			
	01.2021		43.693	\$	52.396		0	(873)	(873)	(0,02)			
	01.2021	£	750	€	828		0	(9)	(9)	0,00			
	01.2021	HUF	4.409.399	\$	14.146		0	(597)	(597)	(0,01)			
	01.2021	PLN	6.880		1.808		0	(32)	(32)	0,00			
	01.2021	\$	15.000	CLP	11.328.000		769	0	769	0,02			
	01.2021		73.103	€	60.147		425	(20)	405	0,01			
	03.2021	HKD	21.161	\$	2.730		0	0	0	0,00			
RBC	01.2021	¥	11.313.968	€	90.522		964	0	964	0,02			
	01.2021	\$	3.300		2.696		0	(1)	(1)	0,00			
	03.2021	HKD	34.104	\$	4.400		0	0	0	0,00			
	03.2021	TWD	89.979		3.203		0	(32)	(32)	0,00			
RYL	01.2021	€	2.673	¥	337.200		0	(4)	(4)	0,00			
	01.2021	¥	1.599.000	€	12.604		0	(54)	(54)	0,00			
	01.2021	SEK	57.970		5.641		0	(128)	(128)	0,00			
SCX	01.2021	HUF	11.301.083	\$	36.970		0	(945)	(945)	(0,02)			
	01.2021	¥	4.671.864	€	37.661		680	0	680	0,01			
	01.2021	NOK	35.600		3.347		0	(51)	(51)	0,00			
	01.2021	SEK	6.485		631		0	(14)	(14)	0,00			
	01.2021	\$	15.338	CLP	11.799.288		1.035	0	1.035	0,02			
	01.2021		1.859.926	€	1.553.034		32.926	0	32.926	0,65			
	02.2021	¥	6.600.000		53.107		880	0	880	0,02			
	02.2021	\$	2.168.019		1.770.695		0	(7)	(7)	0,00			
	01.2022	DKK	30.000		4.033		3	0	3	0,00			
SOG	01.2021	€	5.764	NOK	60.837		43	0	43	0,00			
	03.2021	HKD	37.071	\$	4.782		0	0	0	0,00			
SSB	01.2021	£	133.384	€	149.025		16	0	16	0,00			
	01.2021	¥	8.340.000		66.706		695	0	695	0,01			
	01.2021	\$	30.838		25.202		14	(14)	0	0,00			
	02.2021	¥	3.470.000		27.920		465	0	465	0,01			
	03.2021	HKD	67.093	\$	8.655		0	0	0	0,00			
	03.2021	¥	6.000.000	€	47.419		0	(36)	(36)	0,00			
	03.2021	\$	2.551	CNY	16.940		32	0	32	0,00			
	03.2021		41.567	KRW	46.265.782		796	0	796	0,02			
UAG	01.2021	CAD	5.691	€	3.667		17	0	17	0,00			
	03.2021	HKD	354.780	\$	45.774		7	0	7	0,00			
							€	56.507	€	(7.669)	€	48.838	0,96

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	CHF	31	€	0	€	0	0,00		
	01.2021	€	1.176	CHF	1.275		3	0,00		
MYI	01.2021		1.368		1.477		0	(1)	(1)	0,00
RBC	01.2021		51		55		0	0	0	0,00
SCX	01.2021		1.499		1.620		0	(1)	(1)	0,00
				€	3	€	(2)	€	1	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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			
BOA	01.2021	€	35.298	£	31.676	€	89	€	89	0,00
	01.2021	£	2.099	€	2.333		0	(12)	(12)	0,00
BPS	01.2021	€	191	£	173		2	0	2	0,00
CBK	01.2021		42.463		38.132		136	0	136	0,00
DUB	01.2021		121		110		3	0	3	0,00
GLM	01.2021		75.036		66.991		4	(201)	(197)	0,00
HUS	01.2021		151		137		2	0	2	0,00
	01.2021	£	1.274	€	1.406		0	(17)	(17)	0,00
JPM	01.2021	€	74.933	£	67.274		222	0	222	0,01
MYI	01.2021		139		128		4	0	4	0,00
RBC	01.2021		5.377		4.884		80	0	80	0,00
	01.2021	£	1.580	€	1.752		0	(14)	(14)	0,00
SCX	01.2021	€	3.207	£	2.914		49	0	49	0,00
SOG	01.2021		113		103		2	0	2	0,00
UAG	01.2021		1.894		1.712		19	0	19	0,00
				€	612	€	(244)	€	368	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse 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
GLM	02.2021	SGD 3	€ 2	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
MYI	02.2021	€ 209	SGD 340	€ 1	€ 0	€ 1	0,00
				€ 1	€ 0	€ 1	0,00

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional USD (Hedged) thesaurierend, Class E USD (Hedged) thesaurierend, H Institutional USD (Hedged) thesaurierend und M Retail USD (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	01.2021	€ 99.824	\$ 119.885	€ 0	€ (1.851)	€ (1.851)	(0,04)
BPS	01.2021	72.552	86.888	0	(1.539)	(1.539)	(0,03)
	02.2021	21.896	26.809	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	76.346	91.693	0	(1.407)	(1.407)	(0,03)
CBK	01.2021	4.562	5.595	11	0	11	0,00
HUS	01.2021	2.272	2.757	0	(19)	(19)	0,00
	01.2021	\$ 4.853	€ 4.002	36	0	36	0,00
IND	01.2021	€ 4.362	\$ 5.352	12	0	12	0,00
MYI	01.2021	16.900	20.609	7	(65)	(58)	0,00
RBC	01.2021	4.742	5.788	1	(14)	(13)	0,00
	01.2021	\$ 167	€ 137	1	0	1	0,00
RYL	01.2021	€ 3.082	\$ 3.699	0	(59)	(59)	0,00
SCX	01.2021	76.949	92.154	0	(1.632)	(1.632)	(0,03)
	02.2021	186.680	228.566	0	(2)	(2)	0,00
UAG	01.2021	2.206	2.694	0	(5)	(5)	0,00
				€ 68	€ (6.593)	€ (6.525)	(0,13)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ 41.805 0,82

Summe Anlagen

€ 5.043.720 98,34

Sonstige Aktiva und Passiva

€ 85.206 1,66

Nettovermögen

€ 5.128.926 100,00

### 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) 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) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 227 und Barmittel in Höhe von EUR 6.350 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 60.014 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(3.448)	45.512	0	42.064
<b>Summen</b>	<b>€ 1.608.431</b>	<b>€ 3.435.289</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 5.043.720</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	€ 350.610	€ 1.059.988	€ 0	€ 1.410.598
Investmentfonds	147.132	0	0	147.132
Pensionsgeschäfte	0	11.570	0	11.570
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	1.019	11.684	0	12.703
<b>Summen</b>	<b>€ 498.761</b>	<b>€ 1.083.242</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 1.582.003</b>

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

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

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

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (3.066)	€ 3.840	€ 774
BPS	6.193	(5.310)	883
BRC	(254)	440	186
CBK	2.490	(1.550)	940
DUB	(4)	(20)	(24)
FBF	(13)	0	(13)
GLM	(838)	1.710	872
GST	(3)	0	(3)
HUS	42	360	402
IND	10	0	10
JLN	(2)	0	(2)
JPM	1.271	0	1.271
MYC	(19)	0	(19)
MYI	286	227	513
RBC	985	(1.240)	(255)
RYL	(245)	0	(245)
SCX	32.921	(34.610)	(1.689)
SOG	45	0	45
SSB	1.968	(4.510)	(2.542)
UAG	38	0	38

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	67,29	68,92
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	11,07	18,98
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,45	k. A.
Investmentfonds	13,42	9,17
Pensionsgeschäfte	5,29	0,72
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,07)	0,09
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,07	(0,27)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,82	0,97
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,54)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	4,42	18,79
US-Schatzobligationen	5,95	k. A.
Non-Agency-MBS	0,84	2,78
Forderungsbesicherte Wertpapiere	2,38	8,95
Staatsemissionen	0,54	2,14
Stammaktien	45,70	32,06
Kurzfristige Instrumente	18,98	23,18
Investmentfonds	13,42	9,17
Pensionsgeschäfte	5,29	0,72
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,07)	0,06
Optionskauf		
Optionen auf Indizes	k. A.	0,17
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Indizes	k. A.	(0,14)

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,15)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	0,08	(0,12)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,02)	(0,06)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Total Return Swaps auf Indizes	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,96	0,98
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,12)	0,05
Sonstige Aktiva und Passiva	1,66	1,42
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



# Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local 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	
10.500 % fällig am 07.04.2023 DOP	141.500	\$ 2.613	0,09	<b>INDONESIEN</b>				<b>MALAYSIA</b>				
10.750 % fällig am 11.08.2028	323.000	6.433	0,23	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
10.750 % fällig am 08.11.2029	74.900	1.501	0,05	Indonesia Government International Bond				Malaysia Government International Bond				
12.000 % fällig am 05.03.2032	615.200	13.439	0,47	7,375 % fällig am 15.05.2048	IDR	982.000	\$ 74	0,00	3,478 % fällig am 14.06.2024 (j) MYR	200	\$ 52	0,00
16.950 % fällig am 04.02.2022	37.900	727	0,03	7,500 % fällig am 15.05.2038		38.356.000	2.964	0,11	3,480 % fällig am 15.03.2023	73.700	18.967	0,67
Summe Dominikanische Republik		83.723	2,94	7,500 % fällig am 15.04.2040		54.720.000	4.329	0,15	3,502 % fällig am 31.05.2027	93.400	24.795	0,87
<b>AGYPTEN</b>				8,125 % fällig am 15.05.2024		51.294.000	4.013	0,14	3,733 % fällig am 15.06.2028 (j)	49.900	13.521	0,48
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				8,250 % fällig am 15.05.2029		100.829.000	8.238	0,29	3,757 % fällig am 20.04.2023 (j)	1.500	389	0,01
Egypt Government International Bond				8,250 % fällig am 15.05.2036		11.427.000	948	0,03	3,757 % fällig am 22.05.2040 (j)	4.290	1.128	0,04
4,750 % fällig am 16.04.2026	€ 3.700	4.719	0,17	8,375 % fällig am 15.04.2039		39.139.000	3.293	0,12	3,828 % fällig am 05.07.2034 (j)	1.490	396	0,01
14,313 % fällig am 13.10.2023 EGP	49.400	3.194	0,11	8,750 % fällig am 15.02.2044		647.000	53	0,00	3,885 % fällig am 15.08.2029 (j)	39.754	10.842	0,38
14,369 % fällig am 20.10.2025	243.100	15.621	0,55	9,500 % fällig am 15.07.2023		31.034.000	2.465	0,09	3,892 % fällig am 15.03.2027 (j)	19.100	5.161	0,18
14,605 % fällig am 08.09.2025	214.700	13.928	0,49	Summe Indonesien		26.377	0,93	3,899 % fällig am 16.11.2027	45.400	12.354	0,43	
16,300 % fällig am 09.04.2024	80.000	5.444	0,19	<b>IRLAND</b>				3,900 % fällig am 30.11.2026 (j)	11.200	3.035	0,11	
Summe Ägypten		42.906	1,51	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				3,906 % fällig am 15.07.2026 (j)	1.200	323	0,01	
<b>FRANKREICH</b>				Toro European CLO DAC				3,955 % fällig am 15.09.2025 (j)	15.600	4.199	0,15	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,650 % fällig am 15.04.2030	€	5.300	6,475	0,23	4,181 % fällig am 15.07.2024 (j)	25.300	6.749	0,24
BNP Paribas S.A.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,254 % fällig am 31.05.2035 (j)	13.590	3.774	0,13	
6,240 % fällig am 06.02.2025	IDR 396.200.000	29.737	1,05	Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				4,642 % fällig am 07.11.2033 (j)	1.420	404	0,01	
Societe Generale S.A.				9,350 % fällig am 06.08.2022	RUB	794.000	11,325	0,40	4,935 % fällig am 30.09.2043 (j)	3.220	938	0,03
6,750 % fällig am 07.04.2021 (f)(h)	€ 500	621	0,02	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Malaysia Government Investment Issue				
7,375 % fällig am 13.09.2021 (f)(h)	\$ 600	616	0,02	European Loan Conduit				3,151 % fällig am 15.05.2023 (j)	43.200	11.049	0,39	
Summe Frankreich		30.974	1,09	1,000 % fällig am 17.02.2030	€	2.398	2,925	0,10	3,422 % fällig am 30.09.2027 (j)	28.900	7.592	0,27
<b>DEUTSCHLAND</b>				Summe Irland		20.725	0,73	3,655 % fällig am 15.10.2024 (j)	31.100	8.173	0,29	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ITALIEN</b>				3,726 % fällig am 31.03.2026	80.400	21.461	0,75	
Deutsche Bank AG				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,899 % fällig am 15.06.2027	1.330	358	0,01	
6,680 % fällig am 23.01.2025	IDR 672.100.000	49.614	1,74	Banca Carige SpA				4,119 % fällig am 30.11.2034	8.100	2.195	0,08	
<b>GHANA</b>				0,977 % fällig am 25.05.2022		4.600	5,660	0,20	4,130 % fällig am 09.07.2029 (j)	23.650	6.507	0,23
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Intesa Sanpaolo SpA				4,258 % fällig am 26.07.2027 (j)	900	247	0,01	
Ghana Government International Bond				7,000 % fällig am 19.01.2021 (f)(h)		1.700	2,089	0,07	4,369 % fällig am 31.10.2028 (j)	6.200	1.725	0,06
20,750 % fällig am 16.01.2023	GHS 15.000	2.630	0,09	UniCredit SpA				4,638 % fällig am 15.11.2049 (j)	3.400	948	0,03	
<b>HONGKONG</b>				6,750 % fällig am 10.09.2021 (f)(h)		1.600	1,998	0,07	4,724 % fällig am 15.06.2033 (j)	34.963	9.956	0,35
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				9,250 % fällig am 03.06.2022 (f)(h)		200	269	0,01	4,895 % fällig am 08.05.2047 (j)	1.400	397	0,01
Huarong Finance Co. Ltd.				Summe Italien		10.016	0,35	Summe Malaysia		177.635	6,23	
3,250 % fällig am 03.06.2021	\$ 5.200	5.231	0,18	<b>JAPAN</b>				<b>MEXIKO</b>				
3,625 % fällig am 22.11.2021	3.600	3.664	0,13	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAMMAKTIE</b>				
Summe Hongkong		8.895	0,31	Nomura International Funding Pte. Ltd.				Hipotecaria Su Casita S.A. (c)	212.074	0	0,00	
<b>UNGARN</b>				6,625 % fällig am 18.05.2033	IDR	133.000.000	9,632	0,34	<b>PARI (000S)</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>KASACHSTAN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Hungary Government International Bond				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				America Movil S.A.B. de C.V.				
1,500 % fällig am 24.08.2022	HUF 3.405.400	11.683	0,41	Development Bank of Kazakhstan JSC				8,460 % fällig am 18.12.2036	MXN 1.800	97	0,00	
1,500 % fällig am 22.04.2026	7.871.800	26.724	0,94	4,125 % fällig am 10.12.2022	\$	500	526	0,02	Corp. GEO S.A.B. de C.V.			
2,000 % fällig am 23.05.2029	1.990.500	6.780	0,24	8,950 % fällig am 04.05.2023	KZT	2.290.000	5,396	0,19	8,875 % fällig am 25.09.2014 ^	\$ 250	0	0,00
2,500 % fällig am 24.10.2024	10.754.000	38.391	1,35	Summe Kasachstan		5.922	0,21	9,250 % fällig am 30.06.2020 ^	700	0	0,00	
2,750 % fällig am 22.12.2026 (j)	14.010.600	50.879	1,78	<b>LUXEMBURG</b>				Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.				
3,000 % fällig am 26.06.2024	5.607.800	20.244	0,71	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				9,620 % fällig am 28.06.2018 ^	MXN 22.130	34	0,00	
5,500 % fällig am 24.06.2025	166.600	670	0,02	Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK)				Petroleos Mexicanos				
Summe Ungarn		155.371	5,45	10,000 % fällig am 09.11.2024 ^ (b)	\$	1.343	345	0,01	7,190 % fällig am 12.09.2024	505.100	22.981	0,81
								7,650 % fällig am 24.11.2021	20.000	1.003	0,04	
								Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.				
								8,790 % fällig am 09.12.2014 ^	29.700	0	0,00	
								Summe Mexiko		24.115	0,85	

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
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>QNB Finance Ltd.</b>				<b>8,750 % fällig am 31.01.2044</b>			
Mexico Government International Bond				6,800 % fällig am 04.03.2030	IDR 951.700.000	\$ 72.658	2,55	(j)	ZAR 68.700	\$ 3.834	0,13
6,750 % fällig am 09.03.2023	\$ 410.900	\$ 21.657	0,76	6,900 % fällig am 23.01.2025				8,875 % fällig am 28.02.2035	644.200	38.676	1,36
7,750 % fällig am 29.05.2031	145.000	8.548	0,30	7,900 % fällig am 05.07.2024 (i)	178.300.000	13.674	0,48	9,000 % fällig am 31.01.2040	88.500	5.140	0,18
7,750 % fällig am 13.11.2042 (j)	662.100	38.303	1,34	Summe Katar		107.229	3,76	10,500 % fällig am 21.12.2026	1.027.332	82.982	2,91
8,000 % fällig am 07.12.2023	385.000	21.216	0,75	<b>RUMÄNIEN</b>				(j)	727.500	58.763	2,06
8,000 % fällig am 05.09.2024	137.000	7.686	0,27	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				10,500 % fällig am 21.12.2026			
8,000 % fällig am 07.11.2047 (j)	322.900	19.135	0,67	Romania Government International Bond				Summe Südafrika	334.294	11,73	
8,500 % fällig am 31.05.2029	16.000	979	0,03	4,150 % fällig am 26.01.2028	RON 31.400	8.530	0,30	<b>SÜDKOREA</b>			
8,500 % fällig am 18.11.2038	107.000	6.655	0,23	4,500 % fällig am 17.06.2024	212.500	56.772	1,99	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
10,000 % fällig am 20.11.2036	75.000	5.275	0,19	5,000 % fällig am 12.02.2029	(j)	12.600	0,43	Export-Import Bank of Korea	IDR 4.100.000	313	0,01
Summe Mexiko	153.569	5,39		Summe Rumänien		68.947	2,42	7,250 % fällig am 07.12.2024	2.800.000	217	0,01
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>RUSSLAND</b>				<b>SPANIEN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Penta CLO BV				Russia Government International Bond				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
0,790 % fällig am 04.08.2028	€ 164	201	0,01	7,050 % fällig am 19.01.2028	RUB 998.500	14.582	0,51	8,875 % fällig am 14.04.2021	€ 600	751	0,03
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Cooperative Rabobank UA				7,100 % fällig am 16.10.2024	1.006.300	14.552	0,51	Banco Santander S.A.			
6,625 % fällig am 29.06.2021	(f)(h)	600	756	7,400 % fällig am 07.12.2022	497.300	7.100	0,25	6,750 % fällig am 25.04.2022	(f)(h)	200	259
ING Groep NV				7,600 % fällig am 20.07.2022	114.200	1.621	0,06	Summe Spanien			3.607
6,875 % fällig am 16.04.2022	(f)(h)	\$ 400	419	7,650 % fällig am 10.04.2030	2.171.400	33.142	1,16	Summe Südkorea			530
Summe Niederlande		1.376	0,05	7,700 % fällig am 23.03.2033	2.606.900	39.718	1,40	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>PERU</b>				<b>SERBIEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Alicorp SAA				Serbia Government International Bond				Autonomous Community of Catalonia			
6,875 % fällig am 17.04.2027	PEN 20.200	6.565	0,23	4,500 % fällig am 20.08.2032	RSD 493.700	5.492	0,19	4,900 % fällig am 15.09.2021	2.050	2.597	0,09
Banco de Credito del Peru				Summe Russland		194.547	6,83	Summe Spanien			3.607
4,650 % fällig am 17.09.2024	24.100	7.182	0,25	<b>SERBIEN</b>				Summe übernational			17.740
Summe Peru		13.747	0,48	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UBERNATIONAL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>SÜDAFRIKA</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Fondo MIVIVIENDA S.A.				Eskom Holdings SOC Ltd.				Corp. Andina de Fomento			
7,000 % fällig am 14.02.2024	39.000	12.390	0,43	0,000 % fällig am 18.08.2027 (d)	ZAR 100.100	2.902	0,10	6,500 % fällig am 16.03.2023	IDR 125.900.000	9.134	0,32
Peru Government International Bond				0,000 % fällig am 31.12.2032 (d)	254.000	2.977	0,11	6,770 % fällig am 24.05.2028	COP 27.500.000	8.606	0,30
5,400 % fällig am 12.08.2034	36.600	11.124	0,39	5,750 % fällig am 26.01.2021	\$ 2.400	2.396	0,08	Summe übernational			17.740
5,940 % fällig am 12.02.2029	96.200	33.191	1,17	7,850 % fällig am 02.04.2026	ZAR 282.000	19.339	0,68	<b>SCHWEIZ</b>			
6,150 % fällig am 12.08.2032	66.553	22.465	0,79	Transnet SOC Ltd.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,350 % fällig am 12.08.2028	106.000	37.250	1,31	10,000 % fällig am 30.03.2029	40.000	2.791	0,10	Credit Suisse Group AG			
6,900 % fällig am 12.08.2037	34.300	11.795	0,41	Summe Peru		161.650	5,67	7,125 % fällig am 29.07.2022	\$ 200	211	0,01
6,950 % fällig am 12.08.2031	30.400	10.928	0,38	<b>PHILIPPINEN</b>				UBS Group AG			
8,200 % fällig am 12.08.2026	23.328	8.760	0,31	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				7,125 % fällig am 10.08.2021	(f)(h) 600	619	0,02
Summe Peru		147.903	5,19	South Africa Government International Bond				Summe Schweiz			830
<b>PHILIPPINEN</b>				6,750 % fällig am 31.03.2021	5.100	350	0,01	<b>THAILAND</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				7,000 % fällig am 29.02.2031 (j)	380.246	22.222	0,78	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Philippines Government International Bond				8,000 % fällig am 31.01.2030 (j)	306.227	19.903	0,70	Thailand Government International Bond			
3,900 % fällig am 26.11.2022	PHP 792.000	16.826	0,59	8,250 % fällig am 31.03.2032	454.180	27.914	0,98	1,600 % fällig am 17.12.2029	THB 686.600	23.820	0,84
<b>POLEN</b>				8,500 % fällig am 31.01.2037 (j)	779.700	44.105	1,55	(j)			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Polen		142.104	4,99	1,875 % fällig am 17.06.2049			
Poland Government International Bond				<b>KATAR</b>				(j)			
2,500 % fällig am 25.04.2024	PLN 48.900	14.115	0,50	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,000 % fällig am 17.06.2042			
2,500 % fällig am 25.07.2026	115.200	34.135	1,20	Nakilat, Inc.				2,875 % fällig am 17.12.2028			
2,500 % fällig am 25.07.2027	104.300	31.088	1,09	6,067 % fällig am 31.12.2033	\$ 175	225	0,01	2,875 % fällig am 17.06.2046			
2,750 % fällig am 25.04.2028	44.500	13.509	0,47	Summe Katar				(j)			
2,750 % fällig am 25.10.2029	59.200	18.128	0,64	<b>PHILIPPINEN</b>				3,300 % fällig am 17.06.2038			
5,750 % fällig am 23.09.2022	105.580	31.129	1,09	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				(j)			
Summe Polen		142.104	4,99	South Africa Government International Bond				3,400 % fällig am 17.06.2036			
<b>KATAR</b>				6,750 % fällig am 31.03.2021	5.100	350	0,01	(j)			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,000 % fällig am 29.02.2031 (j)	380.246	22.222	0,78	3,600 % fällig am 17.06.2067			
Nakilat, Inc.				8,000 % fällig am 31.01.2030 (j)	306.227	19.903	0,70	Summe Thailand			
6,067 % fällig am 31.12.2033	\$ 175	225	0,01	8,250 % fällig am 31.03.2032	454.180	27.914	0,98	1,600 % fällig am 17.12.2029			
Summe Katar				8,500 % fällig am 31.01.2037 (j)	779.700	44.105	1,55	(j)			

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local 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		
3,650 % fällig am 20.06.2031 (j)	THB	523.500	21.436	0,75	<b>USA</b>								
3,775 % fällig am 25.06.2032 (j)		813.000	33.984	1,19	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>								
4,000 % fällig am 17.06.2066 (j)		13.000	633	0,02	Aames Mortgage Investment Trust								
4,675 % fällig am 29.06.2044 (j)		60.300	3.073	0,11	0,628 % fällig am 25.04.2036 \$ 1.918 \$ 1.770 0,06								
4,875 % fällig am 22.06.2029 (j)		134.650	5.838	0,21	1,453 % fällig am 25.06.2035 8.600 7.999 0,28								
4,875 % fällig am 22.06.2029		189.200	8.203	0,29	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust								
Summe Thailand		163.034	5,72		1,123 % fällig am 25.05.2034 1.139 1.129 0,04								
<b>TÜRKEI</b>					<b>Argent Mortgage Loan Trust</b>					JPMorgan Chase Bank N.A.			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>					0,628 % fällig am 25.03.2036 54 54 0,00					JPMorgan Structured Products BV			
Turkey Government International Bond					0,368 % fällig am 25.12.2036 3.100 2.751 0,10					3,231 % fällig am 14.10.2024 (i) \$ 5.143 5.146 0,18			
10,600 % fällig am 11.02.2026 TRY 37.000 4.640 0,16					<b>Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>					Rio Oil Finance Trust			
11,000 % fällig am 24.02.2027 143.800 18.071 0,64					0,318 % fällig am 25.03.2036 54 54 0,00					8,200 % fällig am 06.04.2028 3.528 3.978 0,14			
Summe Türkei 22.711 0,80					0,308 % fällig am 25.12.2036 1.655 1.156 0,04					9,250 % fällig am 06.07.2024 2.195 2.436 0,09			
<b>UKRAINE</b>					0,448 % fällig am 25.10.2036 570 411 0,01					9,750 % fällig am 06.01.2027 810 940 0,03			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>					<b>Countrywide Asset-Backed Certificates</b>					<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Ukraine					0,338 % fällig am 25.11.2037 5.739 5.428 0,19					American Home Mortgage Investment Trust			
5,490 % fällig am 29.06.2021 \$ 8.700 8.696 0,30					0,398 % fällig am 25.02.2036 800 750 0,03					1,757 % fällig am 25.09.2045 2 2 0,00			
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>					<b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust</b>					Banc of America Mortgage Trust			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					0,388 % fällig am 25.02.2037 2.530 2.461 0,09					3,629 % fällig am 25.02.2036 ^ 1 1 0,00			
ADCB Finance Cayman Ltd.					1,273 % fällig am 25.11.2035 2.850 2.802 0,10					BCAP LLC Trust			
7,500 % fällig am 15.10.2029 IDR 29.000.000 2.328 0,08					<b>Credit-Based Asset Servicing &amp; Securitization Trust</b>					3,257 % fällig am 26.05.2037 4.779 4.677 0,16			
8,160 % fällig am 29.04.2029 323.000.000 26.623 0,94					3,342 % fällig am 25.01.2037 ^ 3.325 1.526 0,05					Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
Summe Vereinigte Arabische Emirate 28.951 1,02					Ellington Loan Acquisition Trust					2,838 % fällig am 25.01.2035 1 1 0,00			
<b>GROSSBRITANNIEN</b>					Fremont Home Loan Trust					3,328 % fällig am 25.03.2035 11 11 0,00			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					0,368 % fällig am 25.08.2036 1.841 815 0,03					3,800 % fällig am 25.05.2047 ^ 20 20 0,00			
Santander UK Group Holdings PLC					GSAH Home Equity Trust					Bear Stearns ALT-A Trust			
7,375 % fällig am 24.06.2022 (f)(h) £ 200 286 0,01					6,002 % fällig am 25.11.2036 1.291 710 0,02					2,951 % fällig am 25.10.2035 ^ 445 421 0,01			
Standard Chartered Bank					<b>GSAMP Trust</b>					3,171 % fällig am 25.04.2037 8.482 7.452 0,26			
10,500 % fällig am 19.08.2030 IDR 172.560.000 16.126 0,57					0,198 % fällig am 25.12.2046 552 352 0,01					Citigroup Mortgage Loan Trust			
Ukraine Railways Via Shortline PLC					0,238 % fällig am 25.01.2037 1.097 804 0,03					3,361 % fällig am 25.09.2037 ^ 4.519 4.399 0,15			
9,875 % fällig am 15.09.2021 \$ 400 412 0,01					0,388 % fällig am 25.01.2037 14.727 11.042 0,39					4,005 % fällig am 25.03.2034 2 2 0,00			
Ukreximbank Via Biz Finance PLC					Lehman XS Trust					CitiMortgage Alternative Loan Trust			
16,500 % fällig am 02.03.2021 UAH 71.800 2.534 0,09					5,144 % fällig am 25.01.2036 ^ 2.134 2.152 0,08					0,798 % fällig am 25.10.2036 898 719 0,02			
Summe Großbritannien 19.358 0,68					Long Beach Mortgage Loan Trust					Countrywide Alternative Loan Trust			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>					0,298 % fällig am 25.09.2036 1.071 791 0,03					0,472 % fällig am 20.12.2035 620 581 0,02			
Canada Square Funding PLC					MASTR Asset-Backed Securities Trust					0,498 % fällig am 25.05.2036 ^ 1.057 437 0,02			
1,156 % fällig am 17.10.2051 £ 3.775 5.166 0,18					0,368 % fällig am 25.11.2036 1.125 849 0,03					0,508 % fällig am 25.04.2046 158 149 0,01			
Canterbury Finance No. 1 PLC					1,298 % fällig am 25.08.2037 876 826 0,03					Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
1,405 % fällig am 16.05.2056 5.800 7.931 0,28					Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust					0,948 % fällig am 25.03.2035 56 55 0,00			
Twin Bridges PLC					0,378 % fällig am 25.11.2036 8.818 6.587 0,23					3,105 % fällig am 25.11.2037 480 467 0,02			
1,204 % fällig am 12.06.2053 2.353 3.225 0,11					0,448 % fällig am 25.06.2036 225 199 0,01					FWD Securitization Trust			
Warwick Finance Residential Mortgages PLC					0,913 % fällig am 25.01.2035 116 111 0,00					2,240 % fällig am 25.01.2050 1.830 1.878 0,07			
0,000 % fällig am 21.12.2049 (d) 0 232 0,01					1,303 % fällig am 25.01.2035 1.732 1.645 0,06					GSMPS Mortgage Loan Trust			
1,703 % fällig am 21.12.2049 644 879 0,03					NovaStar Mortgage Funding Trust					0,498 % fällig am 25.01.2036 177 144 0,01			
2,203 % fällig am 21.12.2049 322 439 0,01					0,318 % fällig am 25.01.2037 1.974 891 0,03					GSR Mortgage Loan Trust			
2,703 % fällig am 21.12.2049 184 250 0,01					Option One Mortgage Loan Trust					3,050 % fällig am 25.01.2036 ^ 6 6 0,00			
3,203 % fällig am 21.12.2049 184 247 0,01					0,368 % fällig am 25.04.2037 2.347 1.868 0,07					HarborView Mortgage Loan Trust			
Summe Großbritannien 18.369 0,64					0,368 % fällig am 25.05.2037 1.545 1.133 0,04					0,357 % fällig am 19.12.2036 2.721 2.448 0,09			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>					<b>Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>					Impac CMB Trust			
Canada Square Funding PLC					0,883 % fällig am 25.08.2035 100 99 0,00					0,788 % fällig am 25.03.2035 157 157 0,01			
1,156 % fällig am 17.10.2051 £ 3.775 5.166 0,18					Saxon Asset Securities Trust					IndyMac Mortgage Loan Trust			
Canterbury Finance No. 1 PLC					0,458 % fällig am 25.09.2037 876 852 0,03					0,328 % fällig am 25.02.2037 535 525 0,02			
1,405 % fällig am 16.05.2056 5.800 7.931 0,28					Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust					3,072 % fällig am 25.11.2037 336 324 0,01			
Twin Bridges PLC					0,728 % fällig am 25.12.2035 1.573 1.544 0,05					JPMorgan Resecuritization Trust			
1,204 % fällig am 12.06.2053 2.353 3.225 0,11					SLM Student Loan Trust					2,500 % fällig am 25.03.2056 365 364 0,01			
Warwick Finance Residential Mortgages PLC					0,007 % fällig am 15.12.2033 € 392 446 0,02					Lehman XS Trust			
0,000 % fällig am 21.12.2049 (d) 0 232 0,01					0,318 % fällig am 25.07.2037 \$ 1.447 1.277 0,04					0,338 % fällig am 25.09.2046 2.272 2.232 0,08			
1,703 % fällig am 21.12.2049 644 879 0,03					<b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>					0,388 % fällig am 25.06.2047 568 507 0,02			
2,203 % fällig am 21.12.2049 322 439 0,01					0,303 % fällig am 25.09.2036 2.325 1.857 0,07					MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
2,703 % fällig am 21.12.2049 184 250 0,01					0,368 % fällig am 25.10.2037 6.118 4.360 0,15					0,628 % fällig am 25.05.2037 3.227 1.896 0,07			
3,203 % fällig am 21.12.2049 184 247 0,01					Continental Resources, Inc.					Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust			
Summe Großbritannien 18.369 0,64					5,000 % fällig am 15.09.2022 69 69 0,00					0,348 % fällig am 25.03.2037 2.985 1.173 0,04			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>					Ford Motor Credit Co. LLC					Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
Canada Square Funding PLC					2,770 % fällig am 07.01.2021 2.300 2.300 0,08					2,201 % fällig am 25.06.2036 1 1 0,00			
1,156 % fällig am 17.10.2051 £ 3.775 5.166 0,18					3,550 % fällig am 07.10.2022 1.900 1.941 0,07					Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
Canterbury Finance No. 1 PLC					1,641 % fällig am 25.10.2037 2.164 2.032 0,07					1,641 % fällig am 25.10.2037 2.164 2.032 0,07			
1,405 % fällig am 16.05.2056 5.800 7.931 0,28					5,500 % fällig am 25.03.2037 ^ 473 450 0,02					5,500 % fällig am 25.03.2037 ^ 473 450 0,02			
Twin Bridges PLC					6,250 % fällig am 25.01.2037 ^ 591 573 0,02					6,250 % fällig am 25.01.2037 ^ 591 573 0,02			

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
<b>SEQUOIA MORTGAGE TRUST</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
0,342 % fällig am 20.06.2036	\$ 4.869	\$ 4.675	0,16	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
3,658 % fällig am 20.01.2038 ^	434	391	0,01	(3,480) % fällig am 13.09.2021 (d)(e)	ARS 231.584	\$ 1.688	0,06	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (g)			
Structured Asset Mortgage Investments Trust	956	901	0,03	1,782 % fällig am 31.03.2021 (d)(e)	251.000	1.764	0,06	250.000	\$	2.522	0,09
0,448 % fällig am 25.02.2037				<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)			
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust	1.075	990	0,03	13,249 % fällig am 11.05.2021 (d)(e)	EGP 129.000	7.853	0,28	428.550		5.010	0,17
2,996 % fällig am 25.10.2037 ^				13,250 % fällig am 06.04.2021 (d)(e)	44.000	2.712	0,10	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)			
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	168	145	0,01	13,319 % fällig am 26.01.2021 (d)(e)	55.500	3.501	0,12	18.818.441		187.469	6,58
0,518 % fällig am 25.05.2034	32	31	0,00	13,479 % fällig am 02.03.2021 (d)(e)	141.000	8.789	0,31	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)			
3,534 % fällig am 25.02.2037 ^	1.564	1.505	0,05	13,501 % fällig am 16.02.2021 (d)(e)	47.000	2.944	0,10	748.248		9.720	0,34
0,448 % fällig am 25.03.2036	512	481	0,02	<b>MEXICO TREASURY BILLS</b>				Summe Investmentfonds			
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				4,390 % fällig am 25.03.2021 (d)(e)	MXN 85.300	4.241	0,15	\$	204.721		7,18
2,911 % fällig am 25.10.2036				Summe kurzfristige Instrumente		33.492	1,18				
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>URUGUAY STAATSEMISSIONEN</b>							
Uniform Mortgage-Backed Security	14	14	0,00	Uruguay Monetary Regulation Bill	UYU 107.000	2.511	0,09				
2,479 % fällig am 01.07.2035				0,000 % fällig am 05.02.2021 (d)							
Summe USA	169.678	5,96		<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>							
						\$ 3.172.822	111,36				

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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 1.100	\$ 67	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	0,397 %	04.03.2030	\$ 20.600	\$ 475	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	2,700	03.01.2022	BRL 400.600	90	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,840	03.01.2022	13.400	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,848	03.01.2022	11.000	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022	55.200	(4)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,865	03.01.2022	20.100	(2)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	86.200	(8)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,880	03.01.2022	779.500	(78)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,883	03.01.2022	331.900	(40)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,884	03.01.2022	70.600	(9)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,886	03.01.2022	102.500	(13)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,055	03.01.2022	142.400	(147)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,100	03.01.2022	1.308.600	1.171	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,125	03.01.2022	122.800	134	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,130	03.01.2022	752.000	903	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,150	03.01.2022	365.100	(176)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,170	03.01.2022	281.100	(290)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,990	03.01.2022	80.600	(128)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	4,000	03.01.2022	477.200	(879)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,020	02.01.2023	135.700	100	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,030	02.01.2023	184.300	142	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,038	02.01.2023	45.000	36	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	4,045	02.01.2023	545.400	(753)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,070	02.01.2023	161.500	150	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,100	02.01.2023	394.900	463	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	4,500	04.01.2021	658.900	(2.081)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,500	03.01.2022	230.200	1.344	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	4,605	02.01.2023	166.600	(464)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	4,640	02.01.2023	227.500	(664)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	4,720	02.01.2024	36.000	(42)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,870	02.01.2024	201.100	311	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,000	04.01.2021	353.700	935	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,000	02.01.2023	94.400	487	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,100	02.01.2024	50.600	(154)	(0,01)

## 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	
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,150 %	02.01.2023	BRL	550.700	\$ (1.593)	(0,06)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,160	02.01.2024		348.300	(948)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,250	02.01.2023		273.300	2.028	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,350	02.01.2023		52.700	(145)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,360	02.01.2023		4.900	(13)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,440	02.01.2023		19.900	202	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,650	03.01.2022		135.000	687	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,660	02.01.2025		242.500	279	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,680	02.01.2024		215.700	395	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,710	02.01.2025		66.100	355	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,745	02.01.2023		66.700	686	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,780	02.01.2023		9.800	102	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,920	02.01.2023		2.600	14	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,010	02.01.2025		34.000	259	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,020	04.01.2027		36.800	(45)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,030	02.01.2025		76.700	633	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,050	02.01.2025		102.500	(1.317)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,140	04.01.2027		223.400	1.577	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,180	04.01.2027		79.900	(427)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,230	02.01.2023		141.800	1.650	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,245	04.01.2027		10.400	(24)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,250	04.01.2027		27.100	(133)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,260	03.01.2022		88.100	1.115	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,375	02.01.2023		48.800	378	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,410	04.01.2027		80.000	573	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,450	04.01.2027		21.800	(139)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,500	04.01.2027		62.500	(349)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,510	04.01.2027		66.800	(460)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,520	04.01.2027		93.600	(329)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,675	02.01.2023		157.400	1.573	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,710	02.01.2025		13.900	201	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,745	02.01.2025		231.100	(3.180)	(0,11)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,810	02.01.2025		147.200	(2.137)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,885	04.01.2021		287.000	2.506	0,09
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,910	04.01.2021		397.600	(3.495)	(0,12)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,930	04.01.2021		218.500	1.215	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,950	04.01.2027		800	9	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,983	04.01.2021		268.900	(2.486)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,990	04.01.2027		59.200	723	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,050	04.01.2021		306.900	2.817	0,10
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,095	04.01.2021		210.600	2.013	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,115	04.01.2027		82.200	1.084	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,170	04.01.2027		108.700	(1.507)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,184	04.01.2021		128.300	1.272	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,190	04.01.2021		90.600	(462)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,220	04.01.2021		225.100	2.258	0,08
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,255	04.01.2021		193.400	(1.927)	(0,07)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,290	04.01.2021		501.200	(5.046)	(0,18)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,305	04.01.2027		37.400	552	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,420	03.01.2022		194.600	2.412	0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,480	02.01.2025		119.400	2.287	0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,800	04.01.2027		27.000	489	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,830	04.01.2021		260.100	3.249	0,11
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,635	04.01.2027		65.500	(1.706)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,640	04.01.2027		105.900	2.358	0,08
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,675	04.01.2027		19.900	(524)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,790	04.01.2021		2.400	32	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,020	02.01.2023		98.600	3.192	0,11
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,490	04.01.2027		104.000	3.490	0,12
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,600	04.01.2027		48.900	(2.105)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,750	02.01.2025		17.400	678	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,760	02.01.2025		51.200	2.074	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,135	01.07.2021		70.500	1.496	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,240	04.01.2027		67.300	(1.521)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,300	02.01.2025		50.300	1.989	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,300	04.01.2027		77.600	(3.122)	(0,11)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,860	02.01.2023		115.200	5.170	0,18
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,350	04.01.2021		2.200	(17)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,800	04.01.2021		18.490	572	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,850	04.01.2021		78.220	2.474	0,09
Zahlung	1-Year BRL-CDI	16,395	04.01.2021		14.300	133	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	1,955	16.09.2025	CNY	41.200	(194)	(0,01)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,620	16.12.2025		13.600	(3)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,625	16.12.2025		60.400	(9)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,735	16.12.2025		43.500	(28)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,787	17.03.2025		80.200	(65)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,148	25.09.2022	COP	52.694.000	(39)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,215	04.05.2022		43.977.000	73	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,240	04.05.2022		43.977.300	78	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,720	04.05.2022		126.179.400	(127)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,090	26.11.2025		76.500.000	(6)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,130	17.07.2025		34.734.600	(90)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,240 %	15.10.2025	COP 77.435.000	\$ 264	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,255	11.12.2025	57.933.000	(140)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,680	03.11.2027	17.350.000	(60)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,975	23.06.2027	11.832.300	(113)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,005	20.08.2028	53.353.700	425	0,01
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	0,565	14.08.2025	PLN 45.900	20	0,00
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	0,585	22.09.2025	33.700	56	0,00
Erhalt	3-Month PLN-WIBOR	0,655	21.05.2025	16.600	(43)	0,00
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	0,911	02.10.2030	36.600	(117)	0,00
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	0,925	16.10.2030	4.100	(12)	0,00
Erhalt	3-Month PLN-WIBOR	0,935	14.08.2030	3.200	7	0,00
Erhalt	3-Month PLN-WIBOR	0,980	09.06.2030	4.300	(1)	0,00
Erhalt	3-Month PLN-WIBOR	1,005	09.06.2030	33.600	(28)	0,00
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	1,163	03.12.2030	50.200	128	0,00
Erhalt	3-Month PLN-WIBOR	1,490	29.08.2029	57.400	(746)	(0,03)
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	1,833	05.02.2022	145.900	1.308	0,05
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	1,835	31.01.2022	28.400	254	0,01
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	1,942	20.03.2024	44.900	889	0,03
Erhalt	3-Month PLN-WIBOR	2,250	20.03.2024	41.200	(661)	(0,02)
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	2,250	19.06.2024	40.000	736	0,03
Erhalt	3-Month PLN-WIBOR	2,500	16.03.2026	23.600	(830)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,105	02.12.2025	ZAR 512.400	650	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,255	09.07.2025	319.400	730	0,03
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,375	29.01.2023	367.100	(1.537)	(0,05)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,410	11.02.2023	703.100	2.970	0,10
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,670	13.12.2022	98.200	(403)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,845	18.03.2026	230.000	(1.469)	(0,05)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,855	11.02.2026	705.700	(4.776)	(0,17)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,120	26.05.2030	88.500	243	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	19.09.2023	142.300	1.029	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,460	06.03.2030	110.400	(617)	(0,02)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,490	06.03.2030	111.200	(638)	(0,02)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	15.03.2022	75.000	284	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	19.09.2028	137.400	(1.163)	(0,04)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,750	16.03.2021	393.400	297	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	9,500	16.09.2026	53.400	(437)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,513	09.07.2022	CLP 30.077.000	55	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	0,520	10.08.2022	11.453.000	(25)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,524	03.07.2022	62.688.100	88	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,525	09.07.2022	12.031.000	18	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,700	24.11.2022	13.925.200	(2)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,905	24.11.2023	18.641.300	36	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	0,955	25.11.2023	15.000.000	1	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,020	01.03.2025	6.193.000	73	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,025	01.03.2025	6.451.000	74	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,030	01.03.2025	8.262.000	92	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,040	17.12.2023	5.127.000	14	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,070	10.12.2023	3.700.000	16	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,080	10.12.2023	3.700.000	18	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,090	10.12.2023	8.584.000	44	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,150	24.07.2025	290.500	(3)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	1,159	06.12.2022	51.498.000	157	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,165	14.07.2025	6.564.000	(54)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,170	14.07.2025	6.564.000	(52)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	1,220	03.12.2022	6.483.000	26	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,220	14.07.2025	13.854.000	(61)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	1,265	03.12.2022	5.015.000	23	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,340	05.05.2024	27.857.500	(413)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,470	01.03.2025	12.050.000	154	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,684	04.06.2027	18.963.600	(260)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,715	04.06.2027	3.782.600	(41)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,740	09.12.2025	7.836.000	148	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,815	23.08.2021	3.500.000	68	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,840	13.03.2025	457.000	(18)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,870	14.01.2022	27.832.400	(829)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,875	14.01.2022	29.649.700	(888)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,900	11.09.2023	18.988.700	(830)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,910	01.03.2023	3.500.000	(145)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,935	10.03.2025	9.206.000	(419)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,940	10.03.2025	4.602.900	(211)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,947	23.11.2027	9.776.000	(8)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,950	05.05.2026	5.894.100	178	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,965	24.11.2027	8.553.000	(21)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,005	01.03.2023	3.465.090	(155)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,080	01.06.2030	3.688.000	(168)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,110	01.03.2023	4.250.000	(206)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,110	01.06.2030	1.385.000	(58)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,120	01.03.2023	5.320.000	(260)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,120	14.07.2030	7.000.000	234	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,170	14.07.2030	7.199.000	193	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,245	10.12.2027	1.305.000	36	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,255	10.12.2027	6.892.000	196	0,01

## 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
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,260 %	10.09.2027	CLP 7.948.100	\$ (316)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,300	05.09.2026	4.789.900	(275)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,335	03.09.2026	2.007.400	(122)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,340	08.10.2027	2.970.700	(132)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,393	05.02.2025	12.898.000	995	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,410	31.01.2025	8.900.000	700	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,420	24.02.2025	11.304.000	876	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,480	24.11.2030	10.940.000	14	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,510	14.01.2025	23.898.900	2.060	0,07
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,565	27.11.2030	2.740.000	26	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,580	05.02.2026	5.159.000	450	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,585	04.12.2024	7.470.000	(586)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,585	27.11.2030	2.730.000	34	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,590	04.12.2024	7.578.000	(596)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,635	04.12.2024	5.987.000	(486)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,640	01.03.2026	10.523.000	(942)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,650	04.12.2024	6.135.000	(506)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,740	10.12.2030	5.395.000	169	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,780	09.12.2024	6.197.000	552	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,000	07.01.2030	4.970.000	445	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,060	08.01.2030	4.500.000	437	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,120	05.02.2030	1.679.000	170	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,215	14.01.2030	12.172.000	(1.412)	(0,05)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	0,650	31.03.2030	CZK 31.300	72	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	0,690	31.03.2025	557.600	264	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	0,765	07.04.2026	144.300	93	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	0,800	11.05.2030	468.900	799	0,03
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,915	01.09.2025	131.000	(36)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	0,929	13.03.2030	266.700	275	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,050	23.12.2025	349.100	(45)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,477	04.02.2030	358.600	534	0,02
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,781	04.02.2024	341.600	677	0,02
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,890	15.01.2030	353.500	1.197	0,04
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	2,250	19.06.2021	764.100	684	0,02
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	2,250	19.12.2023	1.015.800	2.354	0,08
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	2,255	15.01.2023	1.107.800	(2.690)	(0,09)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	2,465	19.12.2023	37.200	(83)	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	0,710	31.03.2025	HUF 3.731.900	97	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	0,800	14.06.2022	14.350.000	(237)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	0,840	18.08.2022	16.882.300	151	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	0,960	05.03.2023	3.207.000	109	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	0,980	23.07.2024	7.862.700	(100)	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,100	03.04.2025	5.436.300	(208)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,243	08.09.2025	3.267.500	135	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	19.06.2024	8.026.600	1.016	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	28-Day MXN-TIIE	4,515	17.08.2022	263.100	36	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,530	15.11.2022	242.500	33	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,535	15.11.2022	479.300	(113)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,610	27.06.2024	496.500	95	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,670	22.12.2025	434.600	(38)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,695	25.06.2024	488.500	164	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	28-Day MXN-TIIE	4,700	25.08.2022	932.700	210	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,715	24.06.2024	296.900	110	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,775	26.06.2025	162.100	58	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,830	22.07.2025	735.900	(284)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,835	24.07.2025	83.500	(33)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	17.06.2024	996.000	630	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,870	12.11.2024	127.800	(74)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,917	11.08.2025	233.500	141	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,970	08.08.2025	12.300	8	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,980	12.08.2025	167.600	117	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,000	22.02.2023	206.320	531	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,080	16.06.2025	102.900	96	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,120	29.09.2025	268.400	(260)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,130	14.05.2025	552.400	(562)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,445	05.12.2030	199.200	50	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,500	22.02.2023	240.700	449	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,590	03.07.2030	172.600	(170)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,610	03.07.2030	393.000	(416)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,860	29.03.2023	636.000	1.093	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,865	13.06.2030	226.900	477	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,870	12.06.2030	116.800	248	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,880	13.06.2030	140.000	302	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,890	09.03.2023	641.800	1.093	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,893	05.06.2030	282.900	(615)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,918	07.12.2023	608.000	1.311	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,940	23.05.2030	82.600	(198)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,000	22.02.2023	160.800	844	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,040	02.05.2030	87.300	(242)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,060	16.05.2030	102.300	(294)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,095	29.05.2030	18.700	(56)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,260	07.06.2040	139.400	(195)	(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		6,288 %	25.04.2030	MXN 230.700	\$ (693)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,300	09.06.2022	125.000	184	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,340	09.12.2021	154.000	159	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,380	25.02.2025	89.900	315	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,380	05.06.2040	146.300	(311)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,430	04.06.2040	88.600	(215)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,435	18.05.2040	61.000	(148)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,463	18.05.2040	76.000	(197)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,465	26.09.2040	94.900	(247)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,480	28.05.2040	342.800	(944)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,510	09.12.2021	400.000	446	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,510	24.02.2025	692.800	2.608	0,09
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,535	09.12.2021	53.600	60	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,540	09.12.2021	452.900	(512)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,540	31.05.2040	240.300	(746)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,545	30.05.2040	75.100	(236)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,590	15.03.2023	661.000	(1.625)	(0,06)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,600	13.01.2025	341.200	1.308	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,600	26.02.2030	418.100	(959)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,618	18.01.2030	257.400	(1.301)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,620	02.01.2025	1.144.800	4.369	0,15
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,623	17.05.2040	132.400	(472)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,635	15.01.2025	800.900	(2.790)	(0,10)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,650	22.09.2021	1.122.100	(1.017)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,658	09.06.2022	148.900	(257)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,705	04.12.2029	200.000	1.070	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,740	09.12.2021	154.800	(190)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,765	20.09.2021	286.200	(272)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,830	27.12.2029	35.500	(207)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,845	02.11.2029	149.300	(877)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		6,855	20.03.2025	884.200	(3.897)	(0,14)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,065	26.12.2039	142.800	(891)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,127	10.08.2039	204.800	1.355	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,180	27.06.2024	1.133.700	(5.072)	(0,18)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,180	31.10.2039	118.500	(821)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,200	31.10.2039	102.500	(722)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,210	28.02.2030	306.000	2.219	0,08
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,210	28.10.2039	49.700	(354)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,220	28.02.2030	298.800	2.178	0,08
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,253	28.10.2039	99.600	(734)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,625	12.07.2039	163.200	1.558	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,640	13.07.2039	117.200	1.129	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,650	24.02.2023	842.300	2.878	0,10
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,675	04.06.2029	40.500	353	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,675	09.06.2039	438.200	4.320	0,15
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,720	24.03.2023	1.797.500	(6.834)	(0,24)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,730	23.03.2023	6.500	(24)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,830	15.12.2022	395.300	1.316	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,856	15.12.2022	381.800	1.326	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,865	13.05.2024	550.800	(2.982)	(0,10)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,875	16.12.2022	55.900	195	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,880	27.12.2022	505.000	1.574	0,06
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,885	27.05.2039	470.900	5.251	0,18
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,895	21.02.2040	200.000	2.238	0,08
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		7,910	07.12.2023	546.000	(2.734)	(0,10)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,920	28.12.2023	144.400	639	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,977	17.03.2028	942.600	8.718	0,31
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,990	16.03.2028	3.000	27	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		7,990	17.02.2040	15.800	186	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		8,103	04.01.2038	6.300	(77)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		8,110	03.05.2029	400.300	(4.099)	(0,14)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,135	07.05.2029	326.100	3.359	0,12
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,155	19.04.2029	95.700	1.004	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,300	17.02.2040	123.300	1.680	0,06
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,320	07.01.2032	195.200	2.235	0,08
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,390	31.05.2029	559.600	6.377	0,22
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,818	16.11.2023	1.191.500	7.342	0,26
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,910	15.11.2023	602.400	3.791	0,13
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		8,980	23.11.2023	1.096.000	6.391	0,22
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		9,100	09.11.2028	722.200	(9.621)	(0,34)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		9,210	08.11.2028	477.700	(6.469)	(0,23)
						\$ 49.576	1,74
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 49.643</b>	<b>1,74</b>

(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.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund (Forts.)

(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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus INR	INR 92,600	16.06.2025	2.200	\$ 132	\$ 93	0,00
	Put - OTC USD versus INR	92,600	16.06.2025	2.200	132	190	0,01
BPS	Put - OTC USD versus BRL	BRL 5,300	24.02.2021	7.600	244	320	0,01
CBK	Put - OTC USD versus RUB	RUB 75,800	25.02.2021	7.600	204	248	0,01
	Put - OTC USD versus TRY	TRY 7,950	25.02.2021	7.600	186	480	0,01
HUS	Put - OTC USD versus RUB	RUB 75,000	12.02.2021	21.100	462	506	0,02
MYI	Put - OTC USD versus BRL	BRL 5,350	08.02.2021	5.600	165	255	0,01
	Put - OTC USD versus MXN	MXN 20,100	24.02.2021	7.600	196	187	0,01
UAG	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR 15,250	24.02.2021	7.600	210	360	0,01
	Put - OTC USD versus TRY	TRY 7,500	18.01.2021	10.700	68	209	0,01
					\$ 1.999	\$ 2.848	0,10

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500 %	20.01.2021	7.700	\$ (5)	\$ 0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	3.600	(3)	0	0,00
						\$ (8)	\$ 0	0,00

#### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC USD versus BRL	BRL 5,150	24.02.2021	7.600	\$ (144)	\$ (193)	(0,01)
	Call - OTC USD versus BRL	5,700	24.02.2021	7.600	(112)	(54)	0,00
CBK	Put - OTC USD versus RUB	RUB 73,750	25.02.2021	7.600	(110)	(129)	(0,01)
	Call - OTC USD versus RUB	81,100	25.02.2021	7.600	(93)	(46)	0,00
HUS	Put - OTC USD versus TRY	TRY 7,410	25.02.2021	7.600	(43)	(132)	(0,01)
	Call - OTC USD versus TRY	8,910	25.02.2021	7.600	(130)	(28)	0,00
MYI	Put - OTC USD versus RUB	RUB 72,000	12.02.2021	42.200	(395)	(277)	(0,01)
	Call - OTC USD versus BRL	BRL 6,000	21.01.2021	10.800	(175)	(7)	0,00
UAG	Put - OTC USD versus BRL	5,157	08.02.2021	11.200	(165)	(254)	(0,01)
	Call - OTC USD versus BRL	5,700	18.02.2021	12.400	(197)	(80)	0,00
UAG	Put - OTC USD versus MXN	MXN 19,600	24.02.2021	7.600	(103)	(94)	0,00
	Call - OTC USD versus MXN	21,400	24.02.2021	7.600	(84)	(49)	0,00
UAG	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR 14,800	24.02.2021	7.600	(111)	(204)	(0,01)
	Call - OTC USD versus ZAR	16,350	24.02.2021	7.600	(88)	(29)	0,00
UAG	Call - OTC USD versus RUB	RUB 87,750	12.02.2021	21.200	(336)	(26)	0,00
	Call - OTC USD versus TRY	TRY 10,000	28.01.2021	5.300	(70)	(1)	0,00
	Call - OTC USD versus TRY	12,000	27.10.2021	5.300	(239)	(71)	0,00
					\$ (2.595)	\$ (1.674)	(0,06)

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

##### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.12.2024	\$ 27.300	\$ (44)	\$ 189	\$ 145	0,01
BRC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	18.200	124	(28)	96	0,00
	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2025	6.900	358	(270)	88	0,00
GST	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.500	(2)	10	8	0,00
					\$ 436	\$ (99)	\$ 337	0,01

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Nigeria International Government Bond	5,000 %	20.12.2021	\$ 3.800	\$ 204	\$ (62)	\$ 142	0,01
DUB	Egypt Government International Bond	5,000	20.06.2022	5.300	182	55	237	0,01
FBF	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2021	6.900	(588)	541	(47)	(0,01)
GST	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2021	1.200	(12)	10	(2)	0,00
JPM	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	5.500	(24)	99	75	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2021	1.200	(12)	10	(2)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2021	5.600	(439)	432	(7)	0,00
NGF	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	12.600	(25)	75	50	0,00
					\$ (714)	\$ 1.160	\$ 446	0,01

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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
BPS	Variabler Zinssatz entspricht 1-Month MXB-LIBOR abzgl. 0,140 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	05.05.2023	MXN 733.000	\$ 36.650	\$ (127)	\$ 357	\$ 230	0,01
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR zzgl. 0,114 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2021	TRY 383.500	59.411	637	(4.224)	(3.587)	(0,13)
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	11.800	2.042	14	111	125	0,01
	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	ARS 93.789	(3)	1.678	1.675	0,06
	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	08.05.2024	1.900	85.633	0	1.473	1.473	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)	3.763	3.748	0,13
GST	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR zzgl. 0,127 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2021	63.242	TRY 383.500	(63)	6.836	6.773	0,24
						\$ 443	\$ 9.994	\$ 10.437	0,37

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,295 %	08.09.2025	ILS 89.000	\$ 0	\$ (128)	\$ (128)	0,00
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,680	08.09.2030	44.500	0	22	22	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,800	24.04.2028	153.200	0	(1.439)	(1.439)	(0,05)
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,963	16.02.2028	21.300	(2)	829	827	0,03
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	13.700	0	525	525	0,02
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,197	18.03.2025	KRW 96.335.000	0	(527)	(527)	(0,02)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond 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 Nettovermögens
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,833 %	19.06.2026	THB 304.900	\$ 0	\$ 629	\$ 629	0,02
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,490	14.01.2021		0	48	48	0,00
BPS	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,420	23.01.2022	KRW 250.108.300	0	(2.017)	(2.017)	(0,07)
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,450	23.01.2025		0	1.664	1.664	0,06
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,588	16.12.2022	THB 1.342.900	0	(236)	(236)	(0,01)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,771	16.12.2025		0	(122)	(122)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,408	18.03.2030		0	96	96	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,385	23.01.2021		0	19	19	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,415	21.01.2021		0	54	54	0,00
BRC	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,795	20.06.2028	ILS 32.000	0	(278)	(278)	(0,01)
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028		0	1.282	1.282	0,05
BSH	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,910	06.06.2023	CLP 10.000.000	0	(735)	(735)	(0,03)
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,300	21.06.2029		0	(393)	(393)	(0,01)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,750	22.03.2026		0	1.383	1.383	0,05
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,790	14.03.2026		7	679	686	0,02
CBK	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,485	09.08.2024	ILS 68.500	0	(293)	(293)	(0,01)
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,950	23.05.2024		0	(1.261)	(1.261)	(0,04)
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,041	15.05.2024		0	1.166	1.166	0,04
	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,155	05.07.2022	COP 81.320.800	0	(944)	(944)	(0,03)
	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,960	10.05.2029		0	(1.328)	(1.328)	(0,05)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,763	24.05.2029	CLP 1.841.700	10	305	315	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,770	19.03.2026		0	11	11	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,050	16.09.2027	THB 294.800	0	154	154	0,01
	Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month THB-THBFX	1,195	17.03.2031		0	(84)	(84)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,625	27.07.2025		0	327	327	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,810	23.09.2025		0	465	465	0,02
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,410	15.01.2021		0	54	54	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,420	17.01.2021		0	40	40	0,00
CKL	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	ILS 14.000	(46)	618	572	0,02
DUB	Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,238	04.01.2021	BRL 123.500	0	1.262	1.262	0,04
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,690	27.09.2027	ILS 20.100	0	(134)	(134)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,580	19.10.2025	THB 76.700	0	248	248	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,390	23.01.2021		0	19	19	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,410	15.01.2021		0	54	54	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,410	21.01.2021		0	52	52	0,00
FBF	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,270	18.03.2021	CLP 12.180.000	0	243	243	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,780	23.09.2025	THB 20.740	0	74	74	0,00
GLM	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,235	15.01.2023	ILS 198.900	0	326	326	0,01
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,520	12.08.2024		0	(440)	(440)	(0,02)
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,540	11.05.2027		0	55	55	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,720	20.06.2028		0	(60)	(60)	0,00
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,820	15.01.2030		0	(333)	(333)	(0,01)
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,950	23.05.2024		0	(963)	(963)	(0,03)
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,960	24.05.2024		0	(2.227)	(2.227)	(0,08)
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,048	27.02.2024		0	1.556	1.556	0,05
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,408	10.12.2023		0	1.876	1.876	0,07
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,883	21.03.2028		0	1.026	1.026	0,04
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,898	17.12.2025		0	1.483	1.483	0,05
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028		(3)	1.706	1.703	0,06
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028		0	1.084	1.084	0,04
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,193	18.03.2022	KRW 219.935.000	0	1.092	1.092	0,04
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,050	01.08.2021	CLP 18.933.000	0	(431)	(431)	(0,02)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,990	01.08.2029		0	256	256	0,01
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,015	20.06.2026		0	(593)	(593)	(0,02)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,265	14.06.2029		0	458	458	0,02
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,455	02.06.2022		0	530	530	0,02
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,535	14.11.2022		0	293	293	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,830	22.05.2029		0	1.383	1.383	0,05
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,095	01.06.2027		0	2.483	2.483	0,09
	Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	4,319	22.05.2029		0	1.463	1.463	0,05
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,868	18.03.2025	THB 3.183.000	0	1.399	1.399	0,05
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,833	19.06.2026		535	631	1.166	0,04
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,990	08.06.2023		673	419	1.092	0,04
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,110	26.01.2022		711	385	1.096	0,04
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,175	19.06.2029		0	16	16	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,186	19.06.2029		0	517	517	0,02
HUS	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,018	11.03.2024	ILS 82.600	0	937	937	0,03
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,018	15.05.2024		0	1.021	1.021	0,04
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028		1	570	571	0,02
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,990	08.06.2023	THB 957.400	0	1.264	1.264	0,04
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,110	26.01.2022		0	90	90	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,195	19.06.2029		0	125	125	0,00
JPM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,475	09.08.2024	ILS 71.500	0	(297)	(297)	(0,01)
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,813	20.06.2028		0	(165)	(165)	(0,01)
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,027	19.03.2024		0	424	424	0,01
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,095	10.05.2024		0	240	240	0,01
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	2,078	20.06.2028		0	508	508	0,02
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,540	04.06.2029	CLP 4.115.000	0	(593)	(593)	(0,02)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,950	19.06.2029	THB 62.000	0	167	167	0,01
MYC	Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,800	04.01.2027	BRL 12.200	17	217	234	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	2,365	17.09.2025	MYR 11.000	0	(32)	(32)	0,00

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,715 %	16.09.2022	THB 1.354.800	\$ 0	\$ (326)	\$ (326)	(0,01)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,816	18.03.2022	3.309.900	0	(801)	(801)	(0,03)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,963	16.09.2025	327.500	0	(189)	(189)	(0,01)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,970	16.09.2030	392.300	0	116	116	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,110	24.01.2022	4.380.500	0	1.722	1.722	0,06
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,265	24.01.2025	1.788.600	0	(1.901)	(1.901)	(0,07)
MYI	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,340	18.09.2029	MYR 1.700	0	31	31	0,00
SCX	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,918	16.09.2030	THB 276.700	0	(129)	(129)	0,00
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,209	15.01.2025	1.752.900	0	(1.721)	(1.721)	(0,06)
						\$ 1.903	\$ 19.071	\$ 20.974	0,74

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt Volatilität	Referenzeinheit	Volatilität Ausübungs- kurs	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Zahlung	USD versus MXN 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	14,400	24.11.2021	\$ 47	\$ 0	\$ 33	\$ 33	0,00
CBK	Zahlung	USD versus MXN 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	15,100	05.11.2021	36	0	53	53	0,01
	Zahlung	USD versus ZAR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	16,600	05.11.2021	36	0	25	25	0,00
DUB	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	6,425	05.11.2021	72	0	18	18	0,00
GLM	Zahlung	USD versus BRL 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	18,300	05.11.2021	36	0	(4)	(4)	0,00
	Zahlung	USD versus BRL 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	18,825	23.11.2021	47	0	32	32	0,00
JPM	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	6,350	24.11.2021	93	0	10	10	0,00
	Zahlung	USD versus RUB 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	15,700	03.11.2021	36	0	37	37	0,00
MYI	Zahlung	USD versus RUB 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	15,500	23.11.2021	47	0	42	42	0,00
	Zahlung	USD versus ZAR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	16,000	24.11.2021	47	0	10	10	0,00
						\$ 0	\$ 256	\$ 256	0,01

(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	
BOA	01.2021	CLP	11.003.364	\$ 14.115	\$ 0	\$ (1.370)	(0,05)	
	01.2021	COP	53.359.005	15.336	0	(264)	(0,01)	
	01.2021	HUF	3.488.685	11.597	0	(172)	(0,01)	
	01.2021	¥	11.533	111	0	(1)	0,00	
	01.2021	\$	40.310	CLP 30.404.480	2.477	0	2.477	0,09
	01.2021		2.877	COP 11.103.206	369	0	369	0,01
	01.2021		10.122	CZK 235.720	860	0	860	0,03
	01.2021		8.124	HUF 2.438.907	106	(2)	104	0,00
	01.2021		1.428	PEN 5.156	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021		16.042	PLN 61.860	563	0	563	0,02
	01.2021	ZAR	521.139	\$ 33.653	0	(1.737)	(1.737)	(0,06)
	02.2021	AUD	289	211	0	(12)	(12)	0,00
	02.2021	\$	5.859	CZK 130.900	240	0	240	0,01
	03.2021	IDR	50.729.693	\$ 3.566	0	(60)	(60)	0,00
	03.2021	\$	10.825	IDR 155.020.000	254	0	254	0,01
	03.2021		7.379	INR 549.132	83	0	83	0,00
BPS	01.2021	BRL	70.389	\$ 13.545	0	(7)	(7)	0,00
	01.2021	CLP	24.742	31	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	€	635	778	1	0	1	0,00
	01.2021	MXN	429.358	21.651	144	0	144	0,01
	01.2021	\$	13.878	BRL 70.389	0	(327)	(327)	(0,01)
	01.2021		274	CLP 207.448	18	0	18	0,00
	01.2021		2.097	COP 8.090.226	268	0	268	0,01
	01.2021		40	€ 32	0	0	0	0,00
	01.2021		877	HUF 269.685	33	0	33	0,00
	01.2021		209	¥ 21.549	0	0	0	0,00
	01.2021		10.230	PEN 36.672	0	(90)	(90)	0,00
	01.2021		4.893	PLN 18.965	198	0	198	0,01
	02.2021	BRL	31.079	\$ 5.999	18	0	18	0,00
	02.2021	¥	21.549	209	0	0	0	0,00
	02.2021	\$	8.896	RUB 665.517	68	0	68	0,00
	03.2021	IDR	216.890.393	\$ 15.175	0	(326)	(326)	(0,01)
	03.2021	KRW	341.462	308	0	(6)	(6)	0,00
	03.2021	PHP	609.929	12.645	0	(11)	(11)	0,00
	03.2021	\$	369	HKD 2.857	0	0	0	0,00
	03.2021		5.527	INR 411.387	63	0	63	0,00
	03.2021		5.223	THB 156.566	3	0	3	0,00
BRC	01.2021	BRL	12.157	\$ 2.308	0	(32)	(32)	0,00
	01.2021	\$	2.339	BRL 12.157	1	0	1	0,00
	01.2021		14.111	MXN 291.863	509	0	509	0,02
	01.2021		11.156	TRY 88.108	643	0	643	0,02
	01.2021	ZAR	86.932	\$ 5.949	33	0	33	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	02.2021	\$	2.307	BRL 12.157	\$ 33	\$ 0	0,00
	02.2021		24.617	CZK 547.792	908	0	0,03
	02.2021		6.075	€ 4.941	0	(23)	0,00
	02.2021		1.455	RON 5.824	5	0	0,00
	03.2021	CNH	239.896	\$ 36.327	0	(424)	(0,02)
	03.2021	\$	17.243	MYR 70.398	287	0	0,01
	03.2021		320	THB 9.528	0	(2)	0,00
BSN	01.2021	PEN	57	\$ 16	0	0	0,00
BSS	01.2021	CLP	40.374.437	52.705	0	(4.111)	(0,14)
	01.2021	PEN	7.412	2.068	19	0	0,00
	09.2021	\$	1.095	UYU 49.772	30	0	0,00
	01.2022	BRL	28.824	\$ 4.936	0	(495)	(0,02)
CBK	01.2021		23.399	4.363	0	(142)	(0,01)
	01.2021	CLP	4.753.861	5.990	0	(700)	(0,02)
	01.2021	COP	118.755.141	34.513	0	(205)	(0,01)
	01.2021	HUF	81.077	264	0	(9)	0,00
	01.2021	MXN	1.328.996	64.541	0	(2.031)	(0,07)
	01.2021	PEN	11.357	3.163	23	0	0,00
	01.2021	\$	4.468	BRL 23.399	37	0	0,00
	01.2021		4.622	CLP 3.503.666	308	0	0,01
	01.2021		4.374	COP 15.934.088	284	0	0,01
	01.2021		9.478	CZK 219.453	747	0	0,03
	01.2021		1.934	HUF 575.416	7	0	0,00
	01.2021		170	MXN 3.554	8	0	0,00
	01.2021		7.220	PLN 26.676	10	(70)	0,00
	01.2021		540	RUB 41.533	21	0	0,00
	01.2021		17	TRY 133	1	0	0,00
	01.2021		5.889	UYU 253.298	104	0	0,00
	01.2021		55.192	ZAR 859.298	3.194	(32)	0,11
	01.2021	UYU	168.983	\$ 3.998	0	(3)	0,00
	02.2021	EGP	47.000	2.848	0	(104)	0,00
	02.2021	€	4.463	5.390	0	(77)	0,00
	02.2021	PEN	221.658	61.488	195	0	0,01
	02.2021	\$	1.897	CZK 40.675	0	(2)	0,00
	02.2021		664	ILS 2.160	9	0	0,00
	02.2021		4.320	PEN 15.536	0	(24)	0,00
	02.2021		2.298	RON 9.488	81	0	0,00
	02.2021		10.231	RUB 757.958	9	(33)	0,00
	03.2021	MXN	85.184	\$ 4.170	0	(66)	0,00
	03.2021	PEN	52.420	14.740	246	0	0,01
	03.2021	\$	18.180	CNH 120.801	326	0	0,01
	03.2021		4.212	COP 14.680.133	75	0	0,00
	03.2021		96.892	MXN 2.152.694	10.210	0	0,36
	03.2021		8.860	PEN 32.020	0	(7)	0,00
	03.2021		9.732	THB 294.639	104	0	0,00
	03.2021		7.778	UYU 332.982	10	0	0,00
	04.2021	EGP	372.399	\$ 22.635	0	(434)	(0,02)
	04.2021	PEN	359	100	1	0	0,00
	04.2021	\$	47	COP 172.000	4	0	0,00
	05.2021		7.577	27.796.109	507	0	0,02
	05.2021		78.893	MXN 1.728.345	6.658	0	0,23
	05.2021		7.945	PEN 28.961	59	0	0,00
DUB	01.2021	BRL	8.113	\$ 1.525	0	(37)	0,00
	01.2021	CLP	4.140.665	5.263	0	(564)	(0,02)
	01.2021	PEN	23.041	6.444	74	0	0,00
	01.2021	\$	1.561	BRL 8.113	1	0	0,00
	01.2021		1.139	RUB 85.767	19	0	0,00
	02.2021	PEN	149.111	\$ 41.438	206	0	0,01
FBF	01.2021	BRL	33.000	6.312	0	(41)	0,00
	01.2021	\$	6.422	BRL 33.000	1	(70)	0,00
GLM	01.2021	BRL	63.311	\$ 12.183	0	(6)	0,00
	01.2021	CLP	15.572.453	21.211	0	(705)	(0,02)
	01.2021	DOP	89.829	1.519	0	(21)	0,00
	01.2021	MXN	362.042	17.339	0	(797)	(0,03)
	01.2021	PEN	8.180	2.283	21	0	0,00
	01.2021	\$	12.187	BRL 63.311	135	(133)	0,00
	01.2021		20.375	CLP 14.791.689	441	0	0,02
	01.2021		10.658	COP 39.384.883	856	0	0,03
	01.2021		4.388	HUF 1.305.689	19	(2)	0,00
	01.2021		24.406	MXN 488.593	134	(66)	0,00
	01.2021		7.305	RUB 550.697	132	0	0,00
	01.2021		1.440	TRY 10.818	12	0	0,00
	02.2021	DOP	244.241	\$ 4.141	0	(45)	0,00
	02.2021	RUB	63.024	827	0	(22)	0,00
	02.2021	\$	6.594	HKD 51.148	3	0	0,00
	02.2021		10.250	RON 41.922	262	0	0,01
	02.2021		6.005	RUB 446.748	25	(13)	0,00
	03.2021	CNH	537.899	\$ 81.514	0	(888)	(0,03)
	03.2021	DOP	1.389.810	23.374	0	(308)	(0,01)
	03.2021	IDR	58.214.419	4.059	0	(102)	0,00
	03.2021	MXN	85.300	4.198	0	(44)	0,00
	03.2021	PEN	5.530	1.543	14	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	03.2021	THB	195.485	\$ 6.452	\$ 0	\$ (74)	0,00	
	03.2021	\$	73.021	THB 2.222.020	1.155	0	1.155	0,04
	04.2021	DOP	273.679	\$ 4.602	0	(39)	(39)	0,00
	04.2021	\$	41.267	COP 151.670.687	2.934	0	2.934	0,10
	05.2021	DOP	478.965	\$ 8.058	0	(37)	(37)	0,00
	06.2021		1.412.578	23.876	126	0	126	0,00
HUS	01.2021	BRL	528.618	103.977	2.205	0	2.205	0,08
	01.2021	£	13.130	17.560	0	(388)	(388)	(0,01)
	01.2021	¥	1.893	18	0	0	0	0,00
	01.2021	RUB	93.236	1.235	0	(24)	(24)	0,00
	01.2021	\$	101.841	BRL 528.618	45	(115)	(70)	0,00
	01.2021		1.250	CLP 920.366	45	0	45	0,00
	01.2021		22.095	COP 75.476.436	0	(29)	(29)	0,00
	01.2021		6.568	HUF 1.984.064	125	0	125	0,00
	01.2021		24.102	MXN 493.360	611	0	611	0,02
	01.2021		22.792	PLN 86.755	494	0	494	0,02
	01.2021		40.477	ZAR 633.080	2.514	0	2.514	0,09
	01.2021	ZAR	39.264	\$ 2.688	16	0	16	0,00
	02.2021	CAD	436	333	0	(9)	(9)	0,00
	02.2021	HKD	51.148	6.573	0	(25)	(25)	0,00
	02.2021	ILS	36.458	10.570	0	(792)	(792)	(0,03)
	02.2021	RUB	41.975	561	0	(4)	(4)	0,00
	02.2021	\$	103.918	BRL 528.618	0	(2.179)	(2.179)	(0,08)
	02.2021		1.317	CHF 1.198	41	0	41	0,00
	02.2021		328	ILS 1.067	4	0	4	0,00
	02.2021		1.146	RUB 84.756	1	(6)	(5)	0,00
	02.2021		136	UYU 5.790	0	0	0	0,00
	03.2021	CNH	321.258	\$ 48.338	0	(876)	(876)	(0,03)
	03.2021	COP	75.476.436	22.045	4	0	4	0,00
	03.2021	EGP	141.000	8.509	0	(317)	(317)	(0,01)
	03.2021	IDR	155.368.950	10.846	0	(259)	(259)	(0,01)
	03.2021	MYR	33.079	8.120	0	(117)	(117)	0,00
	03.2021	THB	700.703	23.151	0	(240)	(240)	(0,01)
	03.2021	\$	25.504	CNH 168.430	298	0	298	0,01
	03.2021		4.255	CNY 27.980	24	0	24	0,00
	03.2021		3.934	IDR 55.972.952	67	0	67	0,00
	03.2021		589	UYU 25.482	8	0	8	0,00
	04.2021	COP	12.077.068	\$ 3.000	0	(520)	(520)	(0,02)
	04.2021	EGP	52.021	3.172	0	(47)	(47)	0,00
	04.2021	\$	2.955	PEN 10.678	0	(3)	(3)	0,00
IND	01.2022	BRL	8.217	\$ 1.430	0	(119)	(119)	0,00
	01.2021	\$	4.094	PLN 15.067	0	(50)	(50)	0,00
	01.2021		330	ZAR 5.092	16	0	16	0,00
	02.2021		8.384	CZK 184.899	232	0	232	0,01
	02.2021		1.521	RON 6.091	7	0	7	0,00
JPM	03.2021		4.372	THB 131.982	34	0	34	0,00
	01.2021	BRL	34.427	\$ 6.519	0	(109)	(109)	0,00
	01.2021	CLP	9.620.423	12.209	0	(1.329)	(1.329)	(0,05)
	01.2021	€	8	9	0	0	0	0,00
	01.2021	£	23	31	0	0	0	0,00
	01.2021	RSD	530.123	€ 4.505	8	0	8	0,00
	01.2021	\$	6.709	BRL 34.427	0	(81)	(81)	0,00
	01.2021		25.392	CLP 19.013.683	1.367	0	1.367	0,05
	01.2021		10.985	MXN 221.435	107	0	107	0,00
	01.2021		1.349	PEN 4.835	0	(12)	(12)	0,00
	01.2021		4.264	PLN 16.233	93	0	93	0,00
	01.2021		15.823	TRY 124.593	921	0	921	0,03
	01.2021		2.702	UYU 116.224	41	0	41	0,00
	01.2021		4.965	ZAR 76.551	234	0	234	0,01
	01.2021	ZAR	394.243	\$ 26.181	31	(622)	(591)	(0,02)
	02.2021	RUB	445.466	5.975	0	(24)	(24)	0,00
	02.2021	UAH	75.279	2.571	0	(57)	(57)	0,00
	02.2021	\$	14.516	CZK 326.351	691	0	691	0,02
	03.2021	EGP	20.452	\$ 1.183	0	(93)	(93)	0,00
	03.2021	\$	8.221	IDR 117.901.610	206	0	206	0,01
	04.2021	KZT	2.429.100	\$ 5.398	0	(266)	(266)	(0,01)
	10.2021	KES	65.649	554	0	(10)	(10)	0,00
	01.2022	BRL	5.615	961	0	(97)	(97)	0,00
MYI	01.2021	HUF	64.903	213	0	(6)	(6)	0,00
	01.2021	\$	5.188	CLP 3.975.616	407	0	407	0,01
	01.2021		2.631	COP 9.004.887	2	0	2	0,00
	01.2021		3.099	HUF 908.323	0	(35)	(35)	0,00
	01.2021		11.343	PEN 40.615	0	(114)	(114)	0,00
	01.2021		19.035	PLN 71.350	210	(94)	116	0,00
	01.2021		494	TRY 4.314	82	0	82	0,00
	01.2021		2.313	ZAR 34.050	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	ZAR	4.523	\$ 302	0	(6)	(6)	0,00
	02.2021	\$	10.873	CZK 242.049	406	0	406	0,01
	02.2021		249	RUB 18.350	0	(2)	(2)	0,00
	03.2021	IDR	126.439.291	\$ 8.831	0	(206)	(206)	(0,01)
	03.2021	\$	43.714	CNH 289.194	588	0	588	0,02
	03.2021		1.186	EGP 20.452	90	0	90	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
	03.2021	\$ 13.600	IDR 192.759.198	\$ 181	\$ (4)	\$ 177	0,01
	03.2021	4.410	THB 134.038	65	0	65	0,00
	10.2021	739	TRY 7.387	144	0	144	0,01
NGF	03.2030	IDR 252.540.875	\$ 10.735	0	(2.178)	(2.178)	(0,08)
RYL	01.2021	\$ 5.542	MXN 118.841	411	0	411	0,01
	01.2021	4.975	ZAR 77.169	265	0	265	0,01
	03.2021	7.500	THB 226.568	63	0	63	0,00
SCX	01.2021	BRL 39.001	\$ 7.505	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	HUF 2.633.226	8.614	0	(270)	(270)	(0,01)
	01.2021	\$ 7.393	BRL 39.001	151	(35)	116	0,00
	01.2021	2.675	CLP 2.024.413	174	0	174	0,01
	01.2021	3.595	COP 13.120.420	241	0	241	0,01
	01.2021	5.731	ZAR 84.204	0	(13)	(13)	0,00
	03.2021	CNY 11.362	\$ 1.718	0	(19)	(19)	0,00
	03.2021	IDR 551.816.707	38.473	0	(967)	(967)	(0,03)
	03.2021	\$ 12.677	IDR 181.205.038	274	0	274	0,01
	03.2021	9.255	MYR 37.674	126	0	126	0,00
	10.2021	KES 320.661	\$ 2.706	0	(45)	(45)	0,00
	01.2022	BRL 34.263	5.863	0	(593)	(593)	(0,02)
	03.2030	IDR 239.680.000	10.700	0	(1.555)	(1.555)	(0,05)
SOG	03.2021	109.422.747	7.629	0	(192)	(192)	(0,01)
	03.2021	\$ 3.792	CNH 24.885	20	0	20	0,00
	03.2021	5.939	IDR 85.224.650	152	0	152	0,01
SSB	01.2021	HUF 5.214.122	\$ 17.165	0	(426)	(426)	(0,02)
	01.2021	MXN 114.822	5.685	0	(66)	(66)	0,00
	01.2021	\$ 4.952	PLN 18.647	53	0	53	0,00
	01.2021	1.975	TRY 15.152	62	0	62	0,00
	03.2021	4.522	MYR 18.450	72	0	72	0,00
TOR	01.2021	BRL 435.291	\$ 83.763	0	(40)	(40)	0,00
	01.2021	¥ 8.123	78	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 81.838	BRL 435.291	1.966	0	1.966	0,07
	01.2021	4.812	MXN 97.216	58	0	58	0,00
	03.2021	3.629	CNY 23.828	15	0	15	0,00
UAG	01.2021	BRL 110.210	\$ 21.783	566	0	566	0,02
	01.2021	TRY 4.314	499	0	(77)	(77)	0,00
	01.2021	\$ 21.208	BRL 110.210	10	0	10	0,00
	01.2021	29.334	MXN 594.494	445	0	445	0,02
	02.2021	CZK 116.293	\$ 5.274	0	(145)	(145)	(0,01)
	02.2021	€ 24.461	28.967	0	(994)	(994)	(0,03)
	02.2021	RUB 138.747	1.823	0	(46)	(46)	0,00
	02.2021	\$ 12.319	CZK 270.971	307	0	307	0,01
	02.2021	1.814	RUB 134.239	1	(8)	(7)	0,00
	03.2021	CNH 93.199	\$ 14.216	0	(61)	(61)	0,00
	10.2021	TRY 7.387	748	0	(134)	(134)	0,00
				\$ 56.139	\$ (34.587)	\$ 21.552	0,76
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 55.176	1,94
Summe Anlagen						\$ 3.482.362	122,22
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (633.078)	(22,22)
Nettovermögen						\$ 2.849.284	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	3,231 %	14.10.2024	18.10.2019	\$ 5.143	\$ 5.146	0,18
QNB Finance Ltd.	7,900	05.07.2024	26.06.2019	12.585	13.674	0,48
				\$ 17.728	\$ 18.820	0,66

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 518.537 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 10.606 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 10.216 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 10,628 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	0	104.819	0	104.819
<b>Summen</b>	<b>\$ 204.721</b>	<b>\$ 2.988.471</b>	<b>\$ 289.170</b>	<b>\$ 3.482.362</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der wesentlichen nicht beobachtbaren Inputfaktoren, die bei der marktgerechten Bewertung der in Stufe 3 der Zeitwerthierarchie eingeordneten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten verwendet wurden:

Kategorie und Unterkategorie	Marktwert zum 31. Dez. 2020	Bewertungstechnik	Nicht beobachtbare Daten	Eingangswert(e) (% Sofern nicht anders angegeben)
<b>Übertragbare Wertpapiere</b>				
Unternehmensanleihen und Wechsel	\$ 46.644	Indikative Marktquotierung	Broker-Quotierung	\$ 106,26
	0	Proxy Pricing	Basispreis	0
	34	Proxy Pricing	Basispreis	3,07
	6.122	Proxy Pricing	Basispreis	113,30
	227.674	Referenzinstrument	Rendite	4,76-5,77
Kreditbeteiligungen und -abtretung	8.696	Proxy Pricing	Basispreis	\$ 100,00
<b>Summen</b>	<b>\$ 289.170</b>			

Die folgende Tabelle zeigt die Sensitivität der Änderungen des Marktwerts der als Anlagen der Stufe 3 eingestuft Wertpapieranlagen gegenüber einer nach vernünftigen Ermessen möglichen Änderung des Marktwerts, sollte sich der Markt um 10 % nach oben oder unten bewegt haben, unter der Annahme, dass alle anderen Variablen konstant bleiben:

Kategorie und Unterkategorie	31. Dez. 2020 Sensitivität gegenüber Änderungen des Marktwerts der Anlagen Zunahme/(Abnahme)
<b>Übertragbare Wertpapiere</b>	
Stammaktien	\$ 0
Unternehmensanleihen und Wechsel	28.047
Kreditbeteiligungen und -abtretung	870
<b>Summen</b>	<b>\$ 28.917</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 3.512.448	\$ 80.396	\$ 3.592.844
Investmentfonds	189.274	0	0	189.274
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	38	75.403	0	75.441
<b>Summen</b>	<b>\$ 189.312</b>	<b>\$ 3.587.851</b>	<b>\$ 80.396</b>	<b>\$ 3.857.559</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der wesentlichen nicht beobachtbaren Inputfaktoren, die bei der marktgerechten Bewertung der in Stufe 3 der Zeitwerthierarchie eingeordneten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten verwendet wurden:

Kategorie und Unterkategorie	Marktwert zum 31. Dez. 2019	Bewertungstechnik	nicht beobachtbare Daten	Eingangswert(e) (% Sofern nicht anders angegeben)
<b>Übertragbare Wertpapiere</b>				
Stammaktien	\$ 0	Sonstige Bewertungstechniken	—	—
Unternehmensanleihen und Wechsel	445	Sonstige Bewertungstechniken	—	—
	40.032	Proxy Pricing	Basispreis	\$ 100,00-104,15
	0	Proxy Pricing	Basispreis	MXN 0
Kreditbeteiligungen und -abtretung	9.349	Proxy Pricing	Basispreis	\$ 100,01
	30.000	Drittanbieter	Broker-Quotierung	100,00
Kurzfristige Schuldtitel	570	Sonstige Bewertungstechniken	—	—
<b>Summen</b>	<b>\$ 80.396</b>			

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Die folgende Tabelle zeigt die Sensitivität der Änderungen des Marktwerts der als Anlagen der Stufe 3 eingestuften Wertpapieranlagen gegenüber einer nach vernünftigem Ermessen möglichen Änderung des Marktwerts, sollte sich der Markt um 10 % nach oben oder unten bewegt haben, unter der Annahme, dass alle anderen Variablen konstant bleiben:

Kategorie und Unterkategorie	31. Dez. 2019	
	Sensitivität gegenüber Änderungen des Marktwerts der Anlagen Zunahme/(Abnahme)	
<b>Übertragbare Wertpapiere</b>		
Stammaktien	\$	0
Unternehmensanleihen und Wechsel		4.048
Kreditbeteiligungen und -abtretung		3.935
Kurzfristige Schuldtitel		57
<b>Summen</b>	<b>\$</b>	<b>8.040</b>

(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.

Level 3 Roll-forward	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Marktwert zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 80.396	\$ 24.807
Käufe während des Geschäftsjahres	113.110	60.498
Verkäufe während des Geschäftsjahres	(39.778)	(6.906)
Umschichtungen in	125.995	-
Umschichtungen aus	(345)	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	(469)	94
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme)	10.261	1.903
<b>Marktwert am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>\$ 289.170</b>	<b>\$ 80.396</b>

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	0,700 %	09.01.2020	TBD <sup>(1)</sup>	HUF (7.397.916)	\$ (25.218)	(0,89)
	0,300	07.09.2020	TBD <sup>(1)</sup>	CZK (148.891)	(6.943)	(0,24)
	0,300	14.09.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(612.766)	(28.574)	(1,00)
	0,300	29.09.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(441.639)	(20.594)	(0,72)
	0,300	06.10.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(121.730)	(5.675)	(0,20)
	0,700	05.08.2020	TBD <sup>(1)</sup>	HUF (2.441.731)	(8.274)	(0,29)
	7,250	15.07.2020	TBD <sup>(1)</sup>	ZAR (463.177)	(32.141)	(1,13)
	7,250	07.09.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(258.355)	(17.878)	(0,63)
	7,250	27.10.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.094.428)	(75.039)	(2,63)
	7,250	19.11.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(235.442)	(16.116)	(0,57)
JML	0,350	17.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	CZK (214.039)	(9.974)	(0,35)
	0,450	05.10.2020	01.10.2022	\$ (108.712)	(108.830)	(3,82)
	0,450	26.10.2020	21.10.2022	(23.977)	(23.997)	(0,84)
	0,500	05.10.2020	01.10.2022	(3.119)	(3.123)	(0,11)
	4,150	21.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	MXN (349.095)	(17.542)	(0,62)
SCX	4,500	21.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(593.114)	(29.808)	(1,04)
	5,900	17.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	ZAR (64.255)	(4.383)	(0,15)
	0,500	30.07.2020	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (37.873)	(36.358)	(1,28)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>				<b>\$ (470.467)</b>	<b>(16,51)</b>	

(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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 1.605	\$ (1.810)	\$ (205)
BPS	(51)	0	(51)
BRC	3.268	(3.440)	(172)
BSH	941	0	941
BSS	(4.557)	3.740	(817)
CBK	14.805	(16.406)	(1.601)
CKL	572	0	572
DUB	1.455	(2.470)	(1.015)
FBF	160	(50)	110
GLM	27.322	(26.990)	332
GST	6.779	(6.280)	499
HUS	4.670	(5.282)	(612)
IND	239	(310)	(71)
JPM	1.396	(1.339)	57
MYC	(1.177)	836	(341)
MYI	1.875	(1.740)	135
NGF	(2.128)	1.820	(308)
RYL	739	(630)	109
SCX	(4.385)	3.658	(727)
SOG	(20)	0	(20)
SSB	(305)	270	(35)
TOR	1.998	(2.240)	(242)
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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	62,24	71,00
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	46,19	58,61
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,93	k. A.
Investmentfonds	7,18	6,83
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,74	1,30
Freiverkehrsfinanzderivate	1,94	1,43
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(16,51)	(26,72)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Argentinien	0,35	0,81
Österreich	0,02	k. A.
Brasilien	5,62	6,34
Cayman-Inseln	0,56	1,24
Chile	2,77	4,17
China	11,71	1,84
Kolumbien	6,75	7,91
Costa Rica	k. A.	0,09
Tschechische Republik	2,84	1,06
Dominikanische Republik	2,94	1,81
Ägypten	1,51	0,06
El Salvador	0,00	0,09
Frankreich	1,09	1,02
Deutschland	1,74	2,94
Ghana	0,09	0,36
Hongkong	0,31	0,65
Ungarn	5,45	7,55
Indien	k. A.	0,33
Indonesien	0,93	1,13
Irland	0,73	1,21
Italien	0,35	0,19
Japan	0,34	1,22
Kasachstan	0,21	0,21
Luxemburg	0,01	0,24
Malaysia	6,23	3,52
Mauritius	k. A.	0,28
Mexiko	5,39	6,35
Mongolei	k. A.	0,13
Niederlande	0,05	0,19
Nigeria	k. A.	0,11
Oman	k. A.	0,25
Peru	5,67	6,21
Philippinen	0,59	0,39
Polen	4,99	8,87
Katar	3,76	1,57
Rumänien	2,42	0,69
Russland	6,83	8,86
Senegal	k. A.	0,34
Serbien	0,19	k. A.
Südafrika	11,73	10,07
Südkorea	0,02	1,26
Spanien	0,13	0,09
Supranational	0,62	1,09
Schweiz	0,03	k. A.
Thailand	5,72	4,07
Türkei	0,80	4,75
Ukraine	0,30	0,75
Vereinigte Arabische Emirate	1,02	0,94
Großbritannien	1,32	2,94
Vereinigte Staaten	5,96	20,13
Uruguay	0,09	0,05
Kurzfristige Instrumente	1,18	3,24
Investmentfonds	7,18	6,83
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	k. A.	0,00
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
Zinsswaps	1,74	1,30
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Devisenoptionen	0,10	0,01
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Devisenoptionen	(0,06)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,01	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,02
Cross-Currency Swaps	0,37	0,23
Zinsswaps	0,74	0,72
Volatilitätswaps	0,01	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,76	0,46
Sonstige Aktiva und Passiva	(22,22)	(39,17)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets 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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>Republic of Belarus Ministry of Finance</b>				<b>Geely Automobile Holdings Ltd.</b>			
<b>ANGOLA</b>				<b>5,875 % fällig am 24.02.2026</b>				<b>4,000 % fällig am 09.12.2024</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Summe Belarus</b>				<b>(e)</b>			
Angolan Government International Bond								Interoceanica Finance Ltd.			
8,000 % fällig am 26.11.2029	\$	18.662	0,36					0,000 % fällig am 15.05.2030	\$	2.200	0,04
8,250 % fällig am 09.05.2028		13.30	0,24					(c)		8.900	0,15
9,125 % fällig am 26.11.2049		11.00	0,19					Kaisa Group Holdings Ltd.		10.300	0,19
9,375 % fällig am 08.05.2048		5.40	0,10					9,375 % fällig am 30.06.2024		1.100	0,02
9,500 % fällig am 12.11.2025		15.60	0,31					11,250 % fällig am 09.04.2022		200	0,00
Summe Angola		63.000	1,20					11,500 % fällig am 30.01.2023		4.700	0,10
								11,950 % fällig am 12.11.2023			
<b>ARGENTINIEN</b>				<b>BERMUDAS</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>			
Argentina Government International Bond				Banco BTG Pactual S.A.				2,894 % fällig am 20.04.2022			
0,125 % fällig am 09.07.2030		35.28	0,27	4,500 % fällig am 10.01.2025	10.900	11.663	0,22	Lima Metro Line Finance Ltd.		400	0,01
0,125 % fällig am 09.07.2035		124.36	0,87	Banco do Brasil S.A.				4,350 % fällig am 05.04.2036		1.189	0,03
0,125 % fällig am 09.01.2038		32.85	0,26	3,875 % fällig am 10.10.2022	1.000	1.043	0,02	5,875 % fällig am 05.07.2034			
0,125 % fällig am 09.07.2041		79.05	0,57	Banco Votorantim S.A.				MAF Sukuk Ltd.		15.300	0,33
0,125 % fällig am 09.07.2046		2.67	0,02	4,000 % fällig am 24.09.2022	600	623	0,01	4,638 % fällig am 14.05.2029		7.800	0,15
1,000 % fällig am 09.07.2029		6.43	0,05	4,500 % fällig am 24.09.2024	1.100	1.165	0,02	Meituan			
Provincia de Cordoba				Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais				3,050 % fällig am 28.10.2030			
7,125 % fällig am 10.06.2021		2.25	0,03	5,333 % fällig am 15.02.2028	39.512	43.019	0,82	Melco Resorts Finance Ltd.		750	0,01
Provincia de Entre Rios Argentina				BRF S.A.				5,250 % fällig am 26.04.2026		7.200	0,15
8,750 % fällig am 08.02.2025 ^		2.55	0,03	5,750 % fällig am 21.09.2050	12.400	13.819	0,26	5,750 % fällig am 21.07.2028			
Provincia de la Rioja				Centrais Eletricas Brasileiras S.A.				MGM China Holdings Ltd.		6.000	0,12
9,750 % fällig am 24.02.2025 ^		5.95	0,06	4,625 % fällig am 04.02.2030	3.600	3.825	0,07	5,875 % fällig am 15.05.2026			
Provincia de Neuquen				CSN Inova Ventures				Odebrecht Drilling Norbe Ltd.		2.287	0,04
2,500 % fällig am 27.04.2030 ^		2.21	0,03	6,750 % fällig am 28.01.2028	17.900	19.404	0,37	6,350 % fällig am 01.12.2021 ^			
Summe Argentinien		115.293	2,19	CSN Resources S.A.				Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)		12.005	0,06
				7,625 % fällig am 17.04.2026	300	323	0,01	7,350 % fällig am 01.12.2026			
<b>ARMENIEN</b>				<b>Globo Comunicacao e Participacoes S.A.</b>				<b>Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>4,875 % fällig am 22.01.2030</b>				<b>6,720 % fällig am 01.12.2022 ^</b>			
Republic of Armenia Government International Bond				Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				Sands China Ltd.		5.400	0,12
3,950 % fällig am 26.09.2029		2.60	0,05	0,000 % fällig am 01.02.2021	14.563	95	0,00	5,400 % fällig am 08.08.2028			
				(c)(e)				SPARC EM SPC Panama Metro Line SP		2.924	0,05
<b>ÖSTERREICH</b>				<b>Petrobras Global Finance BV</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>			
<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>6,850 % fällig am 05.06.2115</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>			
Sappi Papier Holding GmbH				8,750 % fällig am 23.05.2026	5.432	6.784	0,13	Sunac China Holdings Ltd.		8.500	0,17
3,125 % fällig am 15.04.2026	€	3.80	0,09	Rede D'or Finance SARL				6,500 % fällig am 10.01.2025		4.700	0,09
				4,500 % fällig am 22.01.2030	2.500	2.611	0,05	7,000 % fällig am 09.07.2025		500	0,01
<b>ASERBAIDSCHAN</b>				<b>Rumo Luxembourg SARL</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>			
<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>				<b>5,250 % fällig am 10.01.2028</b>				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>			
Southern Gas Corridor CJSC				Suzano Austria GmbH				Tencent Holdings Ltd.		2.500	0,05
6,875 % fällig am 24.03.2026	\$	34.40	0,80	7,000 % fällig am 16.03.2047	1.000	1.335	0,03	3,240 % fällig am 03.06.2050		2.500	0,05
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic				Vale Overseas Ltd.				3,290 % fällig am 03.06.2060		300	0,01
4,750 % fällig am 13.03.2023		1.00	0,02	6,250 % fällig am 10.08.2026	5.400	6.704	0,13	3,975 % fällig am 11.04.2029			
				6,875 % fällig am 21.11.2036	3.280	4.815	0,09	Wynn Macau Ltd.		1.000	0,02
				6,875 % fällig am 10.11.2039	2.500	3.728	0,07	5,500 % fällig am 15.01.2026			
				Vale S.A.				Summe Cayman Inseln		134.394	2,56
				3,750 % fällig am 10.01.2023	€	1.300	0,03			134.811	2,56
				Summe Brasilien							
						129.531	2,46				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>CHILE</b>			
Azerbaijan Government International Bond				Brazil Government International Bond				<b>Unternehmensanleihen und Wechsel</b>			
3,500 % fällig am 01.09.2032		3.00	0,06	2,875 % fällig am 06.06.2025	\$	15.200	15,846	0,30	Banco del Estado de Chile		
4,750 % fällig am 18.03.2024		4.40	0,09	3,875 % fällig am 12.06.2030		19.000	20,078	0,38	2,704 % fällig am 09.01.2025	4.300	4,550
				4,750 % fällig am 14.01.2050		22.511	24,123	0,46	Banco Santander Chile		
				5,000 % fällig am 27.01.2045		4.378	4,879	0,09	2,700 % fällig am 10.01.2025	5.400	5,724
				6,000 % fällig am 07.04.2026		200	241	0,01	Celulosa Arauco y Constitucion S.A.		
				Summe Brasilien			65.167	1,24	4,500 % fällig am 01.08.2024	1.700	1,876
							194.698	3,70	Corp. Nacional del Cobre de Chile		
									3,150 % fällig am 14.01.2030	2.700	2,950
									3,625 % fällig am 01.08.2027	5.900	6,598
									3,700 % fällig am 30.01.2050	3.900	4,305
									4,250 % fällig am 17.07.2042	12.300	14,449
									4,500 % fällig am 01.08.2047	1.200	1,480
									4,875 % fällig am 04.11.2044	10.100	12,928
									6,150 % fällig am 24.10.2036	1.000	1,396
									Embotelladora Andina S.A.		
									3,950 % fällig am 21.01.2050	3.900	4,388
									Empresa de los Ferrocarriles del Estado		
									3,068 % fällig am 18.08.2050	1.700	1,661
									Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.		
									3,650 % fällig am 07.05.2030	1.600	1,799
									4,700 % fällig am 07.05.2050	9.770	12,311
									Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A.		
									4,875 % fällig am 30.10.2024	10.200	11,029
									GNL Quintero S.A.		
									4,634 % fällig am 31.07.2029	9.500	10,597
									Latam Airlines Pass-Through Trust		
									4,200 % fällig am 15.08.2029	11.663	10,876



## 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
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>KASACHSTAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Airport Authority Hong Kong				Indonesia Government International Bond				Development Bank of Kazakhstan JSC			
2,100 % fällig am 08.03.2026 (e)	\$ 7.500	\$ 7.630	0,14	4,200 % fällig am 15.10.2050	\$ 1.800	\$ 2.156	0,04	4,125 % fällig am 10.12.2022	\$ 1.100	\$ 1.158	0,02
2,400 % fällig am 08.03.2028 (e)	12.100	12.388	0,24	4,350 % fällig am 08.01.2027	1.000	1.166	0,02	KazMunayGas National Co. JSC			
		20.018	0,38	4,350 % fällig am 11.01.2048	9.500	11.371	0,22	4,750 % fällig am 24.04.2025	700	800	0,02
Summe Hongkong		38.605	0,73	4,450 % fällig am 15.04.2070	10.700	13.169	0,25	4,750 % fällig am 19.04.2027	10.800	12.556	0,24
<b>UNGARN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Hungary Government International Bond				5,125 % fällig am 15.01.2045	9.450	12.231	0,23	5,750 % fällig am 19.04.2047	1.300	1.747	0,03
0,500 % fällig am 18.11.2030	€ 800	973	0,02	5,250 % fällig am 17.01.2042	500	650	0,01	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.			
1,500 % fällig am 17.11.2050	12.300	15.275	0,29	5,350 % fällig am 11.02.2049	200	276	0,01	3,250 % fällig am 15.08.2030	31.700	33.633	0,64
1,750 % fällig am 05.06.2035	9.500	12.908	0,24	6,625 % fällig am 17.02.2037	5.500	7.848	0,15	Summe Kasachstan		69.025	1,31
5,375 % fällig am 25.03.2024	\$ 5.982	6.835	0,13	6,750 % fällig am 15.01.2044	19.750	30.465	0,58	<b>KENIA STAATSEMISSIONEN</b>			
5,750 % fällig am 22.11.2023	5.000	5.709	0,11	7,750 % fällig am 17.01.2038	1.000	1.575	0,03	Kenya Government International Bond			
Summe Ungarn		41.700	0,79	8,500 % fällig am 12.10.2035	11.500	18.838	0,36	8,000 % fällig am 22.05.2032	5.300	6.189	0,12
<b>INDIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA</b>				<b>LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Adani Electricity Mumbai Ltd.				2,800 % fällig am 23.06.2030	5.400	5.734	0,11	Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK)			
3,949 % fällig am 12.02.2030	7.000	7.443	0,14	3,800 % fällig am 23.06.2050	1.000	1.106	0,02	10,000 % fällig am 09.11.2024	10.915	2.804	0,05
Adani Transmission Ltd.				4,400 % fällig am 01.03.2028	5.000	5.865	0,11	^ (a)			
4,250 % fällig am 21.05.2036	2.702	2.870	0,05	4,450 % fällig am 20.02.2029	15.000	17.752	0,34	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.			
Indian Railway Finance Corp. Ltd.				4,550 % fällig am 29.03.2026	2.000	2.318	0,04	4,375 % fällig am 19.09.2022	2.400	2.519	0,05
3,249 % fällig am 13.02.2030	3.400	3.627	0,07	Summe Indonesien		134.956	2,57	6,000 % fällig am 27.11.2023	5.100	5.708	0,11
3,950 % fällig am 13.02.2050	2.200	2.227	0,04	<b>IRLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.			
Muthoot Finance Ltd.				Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				4,950 % fällig am 19.07.2022	3.000	3.168	0,06
4,400 % fällig am 02.09.2023	5.400	5.513	0,11	5,950 % fällig am 15.04.2030 (g)	6.800	7.070	0,13	5,150 % fällig am 11.02.2026	11.900	13.591	0,26
NTPC Ltd.				Russian Railways Via RZD Capital PLC				6,510 % fällig am 07.03.2022	14.620	15.538	0,29
3,750 % fällig am 03.04.2024	2.000	2.119	0,04	7,487 % fällig am 25.03.2031	5.000	9.372	0,18	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
Shriram Transport Finance Co. Ltd.				Vnesheconombank Via VEB Finance PLC				5,250 % fällig am 23.05.2023 (g)	300	321	0,01
5,100 % fällig am 16.07.2023	6.600	6.798	0,13	5,942 % fällig am 21.11.2023	5.100	5.680	0,11	5,717 % fällig am 16.06.2021	400	409	0,01
5,700 % fällig am 27.02.2022	5.000	5.087	0,10	Summe Irland		22.122	0,42	6,125 % fällig am 07.02.2022	16.465	17.357	0,33
State Bank of India				<b>ISRAEL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Unigel Luxembourg S.A.			
4,000 % fällig am 24.01.2022	3.300	3.397	0,07	Delek & Avner Tamar Bond Ltd.				8,750 % fällig am 01.10.2026	7.900	8.532	0,16
		39.081	0,75	5,082 % fällig am 30.12.2023	900	937	0,02	Summe Luxemburg		69.947	1,33
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>MALAYSIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Export-Import Bank of India				5,412 % fällig am 30.12.2025	6.160	6.480	0,12	Axiata SPV2 Bhd.			
3,250 % fällig am 15.01.2030	5.300	5.683	0,11	Israel Electric Corp. Ltd.				2,163 % fällig am 19.08.2030	2.300	2.327	0,04
3,375 % fällig am 05.08.2026	1.100	1.192	0,02	4,250 % fällig am 14.08.2028	5.400	6.251	0,12	Axiata Spv5 Labuan Ltd.			
3,875 % fällig am 12.03.2024	4.500	4.831	0,09	Leviathan Bond Ltd.				3,064 % fällig am 19.08.2050	6.100	6.140	0,12
		11.706	0,22	6,500 % fällig am 30.06.2027	8.400	9.492	0,18	Malaysia Sukuk Global Bhd.			
Summe Indien		50.787	0,97	Summe Israel		23.160	0,44	3,179 % fällig am 27.04.2026	250	280	0,01
<b>INDONESIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>MARSHALLINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT				Israel Government International Bond				Nakilat, Inc.			
5,450 % fällig am 15.05.2030	12.700	15.316	0,29	3,375 % fällig am 15.01.2050 (i)	9.400	10.428	0,20	6,267 % fällig am 31.12.2033	517	651	0,01
LLPL Capital Pte. Ltd.				3,800 % fällig am 13.05.2060 (i)	12.500	14.882	0,28	<b>MAURITIUS UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
6,875 % fällig am 04.02.2039	1.033	1.222	0,02	Summe Indonesien		48.470	0,92	Greenko Solar Mauritius Ltd.			
Pelabuhan Indonesia Persero PT				<b>ELFENBEINKÜSTE STAATSEMISSIONEN</b>				5,950 % fällig am 29.07.2026	3.700	4.015	0,08
4,500 % fällig am 02.05.2023	20.500	21.865	0,42	Ivory Coast Government International Bond				<b>MEXIKO AKTIEN</b>			
4,875 % fällig am 01.10.2024	3.100	3.429	0,07	4,875 % fällig am 30.01.2032	€ 9.200	11.585	0,22	Hipotecaria Su Casita S.A. (b)	39.443	0	0,00
Pelabuhan Indonesia PT				5,250 % fällig am 22.03.2030	€ 25.950	34.136	0,65	<b>STAMMAKTIONEN</b>			
4,250 % fällig am 05.05.2025	8.400	9.198	0,17	5,750 % fällig am 31.12.2032	\$ 16.482	16.679	0,32	<b>STAMMAKTIONEN</b>			
5,375 % fällig am 05.05.2045	3.693	4.469	0,08	5,875 % fällig am 17.10.2031	€ 4.800	6.500	0,12	<b>STAMMAKTIONEN</b>			
Pertamina Persero PT				Summe Elfenbeinküste		68.900	1,31	<b>STAMMAKTIONEN</b>			
4,175 % fällig am 21.01.2050	5.900	6.398	0,12	<b>JAMAICA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAMMAKTIONEN</b>			
4,875 % fällig am 03.05.2022	2.300	2.422	0,05	TransJamaican Highway Ltd.				<b>STAMMAKTIONEN</b>			
5,625 % fällig am 20.05.2043	3.000	3.720	0,07	5,750 % fällig am 10.10.2036	\$ 3.900	4.019	0,08	<b>STAMMAKTIONEN</b>			
6,000 % fällig am 03.05.2042	15.600	20.086	0,38	<b>JORDANIEN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAMMAKTIONEN</b>			
6,450 % fällig am 30.05.2044	12.900	17.609	0,33	Jordan Government International Bond				<b>STAMMAKTIONEN</b>			
6,500 % fällig am 07.11.2048	9.500	13.396	0,25	5,750 % fällig am 31.01.2027	1.500	1.658	0,03	<b>STAMMAKTIONEN</b>			
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				5,850 % fällig am 07.07.2030	18.000	19.904	0,38	<b>STAMMAKTIONEN</b>			
4,000 % fällig am 30.06.2050	21.300	21.940	0,42	6,125 % fällig am 29.01.2026	3.300	3.680	0,07	<b>STAMMAKTIONEN</b>			
4,125 % fällig am 15.05.2027	1.300	1.442	0,03	7,375 % fällig am 10.10.2047	2.300	2.689	0,05	<b>STAMMAKTIONEN</b>			
4,375 % fällig am 05.02.2050	5.400	5.845	0,11	Summe Jordanien		27.931	0,53	<b>STAMMAKTIONEN</b>			
5,250 % fällig am 24.10.2042	300	355	0,01	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
6,150 % fällig am 21.05.2048	700	917	0,02	Kazakhstan Government International Bond				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
6,250 % fällig am 25.01.2049	7.800	10.452	0,20	1,550 % fällig am 09.11.2023	€ 400	508	0,01	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
		160.081	3,04	2,375 % fällig am 09.11.2028	1.000	1.407	0,03	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				4,875 % fällig am 14.10.2044	\$ 6.600	8.969	0,17	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				6,500 % fällig am 21.07.2045	5.100	8.247	0,15	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				Summe Kasachstan		19.131	0,36	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				Summe Kasachstan		69.025	1,31	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (b)	2.622	\$ 1	0,00	<b>NAMIBIA</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Summe Stammaktien		1	0,00	Namibia Government International Bond	2.000	\$ 2.156	0,04	Pakistan Government International Bond	3.300	3.457	0,07	
				5,250 % fällig am 29.10.2025	2.900	2.977	0,06	6,875 % fällig am 05.12.2027	5.500	6.013	0,11	
				5,500 % fällig am 03.11.2021				8,250 % fällig am 15.04.2024		9.470	0,18	
				Summe Namibia		5.133	0,10	Summe Pakistan		15.659	0,30	
				<b>NIEDERLANDE</b>				<b>PANAMA</b>				
				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
				Penta CLO BV	164	200	0,01	Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.	5.847	7.005	0,13	
				0,790 % fällig am 04.08.2028				6,000 % fällig am 18.11.2048				
				InterCement Financial Operations BV	930	816	0,02	Banco Nacional de Panamá	5.900	5.915	0,11	
				5,750 % fällig am 17.07.2024				2,500 % fällig am 11.08.2030				
				Kazakhstan Temir Zholy Finance BV	7.660	11.337	0,21	ENA Norte Trust	2.792	2.876	0,06	
				6,950 % fällig am 10.07.2042				4,950 % fällig am 25.04.2028				
				MDGH - GMTN BV	5.500	6.607	0,12				15.796	0,30
				3,950 % fällig am 21.05.2050								
				Metinvest BV	475	509	0,01	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
				7,750 % fällig am 23.04.2023	13.885	15.253	0,29	Panama Government International Bond	6.200	7.905	0,15	
				7,750 % fällig am 17.10.2029	5.700	6.427	0,12	4,300 % fällig am 29.04.2053	7.100	9.145	0,17	
				8,500 % fällig am 23.04.2026				4,500 % fällig am 15.05.2047	21.200	27.401	0,52	
				Prosus NV	2.500	3.160	0,06	4,500 % fällig am 01.04.2056	1.300	1.936	0,04	
				1,539 % fällig am 03.08.2028	1.200	1.531	0,03	6,700 % fällig am 26.01.2036	300	441	0,01	
				2,031 % fällig am 03.08.2032	2.200	2.399	0,05	8,125 % fällig am 28.04.2034	2.000	2.892	0,06	
				3,680 % fällig am 21.01.2030	4.100	4.034	0,08	8,875 % fällig am 30.09.2027		49.720	0,95	
				3,832 % fällig am 08.02.2051	1.600	1.684	0,03	Summe Panama		65.516	1,25	
				4,027 % fällig am 03.08.2050								
				Summe Niederlande		53.757	1,02	<b>PARAGUAY</b>				
						53.957	1,03	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
				<b>NIGERIA</b>				Paraguay Government International Bond	2.500	3.034	0,06	
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				4,950 % fällig am 28.04.2031	8.500	10.785	0,20	
				Nigeria Government International Bond	11.400	11.825	0,23	5,400 % fällig am 30.03.2050	5.400	7.256	0,14	
				5,625 % fällig am 27.06.2022	8.350	9.058	0,17	6,100 % fällig am 11.08.2044				
				6,375 % fällig am 12.07.2023	5.753	6.213	0,12	Summe Paraguay		21.075	0,40	
				6,500 % fällig am 28.11.2027								
				6,500 % fällig am 28.11.2027	12.400	13.392	0,25	<b>PERU</b>				
				(i)	10.300	11.138	0,21	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
				7,143 % fällig am 23.02.2030	11.700	13.480	0,26	Banco de Credito del Peru	PEN 26.100	7.778	0,15	
				7,625 % fällig am 21.11.2025	11.946	12.610	0,24	4,650 % fällig am 17.09.2024				
				7,625 % fällig am 28.11.2047	4.400	4.705	0,09	Peru LNG SRL	\$ 1.700	1.519	0,03	
				7,696 % fällig am 23.02.2038	1.350	1.489	0,03	5,375 % fällig am 22.03.2030				
				7,875 % fällig am 16.02.2032	21.850	25.396	0,48	Petroleos del Peru S.A.	2.600	3.001	0,05	
				8,747 % fällig am 21.01.2031				4,750 % fällig am 19.06.2032	6.000	7.355	0,14	
				Summe Nigeria		109.306	2,08	5,625 % fällig am 19.06.2047				
								Summe Peru		19.653	0,37	
				<b>OMAN</b>								
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
				Oman Government International Bond	2.100	2.117	0,04	Fondo MIVIVIENDA S.A.	3.750	3.937	0,07	
				3,875 % fällig am 08.03.2022	600	614	0,01	3,500 % fällig am 31.01.2023				
				4,875 % fällig am 01.02.2025	8.490	8.682	0,16	Peru Government International Bond	5.700	6.091	0,12	
				5,625 % fällig am 17.01.2028	16.600	17.175	0,33	2,392 % fällig am 23.01.2026	2.500	2.527	0,05	
				6,000 % fällig am 01.08.2029	12.173	11.985	0,23	2,780 % fällig am 01.12.2060	6.000	6.599	0,13	
				6,500 % fällig am 08.03.2047	18.500	20.090	0,38	2,783 % fällig am 23.01.2031	2.300	2.554	0,05	
				6,750 % fällig am 28.10.2027	5.900	5.860	0,11	2,844 % fällig am 20.06.2030	4.800	4.800	0,09	
				6,750 % fällig am 17.01.2048				3,230 % fällig am 28.07.2121	50.300	14.473	0,27	
				Summe Oman		66.523	1,26	6,350 % fällig am 12.08.2028	31.000	10.894	0,21	
								6,550 % fällig am 14.03.2037	\$ 1.243	1.892	0,04	
				<b>PAKISTAN</b>				8,750 % fällig am 21.11.2033	3.175	5.436	0,10	
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								
				Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd.	4.985	5.059	0,10					
				5,500 % fällig am 13.10.2021	1.100	1.130	0,02					
				5,625 % fällig am 05.12.2022								
				Summe Pakistan		6.189	0,12					
								<b>PHILIPPINEN</b>				
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
								BDO Unibank, Inc.	9.100	9.383	0,18	
								2,125 % fällig am 13.01.2026				
								JGSH Philippines Ltd.	6.600	6.954	0,13	
								4,125 % fällig am 09.07.2030				
								Jollibee Worldwide Pte. Ltd.	8.700	8.965	0,17	
								4,125 % fällig am 24.01.2026	600	608	0,01	
								4,750 % fällig am 24.06.2030				
								PLDT, Inc.	3.200	3.346	0,07	
								2,500 % fällig am 23.01.2031	5.400	5.808	0,11	
								3,450 % fällig am 23.06.2050				
								Power Sector Assets & Liabilities Management Corp.	1.300	1.630	0,03	
								7,390 % fällig am 02.12.2024				
								Summe Philippinen		36.694	0,70	





## 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	
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				
Uniform Mortgage-Backed Security				Venezuela Government International Bond				<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>				
1,993 % fällig am 01.12.2035	10	\$ 10	0,00	7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	19.650	\$ 1.906	0,04	13,100 % fällig am 25.05.2021				
3,815 % fällig am 01.03.2036	16	16	0,00	7,650 % fällig am 21.04.2025 ^	6.624	643	0,01	(c)(d)	EGP	70.100	\$ 4.247	0,08
5,500 % fällig am 01.02.2038	2	2	0,00	7,750 % fällig am 13.10.2019 ^	20.130	1.953	0,04	13,220 % fällig am 23.11.2021				
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				8,250 % fällig am 13.10.2024 ^	12.483	1.211	0,02	(c)(d)		88.000	5.034	0,10
2,500 % fällig am 01.03.2051	12.450	13.085	0,25	9,000 % fällig am 07.05.2023 ^	9.878	958	0,02	13,249 % fällig am 11.05.2021				
3,500 % fällig am 01.02.2051	14.100	14.926	0,28	9,250 % fällig am 15.09.2027 ^	13.410	1.307	0,02	(c)(d)		391.000	23.804	0,45
		28.039	0,53	9,250 % fällig am 07.05.2028 ^	11.868	1.151	0,02	13,250 % fällig am 06.04.2021				
				11,950 % fällig am 05.08.2031 ^	2.930	284	0,01	(c)(d)		89.000	5.486	0,10
								13,250 % fällig am 26.10.2021				
<b>US-SCHATZobligationen</b>				<b>VIETNAM STAATSEMISSIONEN</b>				(c)(d)		30.100	1.735	0,03
U.S. Treasury Notes				Summe Venezuela		9.413	0,18	13,319 % fällig am 26.01.2021				
2,375 % fällig am 15.05.2029	7.900	8.930	0,17			13.256	0,25	(c)(d)		123.100	7.765	0,15
Summe USA		139.272	2,65					13,479 % fällig am 02.03.2021				
<b>URUGUAY STAATSEMISSIONEN</b>				<b>VIETNAM STAATSEMISSIONEN</b>				(c)(d)		284.000	17.703	0,34
Uruguay Government International Bond				Vietnam Government International Bond				13,501 % fällig am 16.02.2021				
4,125 % fällig am 20.11.2045	1.000	1.253	0,02	4,800 % fällig am 19.11.2024	500	563	0,01	(c)(d)		93.000	5.825	0,11
4,375 % fällig am 27.10.2027	200	237	0,00					Summe kurzfristige Instrumente			71.599	1,36
4,375 % fällig am 23.01.2031	15.478	19.023	0,36	<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH) UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Übertragbare Wertpapiere			\$ 4.949.737	94,05
4,975 % fällig am 20.04.2055	7.500	10.434	0,20	CLP Power Hong Kong Financing Ltd.								
5,100 % fällig am 18.06.2050	8.100	11.365	0,22	2,125 % fällig am 30.06.2030	5.300	5.371	0,10	<b>AKTIEN</b>				
7,625 % fällig am 21.03.2036	800	1.299	0,03	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.				<b>INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				
7,875 % fällig am 15.01.2033	9.350	14.970	0,28	5,125 % fällig am 15.05.2024	500	554	0,01	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (f)	250.000	2.523	0,05	
Summe Uruguay		58.581	1,11	6,000 % fällig am 15.07.2025	3.000	3.174	0,06	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)	1.943.234	22.716	0,43	
<b>VENEZUELA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Jungferninseln (Britisch)		9.099	0,17	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	34.771.110	346.390	6,58	
Petroleos de Venezuela S.A.				<b>SAMBIA STAATSEMISSIONEN</b>				PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)	748.199	9.719	0,19	
5,375 % fällig am 12.04.2027 ^	73.690	2.947	0,06	Zambia Government International Bond				Summe Investmentfonds		\$ 381.348	7,25	
5,500 % fällig am 12.04.2037 ^	19.365	756	0,01	5,375 % fällig am 20.09.2022 ^	4.050	2.127	0,04					
6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	3.500	140	0,00	8,500 % fällig am 14.04.2024 ^	8.900	4.812	0,09					
		3.843	0,07	8,970 % fällig am 30.07.2027 ^	5.100	2.703	0,05					
				Summe Sambia		9.642	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 <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 3.386	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (3.454)	\$ 3.386	\$ 3.386	0,06
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (3.454)</b>	<b>\$ 3.386</b>	<b>\$ 3.386</b>	<b>0,06</b>

(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-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	872	\$ 20	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	15	(8)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2021	291	(66)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	1.261	304	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	1.639	(41)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	420	(1.024)	(0,02)
				\$ (815)	(0,01)
<b>Summe der an einem gereglten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ (815)</b>	<b>(0,01)</b>

## 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 1.500	\$ 18	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	\$ 31.730	\$ (297)	(0,01)

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	0,183 %	21.10.2025	\$ 626	\$ 0	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,173	21.10.2025	626	0	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,800	15.01.2051	37.500	752	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.06.2027	13.700	(15)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.12.2022	149.170	(326)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	1.200	27	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	15.06.2046	600	13	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031	€ 10.000	10	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2026	12.100	33	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,470	21.04.2025	MXN 182.700	(153)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,520	24.04.2025	175.900	(148)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,530	24.04.2025	37.200	(31)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,615	23.04.2025	719.200	(611)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	26.02.2025	196.200	163	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,100	26.02.2025	58.000	48	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,100	28.02.2025	372.800	308	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,140	26.02.2025	65.000	54	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,150	26.02.2025	388.000	323	0,01
					\$ 447	0,01
					\$ 168	0,00

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- <sup>(1)</sup> 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.
- <sup>(2)</sup> 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.
- <sup>(3)</sup> 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.
- <sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Russia Government International Bond	(1,000) %	20.06.2024	\$ 7.200	\$ 33	\$ (135)	\$ (102)	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2030	12.300	2.910	(667)	2.243	0,04
CBK	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2030	4.000	943	(214)	729	0,01
HUS	Dubai International Government Bond	(1,000)	20.12.2024	3.600	(12)	5	(7)	0,00
JPM	Dubai International Government Bond	(1,000)	20.12.2024	1.500	(2)	(1)	(3)	0,00
					\$ 3.872	\$ (1.012)	\$ 2.860	0,05

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.09.2021	\$ 400	\$ (17)	\$ 19	\$ 2	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	9.600	(43)	107	64	0,00
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	6.500	(154)	182	28	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2022	5.400	(12)	48	36	0,00
BRC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	1.700	(29)	48	19	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2021	19.900	(614)	792	178	0,01
	Indonesia Government International Bond	5,000	20.12.2023	3.350	(402)	140	(262)	(0,01)
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2024	7.800	(1.076)	1.232	156	0,00
	Nigeria International Government Bond	5,000	20.12.2021	6.400	344	(105)	239	0,01
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.687	(277)	598	321	0,01
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.700	(335)	366	31	0,00
CBK	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2025	18.100	(2.449)	784	(1.665)	(0,03)
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	6.100	(16)	57	41	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	500	(5)	13	8	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2024	3.800	(519)	595	76	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.200	(41)	66	25	0,00
DUB	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2025	6.000	(812)	260	(552)	(0,01)
	Egypt Government International Bond	5,000	20.06.2022	10.400	357	109	466	0,01
FBF	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	21.000	0	137	137	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2022	8.900	(65)	84	19	0,00
	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2021	7.200	(614)	565	(49)	0,00
GST	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2021	4.100	(263)	282	19	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2022	10.000	122	46	168	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	4.100	(14)	41	27	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.700	(40)	87	47	0,00
HUS	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2024	10.100	(1.381)	1.582	201	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	3	2	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	7.200	89	9	98	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2025	20.000	(236)	369	133	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.000	29	32	61	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.413	36	34	70	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	400	(6)	14	8	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	200	(3)	7	4	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	28.000	300	269	569	0,01
	Israel Government International Bond	1,000	20.06.2024	6.100	144	(3)	141	0,00
JPM	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	29.300	319	277	596	0,01
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	10.600	(171)	71	(100)	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	4.400	(19)	48	29	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2021	7.500	(543)	560	17	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2024	11.500	(19)	248	229	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	300	(2)	7	5	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(3)	5	2	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	22.700	167	5	172	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	18.000	98	268	366	0,01
NGF	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	9.600	(620)	683	63	0,00
UAG	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	350	(25)	27	2	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2021	1.200	(79)	84	5	0,00
					\$ (8.900)	\$ 11.152	\$ 2.252	0,04

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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	01.2021	\$ 21	€ 17	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	2.383	HUF 736.598	102	0	102	0,00
	01.2021	17.729	¥ 1.843.817	130	0	130	0,00
BPS	01.2021	ZAR 282.808	\$ 18.311	0	(895)	(895)	(0,02)
	01.2021	€ 567	€ 691	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 1.607	€ 1.310	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	148	MXN 2.931	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	ZAR 345.813	\$ 22.278	18	(1.233)	(1.215)	(0,02)
CBK	02.2021	AUD 53.742	38.944	0	(2.544)	(2.544)	(0,05)
	01.2021	€ 13.586	16.335	0	(290)	(290)	(0,01)
	01.2021	RUB 29.467	383	0	(15)	(15)	0,00
	01.2021	\$ 3.146	€ 2.594	28	0	28	0,00
	01.2021	1.726	¥ 179.755	15	0	15	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	01.2021	\$	ZAR	1.681	\$	7	\$ 0,00	
	02.2021	EGP	\$	5.636	0	(206)	0,00	
	02.2021	PEN		8.056	74	0	0,00	
	02.2021	RUB		34.232	465	4	0,00	
	03.2021	PEN		36.584	356	0	0,01	
	04.2021	EGP		5.329	0	(192)	0,00	
	05.2021	\$	PEN	107.856	0	(139)	0,00	
GLM	01.2021	DOP	\$	1.042	0	(14)	0,00	
	01.2021	¥		36.530	0	(92)	0,00	
	01.2021	PEN		18.235	68	0	0,00	
	01.2021	RUB		479	0	(17)	0,00	
	02.2021	DOP		6.524	0	(71)	0,00	
	02.2021	RUB		12.022	0	(323)	(0,01)	
	02.2021	\$	¥	3.780.900	93	0	0,00	
	03.2021	DOP	\$	5.094	0	(71)	0,00	
	04.2021	COP		5.136	0	(365)	(0,01)	
	04.2021	\$	EGP	38.117	9	0	0,00	
	05.2021	DOP	\$	406	0	(2)	0,00	
HUS	01.2021	€		18.174	0	(374)	(0,01)	
	01.2021	£		19.098	0	(422)	(0,01)	
	01.2021	\$	€	884	9	0	0,00	
	01.2021		¥	332.080	30	0	0,00	
	01.2021	ZAR	\$	5.369	5	0	0,00	
	02.2021	RUB		9.164	3	(61)	0,00	
	03.2021	EGP		17.139	0	(639)	(0,01)	
JPM	01.2021	CLP		175	0	(19)	0,00	
	01.2021	\$	€	19	0	0	0,00	
	01.2021	ZAR	\$	2.797	0	(104)	0,00	
MYI	01.2021	€		2.211	2	(1)	0,00	
	01.2021	£		185	0	(1)	0,00	
	01.2021	SGD		165	0	0	0,00	
	01.2021	\$	AUD	17	0	0	0,00	
	01.2021		€	288	0	0	0,00	
	01.2021		£	494	3	0	0,00	
	01.2021	ZAR	\$	12.095	0	(637)	(0,01)	
	02.2021	\$	EGP	75.200	24	0	0,00	
RBC	01.2021	MXN	\$	2.535	0	(153)	0,00	
	01.2021	\$	£	804	19	0	0,00	
SCX	01.2021	€	\$	197.112	0	(4.272)	(0,08)	
	01.2021	HUF		1.923	0	(60)	0,00	
	01.2021	\$	ZAR	34.503	0	(5)	0,00	
	02.2021	€	\$	201.520	0	(2)	0,00	
	03.2021	CNY		9.123	0	(104)	0,00	
TOR	01.2021	\$	¥	1.425.248	143	0	0,00	
	01.2021	ZAR	\$	6.612	0	(4)	0,00	
UAG	01.2021	\$	MXN	2.187	6	0	0,00	
	02.2021	RUB	\$	27.820	4	(669)	(0,01)	
				\$	1.152	\$ (14.003)	\$ (12.851)	(0,24)

## ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse 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	01.2021	\$	AUD	3.154	\$	104	0,01	
BPS	01.2021			336	12	0	0,00	
HUS	01.2021	AUD	\$	49	0	(1)	0,00	
	01.2021	\$	AUD	2.703	91	0	0,00	
JPM	01.2021			827	29	0	0,00	
MYI	01.2021	AUD	\$	49	0	(2)	0,00	
SCX	01.2021			31	0	0	0,00	
	01.2021	\$	AUD	662	23	0	0,00	
UAG	01.2021			1.603	58	0	0,00	
				\$	317	\$ (3)	\$ 314	0,01

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse 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	01.2021	\$	CHF	29.530	\$	717	0,01	
BPS	01.2021	CHF	\$	1.107	5	0	0,00	
BRC	01.2021	\$	CHF	3	0	0	0,00	
CBK	01.2021			8	0	0	0,00	
MYI	01.2021			33.499	913	0	0,02	
SCX	01.2021			3.891	100	0	0,00	
SSB	01.2021			33.641	730	0	0,01	
UAG	01.2021			18	0	0	0,00	
				\$	2.465	\$ 0	\$ 2.465	0,04

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen 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	01.2021	€ 5.778	\$ 7.097	\$ 27	\$ 0	\$ 27	0,00
BPS	01.2021	2.004	2.454	5	(3)	2	0,00
	01.2021	\$ 574.202	€ 478.856	11.736	(31)	11.705	0,22
BRC	01.2021	567	464	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	€ 264	\$ 320	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 5.529	€ 4.591	89	0	89	0,00
HUS	01.2021	€ 1.462	\$ 1.779	0	(9)	(9)	0,00
	01.2021	\$ 116.221	€ 96.342	1.722	(56)	1.666	0,03
JPM	01.2021	€ 322	\$ 393	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2021	\$ 780	€ 639	2	0	2	0,00
SCX	01.2021	670.019	559.464	14.514	0	14.514	0,28
	02.2021	1.082.567	884.169	0	(4)	(4)	0,00
TOR	01.2021	631.733	527.495	13.685	0	13.685	0,26
	02.2021	796.023	650.139	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 41.781	\$ (110)	\$ 41.671	0,79

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	£ 172	\$ 232	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	01.2021	\$ 4.389	£ 3.286	103	0	103	0,00
BRC	01.2021	£ 5.789	\$ 7.772	0	(141)	(141)	0,00
	01.2021	\$ 122	£ 89	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	£ 722	\$ 975	0	(11)	(11)	0,00
	01.2021	\$ 30.408	£ 22.748	688	0	688	0,01
HUS	01.2021	£ 175	\$ 236	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 41.047	£ 30.725	954	0	954	0,02
MYI	01.2021	£ 15	\$ 20	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 27	£ 20	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	£ 86	\$ 115	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 80	£ 60	2	0	2	0,00
SSB	01.2021	38.127	28.563	919	0	919	0,02
				\$ 2.666	\$ (162)	\$ 2.504	0,05

Zum 31. Dezember 2020 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
BPS	01.2021	SGD 11.481	\$ 8.655	\$ 0	\$ (33)	\$ (33)	0,00
	02.2021	\$ 8.655	SGD 11.481	32	0	32	0,00
BRC	01.2021	82	109	1	0	1	0,00
	02.2021	SGD 32	\$ 24	0	0	0	0,00
GLM	02.2021	\$ 92	SGD 122	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	663	888	9	0	9	0,00
	02.2021	SGD 140	\$ 106	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$ 326	SGD 433	2	0	2	0,00
MYI	01.2021	SGD 5.168	\$ 3.884	0	(27)	(27)	0,00
	01.2021	\$ 3.026	SGD 4.047	36	0	36	0,00
	02.2021	3.884	5.168	26	0	26	0,00
NGF	01.2021	SGD 11.506	\$ 8.635	0	(71)	(71)	0,00
	01.2021	\$ 7.946	SGD 10.652	113	0	113	0,00
	02.2021	8.635	11.506	71	0	71	0,00
SCX	01.2021	8.002	10.738	123	0	123	0,01
SSB	01.2021	1.007	1.351	15	0	15	0,00
	02.2021	SGD 86	\$ 65	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	17	13	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 290	SGD 388	4	0	4	0,00
	02.2021	SGD 20	\$ 15	0	0	0	0,00
	02.2021	\$ 49	SGD 65	0	0	0	0,00
				\$ 432	\$ (132)	\$ 300	0,01

Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 39.515	0,75
Summe Anlagen						\$ 5.373.339	102,10
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (110.324)	(2,10)
Nettovermögen						\$ 5.263.015	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 mit Sachwertausschüttung.

(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.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
JPMorgan Structured Products BV	3,231 %	14.10.2024	18.10.2019	\$ 8.400	\$ 8.405	0,16

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 154,217 und Barmittel in Höhe von USD 290 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 759 und Barmittel in Höhe von USD 2.240 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 19.522 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 1.102 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 4.924.892	\$ 24.844	\$ 4.949.737
Investmentfonds	381.348	0	0	381.348
Pensionsgeschäfte	0	3.386	0	3.386
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(815)	39.683	0	38.868
<b>Summen</b>	<b>\$ 380.534</b>	<b>\$ 4.967.961</b>	<b>\$ 24.844</b>	<b>\$ 5.373.339</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 3	\$ 3.984.005	\$ 55.094	\$ 4.039.102
Investmentfonds	242.079	0	0	242.079
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(4.061)	44.739	0	40.678
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(1.069)	0	(1.069)
<b>Summen</b>	<b>\$ 238.021</b>	<b>\$ 4.027.675</b>	<b>\$ 55.094</b>	<b>\$ 4.320.790</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	(0,700) %	15.10.2020	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (1.585)	\$ (1.583)	(0,03)
	0,400	04.12.2020	29.01.2021	(27.092)	(27.101)	(0,51)
	0,420	08.12.2020	08.02.2021	(28.754)	(28.762)	(0,55)
BRC	(0,100)	30.09.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(2.737)	(2.737)	(0,05)
	0,850	26.10.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(9.240)	(9.253)	(0,17)
CFR	(1,150)	03.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	€ (3.711)	(4.536)	(0,09)
JML	0,320	15.12.2020	15.01.2021	\$ (37.638)	(37.644)	(0,71)
	0,600	06.10.2020	02.10.2022	(2.591)	(2.594)	(0,05)
MEI	0,800	28.08.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(3.568)	(3.578)	(0,07)
SCX	0,550	22.10.2020	20.01.2021	(20.282)	(20.304)	(0,39)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (138.092)</b>	<b>(2,62)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 279	\$ 0	\$ 279
BPS	8.289	(10.970)	(2.681)
BRC	822	(830)	(8)
CBK	732	(390)	342
DUB	622	(940)	(318)
FBF	138	0	138
GLM	(785)	640	(145)
GST	639	(559)	80
HUS	1.833	(2.240)	(407)
JPM	539	(470)	69
MYC	820	(833)	(13)
MYI	338	(320)	18
NGF	176	0	176
RBC	(134)	0	(134)
SCX	10.312	(12.670)	(2.358)
SSB	1.664	(1.580)	84
TOR	13.821	(17.090)	(3.269)
UAG	(590)	462	(128)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	80,20	81,45
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	13,69	19,48
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,16	k. A.
Investmentfonds	7,25	6,05
Pensionsgeschäfte	0,06	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	(0,10)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,75	1,14
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,03)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(2,62)	(2,37)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Angola	1,20	0,69
Argentinien	2,19	2,72
Armenien	0,05	0,16
Österreich	0,09	0,11
Aserbaidschan	0,97	1,10
Bahamas	0,24	0,33
Bahrain	0,34	0,21
Weissrussland	0,04	k. A.
Bermuda	0,15	k. A.
Brasilien	3,70	3,65
Cayman-Inseln	2,56	4,27
Chile	2,45	2,93
China	2,34	2,10
Kolumbien	1,59	1,35
Costa Rica	0,29	0,59
Kroatien	0,03	k. A.
Dominikanische Republik	2,82	2,50
Ecuador	0,94	1,16
Ägypten	2,86	2,23
El Salvador	0,32	0,54
Äthiopien	0,06	k. A.
Gabun	0,02	0,05
Deutschland	0,34	0,36
Ghana	1,14	1,04
Guatemala	1,23	1,27
Hongkong	0,73	0,75
Ungarn	0,79	0,14
Indien	0,97	0,76
Indonesien	5,61	6,57
Irland	0,42	0,61
Israel	0,92	0,33
Elfenbeinküste	1,31	0,17
Jamaika	0,08	k. A.
Jordanien	0,53	0,09
Kasachstan	1,31	0,65
Kenia	0,12	0,65

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Luxemburg	1,33	2,84
Malaysia	0,64	0,06
Marshallinseln	0,01	0,02
Mauritius	0,08	0,24
Mexiko	7,88	7,49
Mongolei	0,39	0,45
Marokko	0,46	0,08
Namibia	0,10	0,05
Niederlande	1,03	0,77
Nigeria	2,08	1,65
Oman	1,26	3,19
Pakistan	0,30	0,43
Panama	1,25	0,82
Paraguay	0,40	0,21
Peru	1,50	1,10
Philippinen	1,35	0,04
Katar	2,38	1,85
Rumänien	1,42	0,59
Russland	2,78	4,90
Saudi-Arabien	3,27	2,51
Senegal	0,23	0,73
Serbien	0,66	0,86
Singapur	0,15	0,21
Südafrika	4,63	3,05
Spanien	0,00	k. A.
Sri Lanka	0,77	0,70
Supranational	0,06	0,08
Tansania	0,06	0,15
Thailand	0,07	0,52
Trinidad und Tobago	0,02	0,07
Tunesien	0,08	0,04
Türkei	4,48	7,61
Ukraine	2,25	3,17
Vereinigte Arabische Emirate	3,07	0,52
Großbritannien	1,13	0,88
USA	2,65	9,90
Uruguay	1,11	1,27
Venezuela	0,25	0,49
Vietnam	0,01	k. A.
Jungferinseln (Britisch)	0,17	0,44
Sambia	0,18	0,27
Kurzfristige Instrumente	1,36	0,60
Investmentfonds	7,25	6,05
Pensionsgeschäfte	0,06	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	(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	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,01
Zinsswaps	0,01	(0,03)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,05	0,11
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	0,10
Zinsswaps	k. A.	(0,04)
Devisenterminkontrakte	(0,24)	(0,13)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,90	1,10
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,03)
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,10)	(7,97)
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
<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>GUATEMALA</b>				<b>INDONESIEN</b>			
5,875 % fällig am 30.01.2060	\$ 9.700	\$ 10.719	0,74	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
5,950 % fällig am 25.01.2027	11.300	13.292	0,92	Guatemala Government International Bond				Bank Mandiri Persero Tbk PT	\$ 2.000	\$ 2.139	0,15
6,000 % fällig am 19.07.2028	4.320	5.179	0,36	4,375 % fällig am 05.06.2027	\$ 4.200	\$ 4.677	0,33	3,750 % fällig am 11.04.2024			
6,400 % fällig am 05.06.2049	2.300	2.708	0,19	4,500 % fällig am 03.05.2026	1.600	1.782	0,12	Pelabuhan Indonesia PT			
6,500 % fällig am 15.02.2048	2.200	2.607	0,18	4,875 % fällig am 13.02.2028	1.900	2.192	0,15	4,250 % fällig am 05.05.2025	3.700	4.051	0,28
6,875 % fällig am 29.01.2026	4.500	5.439	0,38	4,900 % fällig am 01.06.2030	1.000	1.171	0,08	5,375 % fällig am 05.05.2045	1.000	1.210	0,09
9,750 % fällig am 05.06.2026	DOP 48.500	900	0,06	5,375 % fällig am 24.04.2032	900	1.101	0,08				
10,375 % fällig am 04.03.2022	5.600	101	0,01	5,750 % fällig am 06.06.2022	2.270	2.415	0,17				
10,500 % fällig am 07.04.2023	26.300	486	0,03	6,125 % fällig am 01.06.2050	4.500	5.968	0,41				
10,750 % fällig am 11.08.2028	67.600	1.346	0,09	Summe Guatemala		19.306	1,34	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
10,875 % fällig am 14.01.2026	10.600	206	0,02					Indonesia Government International Bond			
11,500 % fällig am 10.05.2024	2.100	41	0,00	<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>				3,375 % fällig am 30.07.2025	€ 1.100	1.525	0,10
16,950 % fällig am 04.02.2022	48.300	926	0,07	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,850 % fällig am 18.07.2027	\$ 1.500	1.717	0,12
Summe Dominikanische Republik		58.039	4,03	Globalworth Real Estate Investments Ltd.	€ 3.500	4.510	0,31	4,200 % fällig am 15.10.2050	400	479	0,03
				2,950 % fällig am 29.07.2026				4,350 % fällig am 08.01.2027	300	350	0,02
<b>ECUADOR</b>				<b>HONGKONG</b>				4,450 % fällig am 15.04.2070	3.600	4.431	0,31
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,750 % fällig am 18.07.2047	3.300	4.145	0,29
Ecuador Government International Bond				AIA Group Ltd.				4,875 % fällig am 05.05.2021	600	609	0,04
0,000 % fällig am 31.07.2030 (a)	\$ 3.816	1.822	0,13	3,200 % fällig am 16.09.2040	\$ 200	210	0,01	5,125 % fällig am 15.01.2045	1.200	1.553	0,11
0,500 % fällig am 31.07.2030	6.034	3.907	0,27	Fortune Star BVI Ltd.				5,250 % fällig am 08.01.2047	200	267	0,02
0,500 % fällig am 31.07.2035	24.450	13.356	0,93	5,950 % fällig am 19.10.2025	4.000	4.195	0,29	6,750 % fällig am 15.01.2044	3.000	4.628	0,32
0,500 % fällig am 31.07.2040	6.927	3.524	0,24	Horse Gallop Finance Ltd.				7,750 % fällig am 17.01.2038	180	283	0,02
Summe Ecuador		22.609	1,57	1,431 % fällig am 28.06.2021	3.400	3.400	0,24	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia			
				Huarong Finance Co. Ltd.				3,875 % fällig am 06.04.2024	800	860	0,06
<b>ÄGYPTEN</b>				1,330 % fällig am 24.02.2023	1.600	1.578	0,11	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Lenovo Group Ltd.				2,300 % fällig am 23.06.2030	500	531	0,04
Egypt Government International Bond				3,421 % fällig am 02.11.2030	1.300	1.368	0,09	4,400 % fällig am 01.03.2028	2.200	2.580	0,18
4,750 % fällig am 16.04.2026	€ 4.800	6.122	0,42	MTR Corp. Ltd.				4,450 % fällig am 20.02.2029	2.400	2.841	0,20
5,250 % fällig am 06.10.2025	\$ 29.700	31.626	2,19	1,625 % fällig am 19.08.2030	4.300	4.262	0,30				
5,625 % fällig am 16.04.2030	€ 1.100	1.413	0,10	4,200 % fällig am 07.06.2024	2.800	3.013	0,21	Summe Indonesien			
6,125 % fällig am 31.01.2022	\$ 7.200	7.529	0,52	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				28.159	1,95		
6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 3.400	4.486	0,31	Airport Authority Hong Kong				35.559	2,47		
7,053 % fällig am 15.01.2032	\$ 2.200	2.402	0,17	2,100 % fällig am 08.03.2026 (c)	1.800	1.832	0,13	<b>IRLAND</b>			
7,625 % fällig am 29.05.2032	9.300	10.560	0,73	2,400 % fällig am 08.03.2028 (c)	3.000	3.071	0,21	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
7,903 % fällig am 21.02.2048	500	545	0,04	Summe Hongkong		4.903	0,34	Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC			
8,500 % fällig am 31.01.2047	1.000	1.136	0,08					5,950 % fällig am 15.04.2030 (d)	700	728	0,05
8,700 % fällig am 01.03.2049	200	232	0,02	<b>UNGARN</b>				Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC			
14,313 % fällig am 13.10.2023	EGP 15.000	970	0,07	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				3,949 % fällig am 24.04.2023	1.700	1.784	0,12
14,369 % fällig am 20.10.2025	18.400	1.183	0,08	Hungary Government International Bond				Summe Irland			
14,605 % fällig am 08.09.2025	15.000	973	0,07	1,500 % fällig am 17.11.2050	€ 2.800	3.477	0,24	<b>INSEL MAN</b>			
Summe Ägypten		69.177	4,80	1,750 % fällig am 05.06.2035	14.000	19.022	1,32	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				5,375 % fällig am 25.03.2024	\$ 1.400	1.600	0,11	NE Property BV			
<b>EL SALVADOR</b>				Summe Ungarn		24.099	1,67	2,625 % fällig am 22.05.2023	€ 700	892	0,06
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>INDIEN</b>				3,375 % fällig am 14.07.2027	2.300	3.055	0,21
El Salvador Government International Bond				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Isle of Man			
5,875 % fällig am 30.01.2025	\$ 300	285	0,02	Adani Renewable Energy RJ Ltd.				<b>ISRAEL</b>			
6,375 % fällig am 18.01.2027	2.600	2.467	0,17	4,625 % fällig am 15.10.2039	3.931	4.086	0,28	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
7,125 % fällig am 20.01.2050	1.700	1.526	0,10	Indian Railway Finance Corp. Ltd.				Israel Government International Bond			
7,625 % fällig am 21.09.2034	1.100	1.017	0,07	3,249 % fällig am 13.02.2030	600	640	0,05	3,375 % fällig am 15.01.2050 (f)	\$ 2.000	2.219	0,15
7,625 % fällig am 01.02.2041	250	233	0,02	3,835 % fällig am 13.12.2027	4.400	4.863	0,34	3,800 % fällig am 13.05.2060 (f)	5.600	6.667	0,46
7,650 % fällig am 15.06.2035	1.000	952	0,07	3,950 % fällig am 13.02.2050	300	304	0,02	4,125 % fällig am 17.01.2048	400	517	0,04
7,750 % fällig am 24.01.2023	110	109	0,01	Muthoot Finance Ltd.				Summe Israel			
9,500 % fällig am 15.07.2052	2.850	2.893	0,20	4,400 % fällig am 02.09.2023	900	919	0,06	<b>ELFENBEINKÜSTE</b>			
Summe El Salvador		9.482	0,66	ReNew Power Pvt Ltd.				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				5,875 % fällig am 05.03.2027	2.000	2.126	0,15	Ivory Coast Government International Bond			
<b>DEUTSCHLAND</b>				Shriram Transport Finance Co. Ltd.				4,875 % fällig am 30.01.2032	€ 2.300	2.896	0,20
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,100 % fällig am 16.07.2023	700	721	0,05	5,250 % fällig am 22.03.2030	8.000	10.524	0,73
Deutsche Bank AG				5,700 % fällig am 27.02.2022	1.800	1.831	0,13	5,750 % fällig am 31.12.2032	\$ 8.134	8.231	0,57
1,411 % fällig am 16.11.2022	600	601	0,04					5,875 % fällig am 17.10.2031	€ 1.400	1.896	0,13
1,875 % fällig am 14.02.2022	€ 500	625	0,04	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Elfenbeinküste			
3,700 % fällig am 30.05.2024	\$ 600	646	0,05	Export-Import Bank of India				23.547	1,63		
3,950 % fällig am 27.02.2023	1.000	1.063	0,07	3,250 % fällig am 15.01.2030	1.500	1.609	0,11	<b>JAMAICA</b>			
5,000 % fällig am 14.02.2022	2.200	2.301	0,16	3,875 % fällig am 01.02.2028	2.100	2.319	0,16	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Summe Deutschland		5.236	0,36	Summe Indien		19.418	1,35	TransJamaican Highway Ltd.			
								5,750 % fällig am 10.10.2036	\$ 700	722	0,05
<b>GHANA</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Indonesien				Jamaica Government International Bond			
Ghana Government International Bond								7,875 % fällig am 28.07.2045	3.100	4.456	0,31
6,375 % fällig am 11.02.2027	3.500	3.646	0,25					Summe Jamaica			
7,625 % fällig am 16.05.2029	3.800	4.051	0,28					5.178	0,36		
7,875 % fällig am 26.03.2027	1.100	1.213	0,09								
8,125 % fällig am 26.03.2032	5.600	5.946	0,41								
8,627 % fällig am 16.06.2049	1.600	1.643	0,11								
8,750 % fällig am 11.03.2061	6.400	6.607	0,46								
8,950 % fällig am 26.03.2051	3.000	3.138	0,22								
Summe Ghana		26.244	1,82								

**Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond 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
<b>JORDANIEN</b>				<b>OMAN</b>				<b>OMAN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Jordan Government International Bond				Trust Fibra Uno				Oman Government International Bond			
5,750 % fällig am 31.01.2027	\$ 300	\$ 331	0,02	4,869 % fällig am 15.01.2030	\$ 300	\$ 342	0,03	5,375 % fällig am 08.03.2027	\$ 600	\$ 614	0,04
5,850 % fällig am 07.07.2030	6.400	7.077	0,49	6,390 % fällig am 15.01.2050	2.000	2.347	0,16	5,625 % fällig am 17.01.2028	3.600	3.682	0,26
6,125 % fällig am 29.01.2026	500	558	0,04					6,000 % fällig am 01.08.2029	12.900	13.347	0,93
7,375 % fällig am 10.10.2047	2.200	2.572	0,18					6,500 % fällig am 08.03.2047	5.350	5.267	0,37
Summe Jordanien		10.538	0,73					6,750 % fällig am 28.10.2027	9.600	10.425	0,72
								7,375 % fällig am 28.10.2032	3.978	4.400	0,30
								Summe Oman		37.735	2,62
<b>KASACHSTAN</b>								<b>PANAMA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Development Bank of Kazakhstan JSC								Banco Nacional de Panamá			
4,125 % fällig am 10.12.2022	6.900	7.266	0,50					2.500 % fällig am 11.08.2030	600	601	0,04
								Empresa de Transmision Electrica S.A.			
								5,125 % fällig am 02.05.2049	1.000	1.248	0,09
								Summe Panama		1.849	0,13
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Panama Government International Bond			
								2,252 % fällig am 29.09.2032	3.600	3.722	0,26
								3,870 % fällig am 23.07.2060	4.500	5.321	0,37
								4,300 % fällig am 29.04.2053	3.000	3.825	0,26
								4,500 % fällig am 15.05.2047	1.000	1.288	0,09
								4,500 % fällig am 16.04.2050	1.000	1.290	0,09
								4,500 % fällig am 01.04.2056	7.200	9.306	0,64
								6,700 % fällig am 26.01.2036 (f)	4.900	7.298	0,51
								7,125 % fällig am 29.01.2026	204	261	0,02
								8,125 % fällig am 28.04.2034	1.000	1.470	0,10
								8,875 % fällig am 30.09.2027	800	1.157	0,08
								9,375 % fällig am 16.01.2023	180	209	0,01
								9,375 % fällig am 01.04.2029	800	1.249	0,09
								Summe Panama		38.245	2,65
								<b>PARAGUAY</b>			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Paraguay Government International Bond			
								4,950 % fällig am 28.04.2031	1.900	2.306	0,16
								5,400 % fällig am 30.03.2050	5.500	6.978	0,48
								5,600 % fällig am 13.03.2048	1.800	2.322	0,16
								6,100 % fällig am 11.08.2044	1.500	2.016	0,14
								Summe Paraguay		13.622	0,94
								<b>PERU</b>			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Fondo MIVIENDA S.A.			
								3,500 % fällig am 31.01.2023	200	210	0,01
								Peru Government International Bond			
								2,392 % fällig am 23.01.2026	6.200	6.625	0,46
								2,780 % fällig am 01.12.2060 (f)	10.200	10.312	0,72
								2,783 % fällig am 23.01.2031	4.000	4.399	0,30
								2,844 % fällig am 20.06.2030	2.000	2.221	0,15
								3,230 % fällig am 28.07.2121	1.700	1.700	0,12
								5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN 9.800	2.820	0,20
								6,350 % fällig am 12.08.2028	10.700	3.760	0,26
								6,550 % fällig am 14.03.2037	\$ 1.690	2.572	0,18
								8,750 % fällig am 21.11.2033	1.100	1.883	0,13
								Summe Peru		36.502	2,53
								<b>PHILIPPINEN</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								BDO Unibank, Inc.			
								2,125 % fällig am 13.01.2026	2.400	2.475	0,17
								Jollibee Worldwide Pte. Ltd.			
								4,125 % fällig am 24.01.2026	2.100	2.164	0,15
								4,750 % fällig am 24.06.2030	3.300	3.346	0,23
								PLDT, Inc.			
								2,500 % fällig am 23.01.2031	800	836	0,06
								3,450 % fällig am 23.06.2050 (f)	6.500	6.991	0,49
								Summe Philippinen		15.812	1,10
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Philippines Government International Bond			
								2,650 % fällig am 10.12.2045	2.800	2.842	0,20

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
2,950 % fällig am 05.05.2045	\$ 7.500	\$ 7.936	0,55	United Overseas Bank Ltd.	200	204	0,01	<b>TÜRKEI</b>			
3,700 % fällig am 01.03.2041	300	348	0,02	2,880 % fällig am 08.03.2027 (d)				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
		11.126	0,77	Summe Singapur		3.309	0,23	Hazine Mustesarlıgi Varlik Kiralama A/S	\$ 200	\$ 204	0,01
Summe Philippinen		26.938	1,87					5,004 % fällig am 06.04.2023			
<b>KATAR</b>				<b>SÜDAFRIKA</b>				Türkisch Airlines Pass-Through Trust	266	221	0,02
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,200 % fällig am 15.09.2028	266	221	0,02
Qatar Government International Bond				Growthpoint Properties International Pty. Ltd.	\$ 1.100	\$ 1.168	0,08	Türkiye İş Bankası A/S	1.800	1.844	0,13
3,375 % fällig am 14.03.2024 (f)	4.700	5.097	0,35	4,875 % fällig am 02.05.2023				6,125 % fällig am 25.04.2024			
3,750 % fällig am 16.04.2030 (f)	7.200	8.488	0,59	Prosus NV	2.500	2.885	0,20	Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari A/S	1.700	1.895	0,13
4,000 % fällig am 14.03.2029 (f)	4.100	4.869	0,34	5,500 % fällig am 21.07.2025	400	461	0,03	6,950 % fällig am 14.03.2026			
4,400 % fällig am 16.04.2050	3.300	4.309	0,30			4.514	0,31	Türkiye Vakıflar Bankası TAO	4.600	4.727	0,33
4,817 % fällig am 14.03.2049 (f)	5.000	6.836	0,47	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				6,500 % fällig am 08.01.2026			
5,103 % fällig am 23.04.2048	1.800	2.536	0,18	South Africa Government International Bond						8.891	0,62
Summe Katar		32.135	2,23	4,300 % fällig am 12.10.2028	12.000	12.536	0,87	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>RUMÄNIEN</b>				4,850 % fällig am 27.09.2027	3.200	3.467	0,24	Export-Credit Bank of Turkey	6.100	6.077	0,42
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				4,850 % fällig am 30.09.2029	4.600	4.896	0,34	4,250 % fällig am 18.09.2022			
Romania Government International Bond				4,875 % fällig am 14.04.2026	6.500	7.125	0,50	5,375 % fällig am 24.10.2023	900	910	0,06
2,124 % fällig am 16.07.2031	€ 10.650	13.853	0,96	5,000 % fällig am 12.10.2046	2.000	1.883	0,13	8,250 % fällig am 24.01.2024	1.000	1.086	0,07
2,625 % fällig am 02.12.2040	2.700	3.528	0,25	5,750 % fällig am 30.09.2049	11.200	11.260	0,78	Turkey Government International Bond			
2,875 % fällig am 26.05.2028	100	138	0,01	5,875 % fällig am 30.05.2022	6.700	7.176	0,50	4,250 % fällig am 13.03.2025	1.000	1.005	0,07
3,000 % fällig am 14.02.2031	\$ 1.700	1.828	0,13	5,875 % fällig am 16.09.2025	1.100	1.262	0,09	4,875 % fällig am 16.04.2043	4.400	3.864	0,27
3,375 % fällig am 28.01.2050	€ 1.900	2.682	0,19	10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 225.600	18.223	1,26	5,125 % fällig am 17.02.2028	3.600	3.654	0,25
3,624 % fällig am 26.05.2030	500	730	0,05	Summe Südafrika		67.828	4,71	5,250 % fällig am 13.03.2030	3.400	3.419	0,24
4,000 % fällig am 14.02.2051	\$ 6.800	7.417	0,51			72.342	5,02	5,750 % fällig am 11.05.2047	6.500	6.208	0,43
4,625 % fällig am 03.04.2049	€ 900	1.489	0,10	<b>SÜDKOREA</b>				5,950 % fällig am 15.01.2031	5.400	5.643	0,39
Summe Rumänien		31.665	2,20	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,000 % fällig am 14.01.2041	600	594	0,04
<b>RUSSLAND</b>				Kookmin Bank	2.500	2.548	0,18	6,375 % fällig am 14.10.2025	2.000	2.166	0,15
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Shinhan Card Co. Ltd.	3.000	3.047	0,21	6,875 % fällig am 17.03.2036	3.130	3.419	0,24
MMK International Capital DAC	\$ 2.800	3.025	0,21	Shinhan Financial Group Co. Ltd.	5.100	5.417	0,37	7,250 % fällig am 05.03.2038	200	226	0,02
4,375 % fällig am 13.06.2024				3,340 % fällig am 05.02.2030 (d)		11.012	0,76	Summe Türkei		47.162	3,27
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								<b>UKRAINE</b>			
Russia Government International Bond				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
4,250 % fällig am 23.06.2027	200	229	0,02	Korea Land & Housing Corp.	2.600	2.614	0,18	Ukraine Government International Bond			
4,375 % fällig am 21.03.2029	3.000	3.506	0,24	0,625 % fällig am 03.11.2023				0,000 % fällig am 31.05.2040	7.500	7.754	0,54
4,750 % fällig am 27.05.2026	400	463	0,03	Summe Südkorea		13.626	0,94	4,375 % fällig am 27.01.2030	€ 1.000	1.173	0,08
5,100 % fällig am 28.03.2035	2.200	2.787	0,19	<b>SRI LANKA</b>				7,253 % fällig am 15.03.2033	\$ 7.700	8.431	0,58
5,250 % fällig am 23.06.2047	1.400	1.943	0,14	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				7,750 % fällig am 01.09.2021	12.100	12.558	0,87
5,625 % fällig am 04.04.2042	2.000	2.786	0,19	Sri Lanka Government International Bond	3.800	2.449	0,17	7,750 % fällig am 01.09.2022	6.800	7.288	0,51
5,875 % fällig am 16.09.2043	600	867	0,06	5,750 % fällig am 18.04.2023	200	140	0,01	7,750 % fällig am 01.09.2023	5.100	5.619	0,39
5,900 % fällig am 12.03.2031	RUB 174.900	2.356	0,16	6,125 % fällig am 25.07.2022	3.500	2.110	0,15	7,750 % fällig am 01.09.2024	4.000	4.457	0,31
6,000 % fällig am 06.10.2027	230.400	3.177	0,22	6,200 % fällig am 11.05.2027	7.100	4.079	0,28	Summe Ukraine		47.280	3,28
7,250 % fällig am 10.05.2034	219.300	3.227	0,23	6,250 % fällig am 27.07.2021	3.300	2.872	0,20	<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>			
7,650 % fällig am 10.04.2030	291.000	4.442	0,31	6,825 % fällig am 18.07.2026	3.800	2.204	0,15	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
7,700 % fällig am 23.03.2033	16.300	248	0,02	6,850 % fällig am 14.03.2024	900	551	0,04	DAE Sukuk Dfc Ltd.			
Summe Russland		29.056	2,02	6,850 % fällig am 03.11.2025	400	243	0,02	3,750 % fällig am 15.02.2026	5.300	5.459	0,38
<b>SENEGAL</b>				7,550 % fällig am 28.03.2030	7.600	4.388	0,30	DP World PLC	1.000	1.278	0,09
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				7,850 % fällig am 14.03.2029	700	407	0,03	5,625 % fällig am 25.09.2048	1.000	1.278	0,09
Senegal Government International Bond				Summe Sri Lanka		19.443	1,35	6,850 % fällig am 02.07.2037	580	798	0,05
4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 1.100	1.440	0,10	<b>ÜBERNATIONAL</b>				First Abu Dhabi Bank PJSC			
6,250 % fällig am 30.07.2024	\$ 1.379	1.523	0,10	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,000 % fällig am 30.03.2022	2.600	2.683	0,19
6,250 % fällig am 23.05.2033	2.000	2.251	0,16	Banque Ouest Africaine de Developpement	800	898	0,06	Summe Vereinigte Arabische Emirate		10.218	0,71
6,750 % fällig am 13.03.2048	600	662	0,05	5,000 % fällig am 27.07.2027				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Summe Senegal		5.876	0,41	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Emirate of Abu Dhabi Government International Bond			
<b>SERBIEN</b>				Ghana Government International Bond	200	268	0,02	2,500 % fällig am 11.10.2022	200	207	0,01
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				10,750 % fällig am 14.10.2030				2,500 % fällig am 16.04.2025	1.900	2.033	0,14
Serbia Government International Bond				Summe übernational		1.166	0,08	2,700 % fällig am 02.09.2070	6.400	5.988	0,41
2,125 % fällig am 01.12.2030	1.800	1.784	0,12	<b>TANSANIA</b>				3,125 % fällig am 03.05.2026	1.000	1.112	0,08
3,125 % fällig am 15.05.2027	€ 6.600	9.105	0,63	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				3,125 % fällig am 16.04.2030	4.700	5.317	0,37
Summe Serbien		10.889	0,75	The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania	729	724	0,05	3,125 % fällig am 30.09.2049	5.200	5.584	0,39
<b>SINGAPUR</b>				5,461 % fällig am 23.06.2022				3,875 % fällig am 16.04.2050	2.800	3.422	0,24
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Tansania				4,125 % fällig am 11.10.2047	200	252	0,02
BOC Aviation Ltd.	\$ 2.700	2.869	0,20	<b>TUNESIEN</b>				Emirate of Dubai Government International Bond	1.400	1.380	0,09
Flex Ltd.				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				3,900 % fällig am 09.09.2050		25.295	1,75
4,875 % fällig am 15.06.2029	200	236	0,02	Banque Centrale de Tunisie Government International Bond	1.000	915	0,06	Summe Vereinigte Arabische Emirate		35.513	2,46
				5,750 % fällig am 30.01.2025				<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								Afren PLC	282	7	0,00
								11,500 % fällig am 01.02.2016 ^			

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond 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
Barclays Bank PLC 10,000 % fällig am 21.05.2021	£ 200	\$ 283	0,02	Bank of America Corp. 0,981 % fällig am 25.09.2025 (f)	8.700	8.801	0,61	<b>URUGUAY</b>			
HSBC Holdings PLC 3,803 % fällig am 11.03.2025 (f) 6,000 % fällig am 22.05.2027 (c)(d)	\$ 300 800	328 873	0,02 0,06	Ford Motor Credit Co. LLC 3,550 % fällig am 07.10.2022	600	613	0,04	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Natwest Group PLC 1,691 % fällig am 15.05.2023 4,269 % fällig am 22.03.2025 5,076 % fällig am 27.01.2030 6,000 % fällig am 19.12.2023	300 200 300 200	303 221 369 229	0,02 0,01 0,03 0,02	JPMorgan Chase & Co. 0,653 % fällig am 16.09.2024 (f)	\$ 2.600	\$ 2.615	0,18	Uruguay Government International Bond 4,375 % fällig am 23.01.2031 (f) 4,975 % fällig am 20.04.2055 (f) 5,100 % fällig am 18.06.2050 (f) 7,625 % fällig am 21.03.2036 7,875 % fällig am 15.01.2033	15.900 9.900 11.350 2.680 2.730	19.542 13.773 15.925 4.350 4.371	1,36 0,96 1,10 0,30 0,30
State Savings Bank of Ukraine Via SSB PLC 9,375 % fällig am 10.03.2023	546	576	0,04	JPMorgan Structured Products BV 3,231 % fällig am 14.10.2024 (e)	1.543	1.544	0,11	Summe Uruguay		57.961	4,02
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC 8,250 % fällig am 09.07.2024	2.600	2.723	0,19	Morgan Stanley 0,864 % fällig am 21.10.2025 (f)	2.500	2.522	0,18	<b>VIETNAM</b>			
UKreximbank Via Biz Finance PLC 9,750 % fällig am 22.01.2025	2.000	2.100	0,15	Rutas 2 and 7 Finance Ltd. 0,000 % fällig am 30.09.2036 (a)	1.000	755	0,05	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Summe Großbritannien		8.012	0,56			20.830	1,45	Vietnam Government International Bond 4,800 % fällig am 19.11.2024	\$ 1.000	\$ 1.125	0,08
<b>USA</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				CitiMortgage Alternative Loan Trust 0,798 % fällig am 25.10.2036	120	96	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 0,388 % fällig am 25.02.2037 1,273 % fällig am 25.11.2035	1.186 640	1.154 629	0,08 0,04	Countrywide Alternative Loan Trust 0,498 % fällig am 25.05.2036 ^	143	59	0,00	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd. 5,125 % fällig am 15.05.2024	300	333	0,02
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 3,342 % fällig am 25.01.2037 ^	2.660	1.221	0,08	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 0,649 % fällig am 30.11.2037	600	552	0,04	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	6.984	7.921	0,55
Long Beach Mortgage Loan Trust 0,298 % fällig am 25.09.2036	1.071	791	0,05	IndyMac Mortgage Loan Trust 0,328 % fällig am 25.02.2037	357	350	0,02	Summe Jungfernseln (Britisch)		8.254	0,57
MASTR Asset-Backed Securities Trust 0,368 % fällig am 25.11.2036	1.125	849	0,06	JP Morgan Resecuritization Trust 2,500 % fällig am 25.03.2056	73	73	0,01	<b>SAMBIA</b>			
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,943 % fällig am 25.03.2034	1.188	1.166	0,08	Lehman XS Trust 0,338 % fällig am 25.09.2046 0,398 % fällig am 25.08.2037	325 1.754	319 1.634	0,02 0,11	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 0,298 % fällig am 25.07.2036	245	232	0,02	Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,448 % fällig am 25.02.2037	631	594	0,04	Zambia Government International Bond 5,375 % fällig am 20.09.2022 ^ 8,500 % fällig am 14.04.2024 ^ 8,970 % fällig am 30.07.2027 ^	1.200 2.000 1.000	631 1.081 530	0,04 0,08 0,04
Option One Mortgage Loan Trust 0,368 % fällig am 25.05.2037	294	216	0,01	SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 2,996 % fällig am 25.10.2037 ^	124	114	0,01	Summe Sambia		2.242	0,16
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 0,928 % fällig am 25.09.2035	1.000	938	0,07	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,651 % fällig am 25.03.2036	366	354	0,02	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
Saxon Asset Securities Trust 0,458 % fällig am 25.09.2037	80	78	0,01			4.539	0,31	<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>			
Soundview Home Loan Trust 0,328 % fällig am 25.02.2037 1,048 % fällig am 25.10.2037	217 166	83 145	0,01 0,01	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				13,100 % fällig am 25.05.2021 (a)(b) 13,249 % fällig am 11.05.2021 (a)(b) 13,250 % fällig am 06.04.2021 (a)(b) 13,250 % fällig am 26.10.2021 (a)(b) 13,300 % fällig am 23.11.2021 (a)(b) 13,301 % fällig am 16.02.2021 (a)(b) 13,319 % fällig am 26.01.2021 (a)(b) 13,479 % fällig am 02.03.2021 (a)(b) 13,501 % fällig am 16.02.2021 (a)(b)	EGP 12.900 80.000 18.000 6.700 30.000 35.000 25.900 57.000 19.000	782 4.870 1.110 386 1.716 2.192 1.634 3.553 1.190	0,05 0,34 0,08 0,03 0,12 0,15 0,11 0,25 0,08
Summe USA		7.502	0,52	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051 3,500 % fällig am 01.02.2051	650 2.600	683 2.752	0,05 0,19	Summe kurzfristige Instrumente	\$ 1.800	1.800	0,13
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						3.435	0,24	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.413.297	98,05	
Alphabet, Inc. 2,250 % fällig am 15.08.2060 (f)	4.100	3.980	0,28								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto-vernögens
BPS	0,090 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 66.100	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024	\$ (67.582)	\$ 66.100	\$ 66.101	4,59
FICC	0,000	31.12.2020	04.01.2021	4.321	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	(4.407)	4.321	4.321	0,30
NOM	0,080	31.12.2020	04.01.2021	45.600	U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.11.2048	(46.713)	45.600	45.600	3,16
	0,100	31.12.2020	04.01.2021	22.300	U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.05.2048	(22.848)	22.300	22.300	1,55
<b>Total Repurchase Agreements</b>						<b>\$ (141.550)</b>	<b>\$ 138.321</b>	<b>\$ 138.322</b>	<b>9,60</b>

<sup>(1)</sup> 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-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	241	\$ (18)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	97	28	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	362	36	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	61	(253)	(0,02)
				\$ (207)	(0,02)
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ (207)</b>	<b>(0,02)</b>

## 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 Netto- vermögens
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250 %	16.06.2031	€ 1.500	\$ 2	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2026	1.800	5	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,470	21.04.2025	MXN 32.600	(20)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,520	24.04.2025	31.000	(19)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,615	23.04.2025	128.300	(77)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,100	26.02.2025	126.600	75	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,100	28.02.2025	66.100	36	0,00
					\$ 2	0,00
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 2</b>	<b>0,00</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GST	Turkey Government International Bond	(1,000) %	20.12.2024	\$ 2.800	\$ 343	\$ (157)	\$ 186	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2022	\$ 3.500	\$ (13)	\$ 36	\$ 23	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	13.800	(33)	275	242	0,02
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2021	1.900	(22)	40	18	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2023	5.000	63	35	98	0,01
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2022	1.300	(31)	37	6	0,00
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	300	(1)	3	2	0,00
BRC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	800	(96)	33	(63)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.000	0	16	16	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	600	(43)	47	4	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	400	(1)	4	3	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(3)	8	5	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	3	9	12	0,00
DUB	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.000	(10)	36	26	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2022	2.100	(15)	20	5	0,00
FBF	Egypt Government International Bond	1,000	20.12.2021	1.600	(136)	125	(11)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	800	(3)	8	5	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	14.000	(34)	239	205	0,02
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.03.2024	200	(27)	31	4	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	(5)	12	7	0,00
JPM	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)	77	36	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.400	16	43	59	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.500	(40)	17	(23)	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	900	(4)	10	6	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	1.200	(9)	25	16	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.600	34	1	35	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2025	12.000	38	42	80	0,01
MYI	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	7.600	(117)	147	30	0,00
	Ukraine Government International Bond	1,000	20.12.2021	7.500	(230)	102	(128)	(0,01)
					\$ (734)	\$ 1.477	\$ 743	0,05

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond ESG 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	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2021	\$	4.388	¥ 456.358	\$ 32	\$ 0	0,00	
	01.2021	ZAR	65.460	\$ 4.238	0	(207)	(0,01)	
BPS	01.2021	€	102	124	0	(1)	0,00	
	01.2021	£	182	243	0	(6)	0,00	
	01.2021	ZAR	88.895	5.759	6	(288)	(0,02)	
	02.2021	AUD	12.621	9.146	0	(597)	(0,04)	
CBK	01.2021	€	3.912	4.702	0	(85)	(0,01)	
	01.2021	PEN	12.910	3.577	8	0	0,00	
	01.2021	RUB	419	5	0	0	0,00	
	01.2021	\$	948	€ 782	9	0	0,00	
	01.2021		427	¥ 44.491	4	0	0,00	
	01.2021		105	MXN 2.234	7	0	0,00	
	02.2021	EGP	19.000	\$ 1.152	0	(42)	0,00	
	02.2021	RUB	487	7	0	0	0,00	
	03.2021	\$	211	CNH 1.409	5	0	0,00	
	04.2021	EGP	17.989	\$ 1.078	0	(39)	0,00	
GLM	01.2021	¥	935.800	9.041	0	(23)	0,00	
	01.2021	PEN	10.379	2.881	11	0	0,00	
	01.2021	RUB	521	7	0	0	0,00	
	02.2021	DOP	88.585	1.502	0	(16)	0,00	
	02.2021	RUB	212.766	2.790	0	(75)	(0,01)	
	02.2021	\$	9.044	¥ 935.800	23	0	0,00	
	03.2021	DOP	68.735	\$ 1.156	0	(16)	0,00	
	05.2021		2.399	40	0	0	0,00	
HUS	01.2021	€	4.444	5.338	0	(100)	(0,01)	
	01.2021	\$	789	¥ 82.192	7	0	0,00	
	01.2021		103	MXN 2.093	2	0	0,00	
	01.2021	ZAR	28.579	\$ 1.947	2	0	0,00	
	02.2021	RUB	142.761	1.910	0	(13)	0,00	
	03.2021	EGP	57.000	3.440	0	(128)	(0,01)	
	04.2021	\$	2.787	EGP 44.759	0	(17)	0,00	
	06.2021		2.853	46.589	0	(1)	0,00	
JPM	01.2021	€	5.253	\$ 6.414	0	(14)	0,00	
	01.2021	\$	73	CLP 57.311	8	0	0,00	
	01.2021		293	MXN 5.898	3	0	0,00	
	01.2021	ZAR	9.980	\$ 654	0	(24)	0,00	
MYI	01.2021	€	1.667	2.042	3	0	0,00	
	01.2021	£	10	14	0	0	0,00	
	01.2021	\$	39	£ 29	0	0	0,00	
	01.2021	ZAR	43.012	\$ 2.775	0	(146)	(0,01)	
	02.2021	RUB	176.661	2.393	13	0	0,00	
SCX	01.2021	€	79.045	94.664	0	(2.052)	(0,14)	
	01.2021	\$	544	ZAR 7.990	0	(1)	0,00	
	02.2021	€	79.045	\$ 96.781	0	(1)	0,00	
	03.2021	CNY	1.355	205	0	(2)	0,00	
TOR	01.2021	\$	3.381	¥ 352.759	35	0	0,00	
	01.2021	ZAR	35.249	\$ 2.398	0	(2)	0,00	
UAG	02.2021	RUB	469.783	6.173	0	(155)	(0,01)	
					\$ 178	\$ (4.051)	\$ (3.873)	(0,27)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend 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
BPS	01.2021	\$	215.396	€ 179.354	\$ 4.076	\$ (22)	0,28
BRC	01.2021		787	644	1	0	0,00
CBK	01.2021		13.714	11.418	257	0	0,02
HUS	01.2021		182.722	150.379	1.324	(36)	0,09
JPM	01.2021		10.746	8.800	23	0	0,00
MYI	01.2021		1.717	1.408	6	0	0,00
SCX	01.2021		243.789	203.563	5.282	0	0,37

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
TOR	02.2021	\$ 483.500	€ 394.891	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	01.2021	229.858	191.931	4.979	0	4.979	0,34
	02.2021	191.040	156.029	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 15.948	\$ (61)	\$ 15.887	1,10

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse 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	01.2021	£ 7	\$ 10	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 26	£ 20	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	37	28	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	£ 19	\$ 25	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 1.256	£ 939	28	0	28	0,00
HUS	01.2021	1.453	1.086	32	0	32	0,00
MYI	01.2021	£ 2	\$ 2	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 300	£ 223	6	0	6	0,00
SCX	01.2021	27	20	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	1.522	1.140	37	0	37	0,01
				\$ 104	\$ 0	\$ 104	0,01

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse Investor 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	01.2021	\$ 293	NOK 2.588	\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,00
BRC	01.2021	263	2.307	7	0	7	0,00
MYI	01.2021	322	2.849	11	0	11	0,00
				\$ 27	\$ 0	\$ 27	0,00

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse Investor 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	01.2021	SEK 73	\$ 9	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 11	SEK 87	0	0	0	0,00
BPS	01.2021	55	447	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	411	3.464	11	0	11	0,00
CBK	01.2021	48	408	2	0	2	0,00
HUS	01.2021	455	3.875	16	0	16	0,01
MYI	01.2021	460	3.894	15	0	15	0,00
SCX	01.2021	SEK 141	\$ 17	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 4	SEK 31	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	SEK 20	\$ 2	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 37	SEK 314	1	0	1	0,00
				\$ 45	\$ 0	\$ 45	0,01

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 13.119 0,91

Summe Anlagen

\$ 1.564.532 108,54

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (123.075) (8,54)

Nettovermögen

\$ 1.441.457 100,00

## 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) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (e) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
JPMorgan Structured Products BV	3,231 %	14.10.2024	18.10.2019	\$ 1.543	\$ 1.544	0,11

(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 133.579 als Sicherheiten verpfändet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 1.577 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 2.164 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 220 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(207)	13.121	0	12.914
<b>Summen</b>	<b>\$ (207)</b>	<b>\$ 1.564.015</b>	<b>\$ 724</b>	<b>\$ 1.564.532</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 730.284	\$ 4.647	\$ 734.931
Pensionsgeschäfte	0	56.153	0	56.153
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(707)	8.229	0	7.522
<b>Summen</b>	<b>\$ (707)</b>	<b>\$ 794.666</b>	<b>\$ 4.647</b>	<b>\$ 798.606</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	0,400 %	01.12.2020	29.01.2021	\$ (21.130)	\$ (21.137)	(1,47)
	0,400	04.12.2020	29.01.2021	(11.104)	(11.107)	(0,77)
	0,480	29.10.2020	03.03.2021	(4.291)	(4.294)	(0,30)
CFR	(1,150)	03.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	€ (293)	(358)	(0,02)
JML	0,320	15.12.2020	15.01.2021	\$ (2.698)	(2.699)	(0,19)
SCX	0,530	04.11.2020	02.02.2021	(12.839)	(12.850)	(0,89)
	0,550	13.10.2020	19.01.2021	(10.887)	(10.900)	(0,76)
	0,550	22.10.2020	20.01.2021	(10.156)	(10.167)	(0,70)
	0,550	26.10.2020	25.01.2021	(11.484)	(11.496)	(0,80)
	0,600	09.10.2020	12.01.2021	(22.608)	(22.640)	(1,57)
TDM	0,300	15.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(15.145)	(15.147)	(1,05)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (122.795)</b>	<b>(8,52)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 221	\$ (280)	\$ (59)
BPS	3.170	(4.160)	(990)
BRC	(23)	0	(23)
CBK	174	0	174
DUB	31	(30)	1
FBF	(11)	20	9
GLM	(96)	0	(96)
GST	400	(560)	(160)
HUS	1.095	(1.910)	(815)
JPM	93	(90)	3
MYC	137	0	137
MYI	(190)	200	10
SCX	3.224	(3.970)	(746)
SSB	38	0	38
TOR	5.011	(6.210)	(1.199)
UAG	(155)	0	(155)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,96	83,51
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	13,02	17,99
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,07	k. A.
Pensionsgeschäfte	9,60	7,75
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	(0,10)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	0,05
Freiverkehrsfinanzderivate	0,91	1,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(8,52)	(4,64)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Argentinien	2,15	2,43
Armenien	0,06	0,11
Österreich	0,02	0,05
Aserbaidschan	0,04	0,00
Bahamas	0,22	0,46
Bahrain	0,46	0,91
Weissrussland	0,30	0,15
Brasilien	4,43	3,64
Cayman-Inseln	3,03	3,26
Chile	2,48	3,99
China	0,97	0,80
Kolumbien	2,26	2,93
Costa Rica	0,72	1,28
Kroatien	0,12	0,36
Dominikanische Republik	4,03	4,29
Ecuador	1,57	2,22
Ägypten	4,80	2,53
El Salvador	0,66	1,08
Gabun	k. A.	0,07
Deutschland	0,36	0,57
Ghana	1,82	1,75
Guatemala	1,34	1,83
Guernsey, Kanalinseln	0,31	k. A.
Hongkong	1,59	1,15
Ungarn	1,67	k. A.
Indien	1,35	1,63
Indonesien	2,47	2,78
Irland	0,17	1,09
Insel Man	0,27	0,11
Israel	0,65	0,06
Elfenbeinküste	1,63	0,17
Jamaika	0,36	0,39
Jordanien	0,73	0,56
Kasachstan	1,50	1,52
Kenia	0,92	0,97
Luxemburg	0,30	0,62
Malaysia	0,87	k. A.
Mauritius	1,31	1,52
Mexiko	2,16	2,52
Mongolei	0,60	0,81
Marokko	1,08	0,00
Multinational	0,04	k. A.
Namibia	0,21	0,14
Niederlande	1,81	1,52
Oman	2,62	3,51
Panama	2,65	1,23
Paraguay	0,94	0,58
Peru	2,53	1,22
Philippinen	1,87	k. A.
Katar	2,23	2,46
Rumänien	2,20	1,45
Russland	2,02	4,53
Senegal	0,41	0,92
Serbien	0,75	0,93
Singapur	0,23	0,53
Südafrika	5,02	2,96
Südkorea	0,94	0,94
Sri Lanka	1,35	1,96
Supranational	0,08	0,15
Tansania	0,05	0,22
Tunesien	0,06	k. A.
Türkei	3,27	5,56
Ukraine	3,28	3,51
Vereinigte Arabische Emirate	2,46	1,36
Großbritannien	0,56	0,65
USA	2,52	9,06
Uruguay	4,02	4,78

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Vietnam	0,08	0,15
Jungferninseln (Britisch)	0,57	0,10
Sambia	0,16	0,33
Kurzfristige Instrumente	1,34	0,14
Pensionsgeschäfte	9,60	7,75
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,02)	(0,10)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,00	0,05
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,01	0,23
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,05	0,05
Zinsswaps	k. A.	(0,03)
Devisenterminkontrakte	(0,27)	(0,17)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,12	1,01
Sonstige Aktiva und Passiva	(8,54)	(10,29)
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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
Ukraine				Interoceanica Finance Ltd.	83	80	0,03	8,625 % fällig am 24.04.2024	1.100		
5,490 % fällig am 29.06.2021	\$	800	0,31	Itau Unibanco Holding S.A.	\$	500	0,20	Afren PLC	\$	2.525	0,00
		800		2,900 % fällig am 24.01.2023		512		6,625 % fällig am 09.12.2020 ^		13	0,00
				Kaisa Group Holdings Ltd.				10,250 % fällig am 08.04.2019 ^	607	16	0,01
				9,375 % fällig am 30.06.2024				11,500 % fällig am 01.02.2016 ^	26.874	685	0,26
				11,250 % fällig am 16.04.2025	1.200	1.233	0,47	Aker BP ASA	700	738	0,28
				Kuwait Projects Co. SPC Ltd.	1.100	1.143	0,44	3,750 % fällig am 15.01.2030			
				4,229 % fällig am 29.10.2026	1.382	1.428	0,55	ALROSA Finance S.A.	200	206	0,08
				4,500 % fällig am 23.02.2027				3,100 % fällig am 25.06.2027	1.300	1.408	0,54
				MAF Sukuk Ltd.	1.020	1.124	0,43	4,650 % fällig am 09.04.2024			
				4,500 % fällig am 03.11.2025				Altice Financing S.A.	€	1.200	1,421
				Multibank, Inc.	1.100	1.138	0,43	2,250 % fällig am 15.01.2025	\$	1.202	697
				4,375 % fällig am 09.11.2022				Andrade Gutierrez International S.A.			
				Muthoot Finance Ltd.	700	715	0,27	9,500 % fällig am 30.12.2024			
				4,400 % fällig am 02.09.2023	500	525	0,20	AngloGold Ashanti Holdings PLC	1.300	1.370	0,52
				6,125 % fällig am 31.10.2022				5,125 % fällig am 01.08.2022	1.000	1.259	0,48
				Natwest Group PLC	€	200	0,11	6,500 % fällig am 15.04.2040			
				5,125 % fällig am 12.05.2027				Antofagasta PLC	200	201	0,08
				(e)(g)				2,375 % fällig am 14.10.2030			
				New Metro Global Ltd.	\$	1.100	0,45	Axiata SPV2 Bhd.	1.700	1.720	0,66
				6,800 % fällig am 05.08.2023				2,163 % fällig am 19.08.2030			
				Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.	1.900	1.932	0,74	Baidu, Inc.	300	308	0,12
				1,832 % fällig am 10.09.2030 (g)				2,375 % fällig am 09.10.2030			
				Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd.	700	730	0,28	Braskem Idesa SAPI	300	282	0,11
				3,950 % fällig am 05.02.2023				7,450 % fällig am 15.11.2029			
				Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	1.300	1.322	0,51	BRF S.A.	300	334	0,13
				5,950 % fällig am 30.04.2025				5,750 % fällig am 21.09.2050			
				QNB Finance Ltd.	900	950	0,36	Cable Onda S.A.	400	441	0,17
				2,625 % fällig am 12.05.2025	1.348	1.449	0,55	4,500 % fällig am 30.01.2030			
				3,500 % fällig am 28.03.2024				Canacol Energy Ltd.	1.500	1.610	0,62
				QNB Finansbank A/S	400	410	0,16	7,250 % fällig am 03.05.2025			
				4,875 % fällig am 19.05.2022	500	547	0,21	Celestial Dynasty Ltd.	500	518	0,20
				6,875 % fällig am 07.09.2024				4,250 % fällig am 27.06.2029			
				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.	2.300	2.464	0,94	Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK)			
				5,250 % fällig am 23.05.2023 (g)				10,000 % fällig am 09.11.2024			
				(e)(g)				^ (a)	816	53	0,02
				Seazen Group Ltd.	300	314	0,12	Corp. GEO S.A.B. de C.V.	850	0	0,00
				6,000 % fällig am 12.08.2024				8,875 % fällig am 25.09.2014 ^			
				Shinhan Bank Co. Ltd.	900	1.044	0,40	DAE Funding LLC	1.300	1.335	0,51
				4,500 % fällig am 26.03.2028				5,000 % fällig am 01.08.2024			
				Societe Generale S.A.	200	205	0,08	Digicel International Finance Ltd.	145	153	0,06
				7,375 % fällig am 17.04.2024				8,750 % fällig am 25.05.2024			
				(e)(g)				DP World PLC	€	1.000	1,281
				Sovcombank Via SovCom Capital DAC	1.300	1.397	0,53	2,375 % fällig am 25.09.2026			
				8,000 % fällig am 07.04.2030 (g)				Ecopetrol S.A.	\$	1.000	1,373
				SPARC EM SPC Panama Metro Line SP	739	722	0,28	7,375 % fällig am 18.09.2043			
				0,000 % fällig am 05.12.2022 (c)				Embotelladora Andina S.A.	200	225	0,09
				Sunac China Holdings Ltd.	500	519	0,20	3,950 % fällig am 21.01.2050			
				6,500 % fällig am 09.07.2023	300	310	0,12	Embraer Netherlands Finance BV	1.600	1.698	0,65
				6,500 % fällig am 10.01.2025	800	836	0,32	5,050 % fällig am 15.06.2025			
				7,000 % fällig am 09.07.2025				Empresa Electrica Cochran SpA	271	286	0,11
				SURA Asset Management S.A.	300	329	0,12	5,500 % fällig am 14.05.2027			
				4,875 % fällig am 17.04.2024				First Quantum Minerals Ltd.	900	978	0,37
				Trust Fibra Uno	400	469	0,18	6,875 % fällig am 15.10.2027			
				6,390 % fällig am 15.01.2050	700	861	0,33	Fortune Star BVI Ltd.	800	841	0,32
				6,950 % fällig am 30.01.2044				5,950 % fällig am 19.10.2025			
				Türkiye Is Bankasi A/S	200	205	0,08	Fresnillo PLC	1.100	1.210	0,46
				6,125 % fällig am 25.04.2024				4,250 % fällig am 02.10.2050			
				United Bank for Africa PLC	1.100	1.133	0,43	Frontera Energy Corp.	900	854	0,33
				7,750 % fällig am 08.06.2022				9,700 % fällig am 25.06.2023			
				Woori Bank	1.000	1.115	0,43	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	2.200	2.497	0,96
				4,750 % fällig am 30.04.2024 (g)				4,950 % fällig am 23.03.2027			
				Yangon Justice International Ltd.	400	411	0,16	Geely Automobile Holdings Ltd.	600	611	0,23
				7,500 % fällig am 17.02.2025				4,000 % fällig am 09.12.2024 (e)			
						67.019	25,65	Gohl Capital Ltd.	1.000	1.065	0,41
								4,250 % fällig am 24.01.2027			
				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	1.300	1.583	0,61
				ABJA Investment Co. Pte. Ltd.	700	747	0,29	6,125 % fällig am 15.05.2029			
				5,450 % fällig am 24.01.2028				Gran Tierra Energy, Inc.	1.900	1.311	0,50
				Adani Electricity Mumbai Ltd.	400	425	0,16	7,750 % fällig am 23.05.2027			
				3,949 % fällig am 12.02.2030				Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.	1.300	1.362	0,52
				Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	500	521	0,20	5,625 % fällig am 24.10.2024			
				3,375 % fällig am 24.07.2024				Hikma Finance USA LLC	700	730	0,28
				Adani Transmission Ltd.	386	410	0,16	3,250 % fällig am 09.07.2025			
				4,250 % fällig am 21.05.2036				Huaxin Cement International Finance Co. Ltd.	600	601	0,23
				Adecogro S.A.	1.300	1.368	0,52	2,250 % fällig am 19.11.2025			
				6,000 % fällig am 21.09.2027							
				ADES International Holding PLC							

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
ICL Group Ltd. 6,375 % fällig am 31.05.2038	\$ 400	\$ 530	0,20	Petroleos Mexicanos 5,950 % fällig am 28.01.2031	800	799	0,31	YPF S.A. 8,750 % fällig am 04.04.2024	\$ 800	\$ 705	0,27
IHS Netherlands Holdco BV 7,125 % fällig am 18.03.2025 8,000 % fällig am 18.09.2027	1.100 1.060	1.158 1.147	0,44 0,44	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3,050 % fällig am 23.01.2025	\$ 1.300	\$ 1.356	0,52	Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	2.500	2.499	0,96
Industrias Penoles S.A.B. de C.V. 4,750 % fällig am 06.08.2050	600	697	0,27	Prosus NV 3,832 % fällig am 08.02.2051 4,027 % fällig am 03.08.2050 4,850 % fällig am 06.07.2027 5,500 % fällig am 21.07.2025	900 300 2.200 560	885 316 2.539 645	0,34 0,12 0,97 0,25	Zoomlion HK SPV Co. Ltd. 6,125 % fällig am 20.12.2022	1.200	1.260	0,48
International Airport Finance S.A. 12,000 % fällig am 15.03.2033	898	894	0,34	Proven Honour Capital Ltd. 4,125 % fällig am 19.05.2025	500	525	0,20			127.687	48,89
Invepar Holdings LLC 8,875 % fällig am 31.12.2049 (h)	210	0	0,00	RCS & RDS S.A. 2,500 % fällig am 05.02.2025 3,250 % fällig am 05.02.2028	€ 1.100 200	1.339 245	0,51 0,09	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
JBS Investments GmbH 7,000 % fällig am 15.01.2026	2.200	2.378	0,91	Rede D'or Finance SARL 4,500 % fällig am 22.01.2030	\$ 400	418	0,16	Azure Power Energy Ltd. 5,500 % fällig am 03.11.2022	700	719	0,27
Kimberly-Clark de Mexico S.A.B. de C.V. 2,431 % fällig am 01.07.2031	300	310	0,12	ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	500	532	0,20	Bharti Airtel International Netherlands BV 5,350 % fällig am 20.05.2024	700	774	0,30
Kosmos Energy Ltd. 7,125 % fällig am 04.04.2026	1.710	1.663	0,64	Rumo Luxembourg SARL 5,250 % fällig am 10.01.2028	300	325	0,12	Contemporary Ruiding Development Ltd. 1,875 % fällig am 17.09.2025 2,625 % fällig am 17.09.2030	1.300 700	1.314 712	0,50 0,27
Latam Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.08.2029 4,500 % fällig am 15.08.2025	1.806 967	1.684 571	0,64 0,22	Samarco Mineracao S.A. 4,125 % fällig am 01.11.2022 ^ 5,375 % fällig am 26.09.2024 ^ 5,750 % fällig am 24.10.2023 ^	445 950 1.800	317 684 1.295	0,12 0,26 0,50	DTEK Finance PLC 10,750 % fällig am 31.12.2024 ^	897	573	0,22
Lenovo Group Ltd. 5,875 % fällig am 24.04.2025	1.500	1.730	0,66	Sands China Ltd. 3,800 % fällig am 08.01.2026 4,375 % fällig am 18.06.2030	200 400	214 447	0,08 0,17	FS Luxembourg SARL 10,000 % fällig am 15.12.2025	500	542	0,21
Leviathan Bond Ltd. 6,125 % fällig am 30.06.2025 6,500 % fällig am 30.06.2027	300 300	331 339	0,13 0,13	SASOL Financing USA LLC 6,500 % fällig am 27.09.2028	2.700	2.938	1,12	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. 6,000 % fällig am 27.11.2023	2.200	2.462	0,94
Li & Fung Ltd. 4,500 % fällig am 18.08.2025	300	307	0,12	Saudi Arabian Oil Co. 2,250 % fällig am 24.11.2030 2,875 % fällig am 16.04.2024 3,250 % fällig am 24.11.2050	2.400 1.400 1.800	2.447 1.487 1.829	0,94 0,57 0,70	Genneia S.A. 8,750 % fällig am 20.01.2022	1.600	1.484	0,57
Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025 5,750 % fällig am 21.07.2028	600 700	620 747	0,24 0,29	Severstal OAO Via Steel Capital S.A. 3,150 % fällig am 16.09.2024	2.000	2.096	0,80	Greenko Dutch BV 4,875 % fällig am 24.07.2022	300	304	0,12
Metinvest BV 5,625 % fällig am 17.06.2025	€ 1.050	1.339	0,51	Sibur Securities DAC 3,450 % fällig am 23.09.2024	1.100	1.160	0,44	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025 5,950 % fällig am 29.07.2026	1.000 300	1.040 326	0,40 0,12
8,500 % fällig am 23.04.2026	\$ 1.800	2.029	0,78	Stillwater Mining Co. 7,125 % fällig am 27.06.2025	1.990	2.107	0,81	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	1.250	1.325	0,51
MGM China Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 18.06.2025 5,375 % fällig am 15.05.2024	200 1.100	208 1.139	0,08 0,44	Studio City Finance Ltd. 6,500 % fällig am 15.01.2028	300	322	0,12	Israel Electric Corp. Ltd. 5,000 % fällig am 12.11.2024	2.000	2.265	0,87
MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC 2,550 % fällig am 11.09.2025 6,625 % fällig am 14.10.2022	200 500	205 546	0,08 0,21	Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 3,750 % fällig am 23.01.2023	1.000	1.045	0,40	Lamar Funding Ltd. 3,958 % fällig am 07.05.2025	2.600	2.563	0,98
MMK International Capital DAC 4,375 % fällig am 13.06.2024	1.100	1.188	0,45	Suzano Austria GmbH 7,000 % fällig am 16.03.2047	1.000	1.336	0,51	Lukoil Securities BV 3,875 % fällig am 06.05.2030	2.000	2.166	0,83
Mobile Telesystems OJSC Via MTS International Funding DAC 5,000 % fällig am 30.05.2023	800	859	0,33	Tencent Holdings Ltd. 2,390 % fällig am 03.06.2030	1.600	1.646	0,63	MSU Energy S.A. 6,875 % fällig am 01.02.2025	2.300	1.638	0,63
MTN Mauritius Investments Ltd. 4,755 % fällig am 11.11.2024	900	952	0,36	Tengischevroil Finance Co. International Ltd. 3,250 % fällig am 15.08.2030	900	955	0,37	Neerg Energy Ltd. 6,000 % fällig am 13.02.2022	1.200	1.223	0,47
NBM U.S. Holdings, Inc. 7,000 % fällig am 14.05.2026	1.600	1.744	0,67	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 2,800 % fällig am 21.07.2023	3.900	3.869	1,49	Odebrecht Drilling Norbe Ltd. 6,350 % fällig am 01.12.2021 ^	156	150	0,06
Nexa Resources S.A. 6,500 % fällig am 18.01.2028	900	1.063	0,41	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1,625 % fällig am 24.09.2025	700	699	0,27	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^	2.158	2.045	0,78
Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC 4,000 % fällig am 21.09.2024 (i) 4,500 % fällig am 15.06.2023 4,700 % fällig am 30.05.2026	800 400 600	860 429 680	0,33 0,16 0,26	Tullow Oil PLC 7,000 % fällig am 01.03.2025	1.200	804	0,31	Pampa Energia S.A. 7,375 % fällig am 21.07.2023	500	477	0,18
OAS Restructuring BVI Ltd. (0,250 % bar und 4,750 % PIK) 5,000 % fällig am 31.03.2035 (a)(h)	BR 475	5	0,00	Turkish Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.09.2028	664	552	0,21	Petrobras Global Finance BV 4,750 % fällig am 14.01.2025 7,250 % fällig am 17.03.2044	€ 1.600 \$ 700	2.246 905	0,86 0,35
OCP S.A. 4,500 % fällig am 22.10.2025	\$ 700	764	0,29	Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari A/S 6,950 % fällig am 14.03.2026	1.700	1.895	0,73	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028 9,250 % fällig am 06.07.2024 9,750 % fällig am 06.01.2027	3.822 146 467	4.309 162 542	1,65 0,06 0,21
6,875 % fällig am 25.04.2044	700	919	0,35	Unigel Luxembourg S.A. 8,750 % fällig am 01.10.2026	1.200	1.296	0,50	Southern Gas Corridor CJSC 6,875 % fällig am 24.03.2026	900	1.092	0,42
Odebrecht Finance Ltd. 4,375 % fällig am 25.04.2025 ^ 5,250 % fällig am 27.06.2029 ^ 7,125 % fällig am 26.06.2042 ^	1.250 1.500 2.550	56 64 108	0,02 0,02 0,04	Uralkali OJSC Via Uralkali Finance DAC 4,000 % fällig am 22.10.2024	200	209	0,08	Star Energy Geothermal Darajat 4,850 % fällig am 14.10.2038	400	448	0,17
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd. 0,000 % fällig am 01.02.2021 (c)(e)	1.416	10	0,00	Vale Overseas Ltd. 3,750 % fällig am 08.07.2030 6,875 % fällig am 21.11.2036	400 1.300	445 1.909	0,17 0,73	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	1.088	1.235	0,47
Oztel Holdings SPC Ltd. 6,625 % fällig am 24.04.2028	400	431	0,17	Votorantim Cimentos International S.A. 7,250 % fällig am 05.04.2041	200	273	0,10	Total Play Telecomunicaciones S.A. de C.V. 7,500 % fällig am 12.11.2025	2.000	2.000	0,76
Pertamina Persero PT 5,625 % fällig am 20.05.2043	1.100	1.364	0,52	Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024 5,500 % fällig am 15.01.2026	1.000 1.000	1.016 1.041	0,39 0,40	Turk Telekomunikasyon A/S 6,875 % fällig am 28.02.2025	500	553	0,21
Perusahaan Gas Negara Tbk PT 5,125 % fällig am 16.05.2024	400	445	0,17	Yingde Gases Investment Ltd. 6,250 % fällig am 19.01.2023	1.300	1.344	0,51			37.594	14,39
Petra Diamonds U.S. Treasury PLC 7,250 % fällig am 01.05.2022 ^	1.200	470	0,18					Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		232.300	88,93
								<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>			
								U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045 (i)(j)	8.600	11.161	4,27
								U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.01.2022 (i) 2,000 % fällig am 31.12.2021	10.500 1.000	10.699 1.019	4,10 0,39
										22.879	8,76

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	
<b>NON-AGENCY-MBS</b>												
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				Export-Credit Bank of Turkey				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				
0,378 % fällig am 25.10.2035	\$ 815	798	0,30	8,250 % fällig am 24.01.2024	1.200	1.303	0,50	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>				
Citigroup Mortgage Loan Trust				Provincia de Cordoba				(3,480) % fällig am				
3,236 % fällig am 25.08.2036	521	489	0,19	7,450 % fällig am 01.09.2024	1.500	938	0,36	13.09.2021 (c)(d)	ARS	8.310	\$ 61	0,02
Countrywide Alternative Loan Trust				Provincia de Entre Rios Argentina				Summe kurzfristige Instrumente			61	0,02
0,472 % fällig am 20.12.2035	71	66	0,02	8,750 % fällig am 08.02.2025 ^	150	86	0,03	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 262.961	100,67	
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Provincia de Neuquen				<b>AKTIEN</b>				
3,105 % fällig am 25.11.2037	48	47	0,02	2,500 % fällig am 27.04.2030 ^	1.033	664	0,26	<b>INVESTMENTFONDS</b>				
		1.400	0,53	Ukraine Government International Bond				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				
				0,000 % fällig am 31.05.2040	600	620	0,24	PIMCO Select Funds plc -				
						3.622	1,39	PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	39.263	391	0,14	
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>												
Citigroup Mortgage Loan Trust				<b>AKTIEN</b>				PIMCO Specialty Funds Ireland				
6,750 % fällig am 25.05.2036	469	337	0,13	<b>STAMMAKTIEN</b>				p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)	25.272	328	0,13	
Countrywide Asset-Backed Certificates				<b>ENERGIE</b>						719	0,27	
0,368 % fällig am 25.09.2037 ^	70	67	0,03	<b>FINANZWERTE</b>				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>				
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				<b>Hipotecaria Su Casita S.A. (b)</b>				PIMCO ETFs plc - PIMCO				
0,338 % fällig am 25.04.2037	169	129	0,05	<b>0,000 %</b>				US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	1.000	102	0,04	
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				<b>OPTIONSSCHEINE</b>				Summe Investmentfonds		\$ 821	0,31	
1,123 % fällig am 25.12.2035	1.100	1.038	0,40	<b>OAS S.A. - Exp. 21.01.2039 (h)</b>								
NovaStar Mortgage Funding Trust				<b>2</b>								
0,348 % fällig am 25.09.2037	204	196	0,07	<b>0,00</b>								
		1.767	0,68									
<b>STAATSEMISSIONEN</b>												
Angolan Government International Bond												
0,125 % fällig am 09.07.2030	\$ 18	7	0,00									
0,125 % fällig am 09.07.2035	11	4	0,00									

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 921	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (940)	\$ 921	\$ 921	0,35
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (940)	\$ 921	\$ 921	0,35

(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
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	71	\$ 8	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	5	(4)	0,00
				\$ 4	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 4	0,00

**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<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	\$ 9.785	\$ (391)	(0,15)

**ZINSSWAPS**

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI		9,650 %	02.01.2025	BRL 11.000	\$ 491	0,19
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,750	21.06.2047	\$ 2.700	(722)	(0,28)
						\$ (231)	(0,09)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (622)	(0,24)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Corporate 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) 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 <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700 %	17.03.2021	500	\$ (1)	\$ (1)	0,00
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	900	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	1.400	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	1.200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	1.200	(2)	(2)	0,00
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	900	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	2.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	2.000	(3)	(3)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	500	(1)	(1)	0,00
GST	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	1.200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	1.200	(1)	(1)	0,00
						\$ (16)	\$ (15)	(0,01)

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

##### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.12.2024	\$ 2.700	\$ 10	\$ 5	\$ 15	0,01
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2023	2.000	31	(69)	(38)	(0,01)
BPS	Colombia Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.700	(5)	(34)	(39)	(0,01)
CBK	Colombia Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.700	11	(51)	(40)	(0,02)
GST	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	2.400	34	(32)	2	0,00
JPM	Chile Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.700	(45)	(31)	(76)	(0,03)
MYC	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.700	(3)	(44)	(47)	(0,02)
					\$ 33	\$ (256)	\$ (223)	(0,08)

##### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	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)	\$ 39	\$ 9	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.

#### ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz		Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
	Zinssatz	Variabler Zinssatzindex							
GLM	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,493 %	17.06.2025	CNY 1.700	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
NGF	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,458	17.06.2025	37.400	0	(44)	(44)	(0,02)
						\$ 0	\$ (45)	\$ (45)	(0,02)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	¥ 28.358	\$ 273	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	03.2021	\$ 120	HKD 933	0	0	0	0,00
BPS	01.2021	£ 200	\$ 267	0	(6)	(6)	0,00
	01.2021	\$ 1.041	€ 853	3	0	3	0,00
BRC	01.2021	BRL 1.464	\$ 276	0	(6)	(6)	0,00
	01.2021	\$ 282	BRL 1.464	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	BRL 1.464	\$ 282	0	0	0	0,00
	01.2021	¥ 2.765	\$ 27	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 289	BRL 1.464	0	(8)	(8)	0,00
	02.2021	BRL 1.464	\$ 289	7	0	7	0,00
GLM	01.2021	\$ 562	¥ 58.151	1	0	1	0,00
	02.2021	¥ 58.151	\$ 562	0	(1)	(1)	0,00
	03.2021	CNH 10.469	1.586	0	(18)	(18)	(0,01)
HUS	01.2021	€ 562	673	0	(14)	(14)	(0,01)
	01.2021	¥ 5.107	49	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 476	€ 392	4	0	4	0,00
	03.2021	1.371	CNY 9.092	20	0	20	0,01
MYI	01.2021	€ 19	\$ 23	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 121	€ 98	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	€ 9.971	\$ 11.941	0	(260)	(260)	(0,10)
	02.2021	9.971	12.208	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	¥ 21.920	210	0	(2)	(2)	0,00
UAG	01.2021	€ 864	1.050	0	(7)	(7)	0,00
				\$ 35	\$ (325)	\$ (290)	(0,11)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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 Nettovermögens
BOA	01.2021	\$ 5.568	CHF 5.029	\$ 122	\$ 0	\$ 122	0,05
BPS	01.2021	CHF 6	\$ 6	0	0	0	0,00
FBF	01.2021	12	13	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	54	61	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 6.093	CHF 5.518	150	0	150	0,06
SCX	01.2021	468	423	11	0	11	0,00
SSB	01.2021	CHF 59	\$ 67	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 6.143	CHF 5.535	120	0	120	0,05
UAG	01.2021	CHF 37	\$ 42	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 79	CHF 70	1	0	1	0,00
				\$ 404	\$ (1)	\$ 403	0,16

Zum 31. Dezember 2020 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
BPS	01.2021	€ 10.971	\$ 13.407	\$ 8	\$ (28)	\$ (20)	(0,01)
	01.2021	\$ 62.805	€ 52.408	1.319	0	1.319	0,51
BRC	01.2021	€ 106	\$ 130	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	1.422	1.725	0	(16)	(16)	(0,01)
	01.2021	\$ 581	€ 482	10	0	10	0,00
HUS	01.2021	€ 1.546	\$ 1.875	0	(17)	(17)	(0,01)
	01.2021	\$ 5.630	€ 4.696	117	0	117	0,05
JPM	01.2021	€ 257	\$ 313	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2021	\$ 1.319	€ 1.082	4	0	4	0,00
SCX	01.2021	72.003	60.123	1.561	0	1.561	0,60
	02.2021	104.386	85.256	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	67.889	56.687	1.470	0	1.470	0,56
	02.2021	99.767	81.483	0	0	0	0,00
				\$ 4.489	\$ (62)	\$ 4.427	1,69

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 4.266 1,63

Summe Anlagen

\$ 268.351 102,72

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (7.115) (2,72)

Nettovermögen

\$ 261.236 100,00

## 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 mit Sachwertausschüttung.

(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.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Invepar Holdings LLC 8,875 % 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
		<b>\$ 18</b>	<b>\$ 7</b>	<b>0,00</b>

- (i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 4.585 als Sicherheiten verpfändet.
- (j) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.336 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 657 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	4	3.644	0	3.648
<b>Summen</b>	<b>\$ 853</b>	<b>\$ 266.637</b>	<b>\$ 861</b>	<b>\$ 268.351</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 378	\$ 207.596	\$ 3.823	\$ 211.797
Investmentfonds	8.495	0	0	8.495
Pensionsgeschäfte	0	1.022	0	1.022
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(286)	2.690	0	2.404
<b>Summen</b>	<b>\$ 8.587</b>	<b>\$ 211.308</b>	<b>\$ 3.823</b>	<b>\$ 223.718</b>

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

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,250 %	05.03.2020	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (758)	\$ (760)	(0,29)
GRE	0,160	30.12.2020	15.01.2021	(2.053)	(2.052)	(0,78)
	0,170	03.11.2020	03.02.2021	(1.714)	(1.715)	(0,66)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (4.527)</b>	<b>(1,73)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte	% des Nettovermögens
BPG	0,180 %	23.10.2020	22.01.2021	\$ (1.030)	\$ (1.030)	(0,39)
	0,180	30.10.2020	29.01.2021	(1.308)	(1.308)	(0,50)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (2.338)</b>	<b>(0,89)</b>

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 96	\$ 0	\$ 96
BPS	1.252	(1.300)	(48)
BRC	(4)	0	(4)
CBK	(47)	0	(47)
GLM	(19)	0	(19)
HUS	109	0	109
JPM	(77)	0	(77)
MYC	(47)	0	(47)
MYI	154	(60)	94
NGF	(44)	0	(44)
SCX	1.312	(1.370)	(58)
SSB	119	0	119
TOR	1.468	(1.830)	(362)
UAG	(6)	0	(6)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	81,15	77,59
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	19,12	16,78
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,40	k. A.
Investmentfonds	0,31	3,78
Pensionsgeschäfte	0,35	0,46
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	(0,13)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,24)	0,04
Freiverkehrsfinanzderivate	1,63	1,16
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,73)	(0,52)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,89)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,31	k. A.
Unternehmensanleihen und Wechsel	88,93	84,68
US-Schatzobligationen	8,76	5,46
Non-Agency-MBS	0,53	0,73
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,68	0,84
Staatsemissionen	1,39	2,48
Stammaktien	0,05	0,17
Optionsscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	0,02	0,01
Investmentfonds	0,31	3,78
Pensionsgeschäfte	0,35	0,46
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,00	(0,13)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,15)	(0,04)
Zinsswaps	(0,09)	0,08
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,08)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	(0,02)	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,11)	(0,08)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,85	1,26
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,72)	0,32
Nettovermögen	100,00	100,00



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
<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3,000 % fällig am 29.03.2025	€ 1.000	\$ 1.293	0,59	ICL Group Ltd. 6,375 % fällig am 31.05.2038	600	795	0,36	Malaysia Government Investment Issue 4,128 % fällig am 15.08.2025	MYR 20.000	\$ 5.389	2,45
				Israel Electric Corp. Ltd. 4,250 % fällig am 14.08.2028	\$ 600	\$ 694	0,31				
						3.513	1,59	Summe Malaysia			13.475 6,12
<b>HONGKONG</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>MAURITIUS</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
CDBL Funding 3,750 % fällig am 11.03.2022	\$ 300	309	0,14	Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	1.200	1.429	0,65	Greenko Dutch BV 4,875 % fällig am 24.07.2022	\$ 600	607	0,28
Huarong Finance Co. Ltd. 3,250 % fällig am 03.06.2021	300	302	0,14	Summe Israel		4.942	2,24	<b>MEXIKO</b>			
3,625 % fällig am 22.11.2021	400	407	0,18	<b>ITALIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
ICBCIL Finance Co. Ltd. 3,650 % fällig am 05.03.2022	600	616	0,28	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Summe Hongkong		1.634	0,74	Intesa Sanpaolo SpA 7,000 % fällig am 19.01.2021 (c)(e)(g)	€ 1.000	1.229	0,56	Banco Santander Mexico S.A. 5,375 % fällig am 17.04.2025	600	690	0,31
<b>UNGARN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
<b>STAATSEMISSIONEN</b>											
Hungary Government International Bond 1,500 % fällig am 17.11.2050	€ 800	994	0,45	Telecom Italia SpA 5,875 % fällig am 19.05.2023	£ 300	450	0,20	Cibanco S.A. Ibm 4,962 % fällig am 18.07.2029	700	796	0,36
3,000 % fällig am 26.06.2024	HUF 483.500	1.745	0,79	UniCredit SpA 5,459 % fällig am 30.06.2035	\$ 500	551	0,25	Petroleos Mexicanos 1,875 % fällig am 21.04.2022 (g)	€ 2.400	2.920	1,32
3,250 % fällig am 22.10.2031	756.000	2.833	1,29	9,250 % fällig am 03.06.2022 (c)(e)	€ 200	269	0,12	6,840 % fällig am 23.01.2030	\$ 600	629	0,29
Summe Ungarn		5.572	2,53	Summe Italien		2.499	1,13	7,650 % fällig am 24.11.2021	MXN 48.650	2.440	1,11
<b>INDIEN</b>				<b>ELFENBEINKÜSTE</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
Adani Transmission Ltd. 4,250 % fällig am 21.05.2036	\$ 965	1.025	0,46	Ivory Coast Government International Bond 6,375 % fällig am 03.03.2028	\$ 800	917	0,42	Trust Fibra Uno 4,869 % fällig am 15.01.2030	400	456	0,21
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	500	532	0,24	Summe Elfenbeinküste						9.042	4,10
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,700 % fällig am 27.02.2022	600	610	0,28	<b>JAPAN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
State Bank of India 4,000 % fällig am 24.01.2022	900	926	0,42	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Summe Indien		3.093	1,40	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	500	553	0,25	Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 27.04.2051	800	999	0,46
<b>INDONESIEN</b>				<b>JORDANIEN</b>							
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
Indonesia Government International Bond 4,450 % fällig am 15.04.2070	500	615	0,28	Jordan Government International Bond 5,850 % fällig am 07.07.2030	900	995	0,45	7,750 % fällig am 13.11.2042	MXN 129.200	7.474	3,39
<b>IRLAND</b>				<b>KASACHSTAN</b>							
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Toro European CLO DAC 0,650 % fällig am 15.04.2030	€ 600	733	0,33	Development Bank of Kazakhstan JSC 4,125 % fällig am 10.12.2022	200	210	0,10	Summe Mexiko		17.515	7,95
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC 5,950 % fällig am 15.04.2030 (e)	\$ 1.100	1.144	0,52	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd. 3,250 % fällig am 15.08.2030	900	955	0,43	Mongolia Government International Bond 5,125 % fällig am 05.12.2022	\$ 700	730	0,33
MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC 6,625 % fällig am 14.10.2022	200	218	0,10	Summe Kasachstan		1.165	0,53	<b>NAMIBIA</b>			
Vnesheconombank Via VEB Finance PLC 6,025 % fällig am 05.07.2022	200	214	0,09	<b>KENIA</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
		1.576	0,71	<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>LUXEMBURG</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
European Loan Conduit 1,000 % fällig am 17.02.2030	€ 300	366	0,17	FEL Energy SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040	2.000	2.132	0,97	ING Groep NV 4,875 % fällig am 16.05.2029 (c)(e)	500	513	0,23
Summe Irland		2.675	1,21	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. 4,375 % fällig am 19.09.2022	200	210	0,09	Kazakhstan Temir Zholy Finance BV 6,950 % fällig am 10.07.2042	200	296	0,13
<b>INSEL MAN</b>				<b>MALAYSIA</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
NE Property BV 3,375 % fällig am 14.07.2027	1.200	1.594	0,72	Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024	€ 400	496	0,22	Metinvest BV 5,625 % fällig am 17.06.2025	€ 200	255	0,12
<b>ISRAEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
Bank Leumi Le-Israel BM 3,275 % fällig am 29.01.2031 (e)	\$ 900	937	0,43	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 6,125 % fällig am 07.02.2022	\$ 600	633	0,29	7,650 % fällig am 01.10.2027	\$ 200	220	0,10
Delek & Avner Tamar Bond Ltd. 5,412 % fällig am 30.12.2025	1.033	1.087	0,49	Severstal OAO Via Steel Capital S.A. 5,900 % fällig am 17.10.2022	200	216	0,10	Summe Niederlande		1.284	0,58
				Summe Luxemburg		3.687	1,67	<b>NIGERIA</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				Malaysia Government International Bond 3,882 % fällig am 14.03.2025	MYR 14.000	3.727	1,69	Nigeria Government International Bond 6,750 % fällig am 28.01.2021	900	903	0,41
				3,955 % fällig am 15.09.2025	13.700	3.688	1,67	7,625 % fällig am 28.11.2047	500	528	0,24
								Summe Nigeria		1.431	0,65
				<b>MALAYSIA</b>				<b>NORWEGEN</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				Petronas Capital Ltd. 4,550 % fällig am 21.04.2050	500	671	0,31	Aker BP ASA 4,000 % fällig am 15.01.2031	500	543	0,25
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>OMAN</b>			
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Oman Government International Bond 3,625 % fällig am 15.06.2021	2.200	2.207	1,00
								6,500 % fällig am 08.03.2047	300	295	0,14
								6,750 % fällig am 17.01.2048	1.600	1.589	0,72
								Summe Oman		4.091	1,86



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
<b>BESCHREIBUNG</b>				<b>URUGUAY</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Midwest Connector Capital Co. LLC	\$ 2.000	\$ 2.052	0,93	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
3,900 % fällig am 01.04.2024				Uruguay Government International Bond	UYU 8.100	\$ 199	0,09	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (d)	367.599	\$ 4.297	1,95
Naviert Corp.	1.100	1.167	0,53	Uruguay Monetary Regulation Bill				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	776.457	7.735	3,51
6,500 % fällig am 15.06.2022				0,000 % fällig am 05.02.2021 (a)	8.800	207	0,09				
Nissan Motor Acceptance Corp.	800	854	0,39	Summe Uruguay		406	0,18				
3,875 % fällig am 21.09.2023				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>							
OneMain Finance Corp.	100	105	0,05	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>							
7,750 % fällig am 01.10.2021				(3,480) % fällig am 13.09.2021 (a)(b)	ARS 6.963	51	0,02				
Rio Oil Finance Trust	293	325	0,15	<b>EGYPT TREASURY BILLS</b>							
2,030 % fällig am 06.07.2024				13,160 % fällig am 09.02.2021 (a)(b)	EGP 4.675	293	0,13				
9,750 % fällig am 06.01.2027	156	181	0,08	13,250 % fällig am 06.04.2021 (a)(b)	14.000	863	0,39				
				13,281 % fällig am 09.02.2021 (a)(b)	58.925	3.700	1,68				
				13,479 % fällig am 02.03.2021 (a)(b)	13.000	810	0,37				
				13,501 % fällig am 16.02.2021 (a)(b)	4.000	251	0,12				
		11.286	5,12	Summe kurzfristige Instrumente		5.917	2,69				
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 228.967	103,93				
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	110	105	0,05								
2,003 % fällig am 25.08.2046											
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>											
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA											
2,000 % fällig am 01.03.2051	7.400	7.663	3,48								
2,500 % fällig am 01.03.2051	7.400	7.777	3,53								
4,000 % fällig am 01.02.2051	7.400	7.915	3,59								
		23.355	10,60								
Summe USA		41.893	19,01								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 1.565	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021	\$ (1.596)	\$ 1.565	\$ 1.565	0,71
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (1.596)</b>	<b>\$ 1.565</b>	<b>\$ 1.565</b>	<b>0,71</b>

(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
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2021	4	\$ (1)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	62	(5)	0,00
				\$ (6)	0,00
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ (6)</b>	<b>0,00</b>

**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<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 3.200	\$ 136	0,06

**ZINSSWAPS**

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,580 %	02.01.2025	BRL 10.000	\$ 44	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,220	02.01.2025	4.600	44	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,675	02.01.2023	14.500	(100)	(0,05)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,745	02.01.2025	10.500	(145)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,950	04.01.2027	8.300	97	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,615	02.01.2025	6.000	111	0,05

# 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 COP-IBR Compounded-OIS	2,690 %	24.07.2024	COP	7.257.000	\$ (2)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,100	26.11.2025		2.651.000	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,255	11.12.2025		6.000.000	(14)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,445	04.05.2022		2.364.400	(27)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month PLN-WIBOR	0,190	22.09.2022	PLN	172.000	(8)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	3-Month PLN-WIBOR	1,215	29.07.2030		10.300	39	0,00
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	1,933	17.01.2025		11.800	189	0,09
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022	\$	8.500	(2)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	17.06.2022		5.400	24	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025		7.900	2	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025		400	6	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030		3.070	9	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050		1.500	67	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2021		17.800	(287)	(0,13)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.06.2024		7.100	398	0,18
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2024		270	(10)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029		4.100	(340)	(0,15)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,752	15.09.2021		6.530	(120)	(0,05)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046		1.800	356	0,16
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,271	21.06.2029		11.000	956	0,43
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,030	07.08.2025	ZAR	115.000	187	0,08
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,410	11.02.2023		99.700	421	0,19
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,650	28.02.2023		57.200	(49)	(0,02)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,665	09.01.2023		20.100	(93)	(0,04)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,670	13.12.2022		83.500	(344)	(0,16)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,975	07.01.2025		93.000	584	0,27
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,070	09.12.2024		10.000	71	0,03
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,600	19.06.2024		40.000	269	0,12
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,700	24.11.2022	CLP	966.100	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,905	24.11.2023		1.293.300	3	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	0,975	03.04.2023		110.000	1	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,070	07.04.2023		675.000	7	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,070	10.12.2023		1.218.000	5	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,080	10.12.2023		1.218.000	6	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,090	10.12.2023		2.828.000	15	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,183	27.03.2023		357.900	5	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,190	19.03.2023		970.000	15	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,200	27.03.2023		103.400	2	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,345	11.06.2025		1.350.000	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,900	01.03.2023		565.000	(24)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,947	23.11.2027		999.000	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,950	05.05.2026		1.239.600	37	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,965	24.11.2027		851.000	(2)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,000	25.11.2027		268.000	(2)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,020	30.04.2026		1.300.000	47	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,020	25.11.2027		344.000	(3)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,110	01.03.2023		1.030.000	(50)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,120	01.03.2023		1.290.000	(63)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,183	04.12.2027		2.661.000	59	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,360	22.01.2025		4.810.000	366	0,17
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,640	01.03.2026		795.000	(71)	(0,03)
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month CZK-PRIBOR	1,025	29.07.2030	CZK	61.800	(58)	(0,03)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,890	15.01.2030		39.000	132	0,06
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	2,000	19.06.2024		26.100	46	0,02
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	2,255	15.01.2023		122.200	(298)	(0,13)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2051	€	600	(14)	(0,01)
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031		2.500	2	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.03.2026		1.500	(7)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	15.12.2040		300	(4)	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	0,670	12.07.2022	HUF	230.200	1	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	0,970	26.02.2022		1.577.700	48	0,02
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,075	21.01.2025		1.901.200	48	0,02
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	19.06.2024		861.400	54	0,02
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,760	21.01.2030		380.000	(51)	(0,02)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,775	07.09.2030		877.000	(68)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	17.06.2024	MXN	51.500	33	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,080	16.06.2025		16.400	15	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,700	12.09.2030		35.400	48	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,770	09.10.2030		196.200	(318)	(0,14)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,850	19.08.2030		12.100	24	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,875	16.08.2030		16.800	35	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,880	16.08.2030		8.700	18	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,920	16.08.2030		9.100	20	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,330	09.06.2022		116.000	(173)	(0,08)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,383	30.08.2040		23.200	(49)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,480	28.05.2040		54.500	(150)	(0,07)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,520	03.08.2040		5.700	(17)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,520	06.08.2040		8.100	(24)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,530	04.12.2024		33.000	121	0,06
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,533	03.08.2040		10.900	(33)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,538	09.06.2022		100.000	164	0,07

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,580	01.01.2025	MXN 29.700	\$ 113	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,580	03.08.2040	6.000	(20)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,830	27.12.2029	19.900	118	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,675	04.06.2029	65.100	568	0,26
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,865	13.05.2024	50.500	263	0,12
					\$ 3.270	1,49
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 3.406</b>	<b>1,55</b>

(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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### 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

###### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Call - OTC EUR versus USD	\$ 1,190	11.03.2021	3.400	\$ 93	\$ 131	0,06
MYI	Call - OTC USD versus INR	INR 84,850	27.07.2023	5.500	245	170	0,07
	Put - OTC USD versus INR	84,850	27.07.2023	5.500	244	371	0,17
					\$ 582	\$ 672	0,30

##### VERKAUFSOPTIONEN

###### DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Call - OTC EUR versus USD	\$ 1,230	11.03.2021	6.800	\$ (87)	\$ (82)	(0,04)
	Put - OTC USD versus CNH	CNH 6,780	27.08.2021	3.800	(40)	(149)	(0,07)
	Call - OTC USD versus CNH	7,400	27.08.2021	3.800	(31)	(9)	0,00
MYI	Call - OTC USD versus INR	INR 77,530	27.07.2021	7.450	(172)	(67)	(0,03)
	Put - OTC USD versus INR	77,530	27.07.2021	7.450	(195)	(331)	(0,15)
					\$ (525)	\$ (638)	(0,29)

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

##### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.12.2024	\$ 1.800	\$ 27	\$ (17)	\$ 10	0,01
BRC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.000	16	(11)	5	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2030	500	118	(27)	91	0,04
CBK	Colombia Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.700	(21)	(4)	(25)	(0,01)
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	100	(1)	(1)	(2)	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2030	200	47	(10)	37	0,02
GST	Colombia Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.000	(11)	(4)	(15)	(0,01)
	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.000	(23)	(12)	(35)	(0,02)
HUS	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.100	(13)	(6)	(19)	(0,01)
JPM	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	3.200	63	(46)	17	0,01
					\$ 202	\$ (138)	\$ 64	0,03

##### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.06.2022	\$ 300	\$ (7)	\$ 8	\$ 1	0,00
BRC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	550	(60)	17	(43)	(0,02)
	Nigeria International Government Bond	5,000	20.12.2021	200	11	(3)	8	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2025	800	(108)	34	(74)	(0,03)
CBK	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2025	300	(41)	13	(28)	(0,01)
DUB	Egypt Government International Bond	5,000	20.06.2022	400	14	4	18	0,01
					\$ (191)	\$ 73	\$ (118)	(0,05)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Emerging Markets Opportunities 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.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR zzgl. 0,114 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2021	TRY 12.600	\$ 1.952	\$ 21	\$ (139)	\$ (118)	(0,05)
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	0,04
GST	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR zzgl. 0,127 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.03.2021	2.078	TRY 12.600	(2)	225	223	0,10
						\$ 19	\$ 166	\$ 185	0,09

### 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	\$ (59)	\$ (59)	(0,03)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,725	18.03.2025	THB 54.100	0	12	12	0,01
BPS	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,420	23.01.2022	KRW 28.023.500	0	(225)	(225)	(0,10)
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,450	23.01.2025	6.910.400	0	114	114	0,05
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,890	18.09.2029	THB 52.800	0	140	140	0,06
CBK	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,723	19.11.2030	ILS 5.200	0	5	5	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,050	18.03.2027	THB 73.000	0	44	44	0,02
DUB	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,710	28.05.2022	COP 7.002.200	10	77	87	0,04
GLM	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,235	15.01.2023	ILS 21.700	0	36	36	0,02
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,820	15.01.2030	6.500	0	(49)	(49)	(0,02)
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,193	18.03.2022	KRW 24.643.000	0	122	122	0,05
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,868	18.03.2025	THB 359.200	0	157	157	0,07
JPM	Erhalt	IBR Compounded-OIS	4,130	04.05.2022	COP 2.110.800	0	(21)	(21)	(0,01)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,020	06.06.2024	CLP 770.000	0	74	74	0,03
MYC	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,720	18.11.2030	ILS 5.300	0	5	5	0,00
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,270	18.03.2030	KRW 2.009.300	0	3	3	0,00
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	0,816	18.03.2022	THB 370.900	0	(89)	(89)	(0,04)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,110	24.01.2022	490.900	0	192	192	0,09
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,265	24.01.2025	200.400	0	(213)	(213)	(0,10)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,310	21.01.2025	150.000	0	(170)	(170)	(0,08)
MYI	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,340	18.09.2029	MYR 3.500	0	64	64	0,03
NGF	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,960	05.02.2025	THB 74.000	0	39	39	0,02
SCX	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,430	06.03.2025	CNY 25.600	0	(31)	(31)	(0,01)
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,020	04.02.2025	26.000	0	(38)	(38)	(0,02)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,230	23.08.2024	MYR 6.500	0	(70)	(70)	(0,03)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,890	16.12.2025	THB 63.400	0	27	27	0,01
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,209	15.01.2025	199.300	0	(195)	(195)	(0,10)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,310	27.08.2024	50.000	0	(46)	(46)	(0,02)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,428	13.12.2029	9.100	0	11	11	0,01
UAG	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,920	15.01.2025	CNY 43.900	0	82	82	0,04
						\$ 10	\$ (2)	\$ 8	(0,01)

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2021	\$	294 CZK	6.852	\$ 25	\$ 0	0,01	
	01.2021		52 PLN	200	2	0	0,00	
	02.2021	€	412 \$	502	0	(2)	0,00	
	02.2021	£	3.589	4.734	0	(174)	(0,08)	
	02.2021	MXN	10.021	466	0	(34)	(0,02)	
	02.2021	\$	115 CZK	2.579	5	0	0,00	
	03.2021		886 INR	66.634	19	0	0,01	
	08.2021		370 CNH	2.607	25	0	0,01	
	BPS	01.2021		18 PLN	68	1	0	0,00
		01.2021		4.229 TRY	32.770	157	0	0,07
03.2021		TWD	14.089	\$ 503	2	0	0,00	
BRC	03.2021	\$	67 PHP	3.210	0	0	0,00	
	01.2021	TRY	11.221	\$ 1.423	0	(78)	(0,04)	
	01.2021	\$	86 HUF	26.605	3	0	0,00	
BSS	01.2021		985 MXN	21.166	75	0	0,03	
	02.2021		567 CZK	12.643	22	0	0,01	
	02.2021		462 €	376	0	(2)	0,00	
	01.2021	CLP	3.113.802	\$ 4.094	0	(287)	(0,13)	
CBK	01.2021	\$	3.415 CLP	2.531.141	147	0	0,07	
	01.2022	BRL	2.108	\$ 361	0	(36)	(0,02)	
	01.2021	COP	14.431.399	4.076	0	(143)	(0,07)	
	01.2021	PEN	24.427	6.792	39	0	0,02	
	01.2021	\$	276 CZK	6.379	22	0	0,01	
	01.2021		6.777 PEN	24.427	0	(24)	(0,01)	
	01.2021		29 PLN	110	0	0	0,00	
	01.2021		625 ZAR	9.686	33	0	0,01	
	01.2021	ZAR	11.175	\$ 713	0	(46)	(0,02)	
	02.2021	EGP	4.000	242	0	(9)	0,00	
GLM	02.2021	€	1.511	1.805	0	(45)	(0,02)	
	02.2021	PEN	10.554	2.930	11	0	0,01	
	03.2021	MXN	45.103	2.208	0	(35)	(0,02)	
	03.2021	\$	920 CNH	6.146	21	0	0,01	
	03.2021		2.150 INR	159.553	17	0	0,01	
	04.2021	EGP	33.734	\$ 2.044	0	(46)	(0,02)	
	05.2021	PEN	5.360	1.471	0	(11)	(0,01)	
	06.2021		24.427	6.771	21	0	0,01	
	01.2021	BRL	256.675	50.000	585	0	0,27	
	01.2021	CLP	1.572.633	1.999	0	(214)	(0,10)	
HUS	01.2021	MXN	75.342	3.537	0	(237)	(0,11)	
	01.2021	\$	49.392 BRL	256.675	24	0	0,01	
	01.2021		554 CLP	417.965	34	0	0,02	
	01.2021		296 MXN	5.856	0	(3)	0,00	
	02.2021	DOP	14.427	\$ 245	0	(3)	0,00	
	02.2021	\$	994 HKD	7.709	0	0	0,00	
	02.2021		1.024 RON	4.219	34	0	0,02	
	02.2021		3.609 RUB	266.730	3	(19)	(0,01)	
	03.2021	DOP	224.308	\$ 3.772	0	(51)	(0,02)	
	03.2021	UAH	8.873	305	0	(4)	0,00	
IND	03.2021	\$	198 MXN	4.038	3	0	0,00	
	03.2021		1.844 THB	56.099	29	0	0,01	
	04.2021	DOP	9.106	\$ 153	0	(1)	0,00	
	04.2021	\$	109 COP	401.003	8	0	0,00	
	06.2021	DOP	39.315	\$ 665	4	0	0,00	
	01.2021	BRL	15.895	3.141	81	0	0,04	
	01.2021	PLN	431	113	0	(3)	0,00	
	01.2021	\$	3.059 BRL	15.895	1	0	0,00	
	01.2021		4.225 COP	14.431.399	0	(6)	0,00	
	01.2021		2.919 MXN	60.328	103	0	0,05	
JPM	01.2021		24 PLN	90	1	0	0,00	
	01.2021	ZAR	14.835	\$ 942	0	(65)	(0,03)	
	02.2021	£	400	532	0	(15)	(0,01)	
	02.2021	HKD	7.709	991	0	(4)	0,00	
	02.2021	\$	3.140 BRL	15.895	0	(80)	(0,04)	
	02.2021		3.973 ¥	417.000	68	0	0,03	
	02.2021		74 RUB	5.537	1	0	0,00	
	03.2021	COP	14.431.399	\$ 4.215	1	0	0,00	
	03.2021	EGP	13.000	785	0	(29)	(0,01)	
	03.2021	PEN	7.977	2.242	36	0	0,02	
JPM	04.2021	COP	3.049.021	757	0	(131)	(0,06)	
	01.2021	CLP	394.262	501	0	(54)	(0,02)	
	02.2021	\$	100 CZK	2.204	3	0	0,00	
	01.2021	RSD	42.199	€ 359	1	0	0,00	
	01.2021	TRY	464	\$ 58	0	(4)	0,00	
	01.2021	\$	2.212 CLP	1.706.573	189	0	0,09	
	01.2021		1.066 PLN	4.057	23	0	0,01	
	01.2021		117 ZAR	1.713	0	0	0,00	
	02.2021	UAH	9.867	\$ 337	0	(7)	0,00	
	02.2021	\$	395 CZK	8.874	19	0	0,01	
02.2021		8.646 ILS	29.695	609	0	0,28		
10.2021	KES	13.272	\$ 112	0	(2)	0,00		
01.2022	BRL	409	70	0	(7)	0,00		

# 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	
MYI	01.2021	€ 77	\$ 94	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	
	01.2021	PLN 69	18	0	0	0	0,00	
	01.2021	\$ 4.117	MXN 81.653	0	(27)	(27)	(0,01)	
	01.2021	43	PLN 160	0	0	0	0,00	
	02.2021	£ 367	\$ 488	0	(14)	(14)	(0,01)	
	07.2021	\$ 444	INR 33.637	5	0	5	0,00	
	02.2021	€ 315	\$ 386	0	0	0	0,00	
RBC	01.2021	BRL 256.975	49.450	0	(24)	(24)	(0,01)	
	01.2021	HUF 114.635	375	0	(12)	(12)	(0,01)	
SCX	01.2021	\$ 50.000	BRL 256.975	0	(527)	(527)	(0,24)	
	01.2021	230	HUF 69.942	6	0	6	0,00	
	01.2021	ZAR 2.105	\$ 137	0	(6)	(6)	0,00	
	02.2021	ILS 29.283	8.527	0	(600)	(600)	(0,27)	
	03.2021	MYR 41.913	10.296	0	(95)	(95)	(0,04)	
	03.2021	\$ 7.377	IDR 106.216.900	133	0	133	0,06	
	10.2021	KES 64.511	\$ 544	0	(9)	(9)	0,00	
	01.2022	BRL 2.507	429	0	(43)	(43)	(0,02)	
	SSB	01.2021	\$ 2.937	BRL 15.595	65	0	65	0,03
		01.2021	MXN 93.661	\$ 4.398	0	(294)	(294)	(0,13)
	UAG	02.2021	€ 4.104	4.860	0	(167)	(167)	(0,08)
02.2021		\$ 159	CZK 3.496	4	0	4	0,00	
02.2021		240	RUB 18.302	6	0	6	0,00	
				\$ 2.726	\$ (3.729)	\$ (1.003)	(0,45)	

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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
BPS	01.2021	€ 3.157	\$ 3.866	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	01.2021	\$ 65.365	€ 54.577	1.413	0	1.413	0,64
	02.2021	40.745	33.278	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	BRL 934	\$ 176	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	\$ 180	BRL 934	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	10.733	€ 8.962	233	0	233	0,11
	01.2021	BRL 934	\$ 180	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 185	BRL 934	0	(5)	(5)	0,00
HUS	01.2021	201	€ 166	2	0	2	0,00
	02.2021	BRL 934	\$ 184	5	0	5	0,00
	01.2021	€ 5	6	0	0	0	0,00
JPM	01.2021	\$ 487	€ 400	2	0	2	0,00
	01.2021	17	14	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	240	197	1	0	1	0,00
SCX	01.2021	69.155	57.744	1.498	0	1.498	0,68
	02.2021	107.591	87.873	0	0	0	0,00
				\$ 3.157	\$ (9)	\$ 3.148	1,43

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 2.318 1,05

Summe Anlagen

\$ 248.923 112,99

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (28.614) (12,99)

Nettovermögen

\$ 220.309 100,00

## 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
JPMorgan Structured Products BV	3,231 %	14.10.2024	18.10.2019	\$ 857	\$ 858	0,39

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 4.279 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 260 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 2.178 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 1.081 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(6)	5.724	0	5.718
<b>Summen</b>	<b>\$ 12.026</b>	<b>\$ 234.151</b>	<b>\$ 2.746</b>	<b>\$ 248.923</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 179.375	\$ 1.843	\$ 181.218
Investmentfonds	14.287	0	0	14.287
Pensionsgeschäfte	0	902	0	902
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	14	2.893	0	2.907
<b>Summen</b>	<b>\$ 14.301</b>	<b>\$ 183.170</b>	<b>\$ 1.843</b>	<b>\$ 199.314</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	(0,150) %	20.11.2020	19.02.2021	€ (907)	\$ (1.110)	(0,50)
	(0,100)	20.11.2020	19.02.2021	(2.175)	(2.660)	(1,21)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (3.770)</b>	<b>(1,71)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (279)	\$ 270	\$ (9)
BPS	1.605	(1.940)	(335)
BRC	236	(200)	36
BSS	(176)	0	(176)
CBK	(280)	291	11
DUB	105	(290)	(185)
GLM	538	(540)	(2)
GST	173	(280)	(107)
HUS	(58)	0	(58)
IND	(51)	0	(51)
JPM	891	(800)	91
MYC	(272)	260	(12)
MYI	172	(210)	(38)
NGF	39	0	39
SCX	(21)	(610)	(631)
SSB	65	0	65
UAG	(369)	260	(109)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	58,50	67,84
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	44,19	48,69
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,24	k. A.
Investmentfonds	5,75	9,19
Pensionsgeschäfte	0,71	0,58
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,55	0,81
Freiverkehrsfinanzderivate	1,05	1,05
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,71)	(12,53)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Argentinien	0,80	0,48
Österreich	0,23	k. A.
Aserbaidtschan	0,14	k. A.
Weissrussland	0,23	k. A.
Brasilien	4,04	4,03
Cayman-Inseln	4,48	1,42
Chile	0,79	3,74
China	2,52	0,85
Kolumbien	4,02	1,25
Costa Rica	0,12	0,18
Kroatien	1,14	1,63
Dominikanische Republik	3,40	4,25
Ägypten	1,03	k. A.
El Salvador	0,52	0,14
Frankreich	0,10	k. A.
Georgien	0,23	k. A.
Deutschland	0,91	k. A.
Ghana	1,20	0,66
Guatemala	0,20	1,65
Guernsey, Kanalinseln	0,59	k. A.
Honduras	k. A.	0,48
Hongkong	0,74	1,18
Ungarn	2,53	3,07
Indien	1,40	1,57
Indonesien	0,28	2,04
Irland	1,21	2,28
Insel Man	0,72	k. A.
Israel	2,24	k. A.
Italien	1,13	k. A.
Elfenbeinküste	0,42	k. A.
Japan	0,25	k. A.
Jordanien	0,45	0,41
Kasachstan	0,53	k. A.
Kenia	0,32	0,42
Luxemburg	1,67	0,82
Malaysia	6,12	0,75
Mauritius	0,28	0,39
Mexiko	7,95	12,51
Mongolei	0,33	0,46
Namibia	1,03	k. A.
Niederlande	0,58	0,26
Nigeria	0,65	0,60
Norwegen	0,25	k. A.
Oman	1,86	1,03
Paraguay	0,23	k. A.
Peru	6,63	3,90
Philippinen	0,66	k. A.
Katar	0,30	k. A.
Rumänien	0,90	k. A.
Russland	1,94	2,24
Senegal	k. A.	0,72
Saudi-Arabien	0,92	k. A.
Serbien	0,70	k. A.
Singapur	0,32	k. A.
Südafrika	2,31	1,23
Spanien	0,23	k. A.
Sri Lanka	0,12	k. A.
Supranational	0,83	1,20
Schweden	0,29	k. A.
Schweiz	0,44	k. A.
Thailand	k. A.	1,20
Türkei	0,10	0,61
Ukraine	0,75	1,43
Vereinigte Arabische Emirate	0,90	k. A.
Großbritannien	3,83	4,79
USA	19,01	42,04

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Uruguay	0,18	k. A.
Jungferneinseln (Britisch)	k. A.	1,38
Kurzfristige Instrumente	2,71	7,24
Investmentfonds	5,75	9,19
Pensionsgeschäfte	0,71	0,58
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,00	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,06	0,36
Zinsswaps	1,49	0,45
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,30	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,29)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,03	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,05)	0,02
Cross-Currency Swaps	0,09	0,07
Zinsswaps	(0,01)	0,10
Devisenterminkontrakte	(0,45)	(0,34)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,43	1,20
Sonstige Aktiva und Passiva	(12,99)	(28,17)
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			
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>AGYP TEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
<b>ARGENTINIEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>EGYPT Government International Bond</b>				<b>Fondo MIVIVIENDA S.A.</b>						
Pan American Energy LLC				14,605 % fällig am 08.09.2025	EGP	6.200	\$ 402	1,24	7,000 % fällig am 14.02.2024	PEN	100	\$ 32	0,10	
38,606 % fällig am 26.02.2021	ARS	421	\$ 3	0,01					Peru Government International Bond		500	151	0,46	
YPF S.A.									6,350 % fällig am 12.08.2028		900	316	0,97	
38,259 % fällig am 04.03.2021		910	6	0,02								499	1,53	
39,040 % fällig am 24.07.2021		1.651	10	0,03					Summe Peru			708	2,17	
			19	0,06					<b>KATAR</b>					
									<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>GHANA</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
Angolan Government International Bond														
0,125 % fällig am 09.07.2030	\$	99	39	0,12	Ghana Government International Bond									
0,125 % fällig am 09.07.2035		105	38	0,12	20,750 % fällig am 16.01.2023	GHS	1.000	175	0,54					
Argentina Government International Bond									<b>RUSSLAND</b>					
34,109 % fällig am 04.10.2022	ARS	420	3	0,01	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
36,174 % fällig am 03.04.2022		547	4	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Russia Government International Bond</b>					
Argentina Treasury Bond									7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB	3.300	50	0,16	
1,000 % fällig am 05.08.2021		20.804	148	0,45										
Autonomous City of Buenos Aires Argentina														
37,981 % fällig am 23.01.2022		2.730	18	0,06										
			250	0,77					<b>SERBIEN</b>					
Summe Argentinien			269	0,83	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
									<b>Serbia Government International Bond</b>					
<b>BRASILIEN</b>				<b>INDIEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
Banco BTG Pactual S.A.									<b>South Africa Government International Bond</b>					
4,500 % fällig am 10.01.2025	\$	200	214	0,66	State Bank of India				5,875 % fällig am 30.05.2022	\$	100	107	0,33	
Banco Votorantim S.A.					4,000 % fällig am 24.01.2022	\$	200	206	0,63	10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	18.800	1.519	4,66
4,000 % fällig am 24.09.2022		200	208	0,64					Summe Südafrika			1.626	4,99	
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.					<b>ISRAEL</b>				<b>SUPRANATIONAL</b>					
0,000 % fällig am 01.02.2021 (c)(e)		23	0	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL									<b>Banque Ouest Africaine de Developpement</b>					
9,850 % fällig am 16.07.2032	BRL	2.941	650	1,99					5,500 % fällig am 06.05.2021	\$	200	203	0,62	
Vale Overseas Ltd.					<b>ITALIEN</b>				<b>UKRAINE</b>					
6,250 % fällig am 10.08.2026	\$	100	124	0,38	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>					
Summe Brasilien			1.196	3,67					<b>Ukraine</b>					
									<b>5,490 % fällig am 29.06.2021</b>					
<b>CAYMAN INSELN</b>				<b>LUXEMBURG</b>				<b>GROSSBRITANNIEN</b>						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.					Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				<b>Barclays Bank PLC</b>					
5,625 % fällig am 24.10.2024		200	210	0,64	5,717 % fällig am 16.06.2021	\$	300	307	0,94	<b>10,000 % fällig am 21.05.2021</b>				
Odebrecht Drilling Norbe Ltd.					<b>MAURITIUS</b>				<b>USA</b>					
6,350 % fällig am 01.12.2021 ^		4	4	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>					
Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)									<b>Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>					
7,350 % fällig am 01.12.2026 ^ (b)		47	12	0,04					<b>1,198 % fällig am 25.12.2033</b>					
Summe Cayman Inseln			226	0,69	<b>MEXIKO</b>				<b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>					
					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>1,148 % fällig am 25.10.2037</b>					
<b>CHILE</b>				<b>CHILE</b>				<b>CHILE</b>						
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos					Petroleos Mexicanos				<b>2,323 % fällig am 25.01.2035</b>					
0,000 % fällig am 01.07.2021 (c)	CLP1.010.000	1.420	4,36	7,190 % fällig am 12.09.2024	MXN	900	41	0,12	<b>Citigroup Mortgage Loan Trust</b>					
				7,650 % fällig am 24.11.2021		840	42	0,13	<b>0,208 % fällig am 25.07.2045</b>					
				Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.					<b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust</b>					
				8,790 % fällig am 09.12.2014 ^		5.000	0	0,00	<b>0,388 % fällig am 25.02.2037</b>					
									<b>1,273 % fällig am 25.11.2035</b>					
					<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Credit-Based Asset Servicing &amp; Securitization Trust</b>					
									<b>0,208 % fällig am 25.11.2036</b>					
					Mexico Government International Bond				<b>GSAMP Trust</b>					
					7,500 % fällig am 03.06.2027		700	40	0,12	<b>0,238 % fällig am 25.01.2037</b>				
					8,500 % fällig am 31.05.2029		500	31	0,10	<b>Home Equity Asset Trust</b>				
									<b>0,748 % fällig am 25.11.2032</b>					
									<b>HSI Asset Loan Obligation Trust</b>					
									<b>0,208 % fällig am 25.12.2036</b>					
									<b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>					
									<b>0,208 % fällig am 25.05.2037</b>					
									<b>0,913 % fällig am 25.01.2035</b>					
									<b>0,943 % fällig am 25.03.2034</b>					
									<b>Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust</b>					
									<b>1,498 % fällig am 25.02.2033</b>					
												25	25	0,08

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		
New Century Home Equity Loan Trust 0,328 % fällig am 25.05.2036	\$	16	0,05	IndyMac Mortgage Loan Trust 0,788 % fällig am 25.07.2045	\$	39	0,11	<b>MEXICO TREASURY BILLS</b> 4,309 % fällig am 11.03.2021 (c)(d)	MXN	12.500	1,91		
Option One Mortgage Loan Trust 0,288 % fällig am 25.03.2037		310	0,74	2,900 % fällig am 25.12.2034		4	0,01	4,375 % fällig am 11.03.2021 (c)(d)		12.470	1,91		
Saxon Asset Securities Trust 0,458 % fällig am 25.09.2037		20	0,06	3,072 % fällig am 25.11.2037		112	0,33						
Soundview Home Loan Trust 0,228 % fällig am 25.06.2037		5	0,01	Lehman XS Trust 0,338 % fällig am 25.09.2046		162	0,49	<b>U.S. TREASURY BILLS</b> 0,062 % fällig am 12.01.2021 (c)(d)	\$	1.900	5,83		
0,318 % fällig am 25.07.2037		83	0,22	Residential Accredit Loans, Inc. Trust 1,641 % fällig am 25.10.2037		71	0,21	0,072 % fällig am 19.01.2021 (c)(d)(g)		200	0,61		
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 0,368 % fällig am 25.10.2037		162	0,36	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 6,000 % fällig am 25.10.2036		6	0,02	0,077 % fällig am 02.03.2021 (a)(c)(d)(g)		100	0,31		
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust 0,208 % fällig am 25.10.2036		4	0,01	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,534 % fällig am 25.02.2037 ^		10	0,03	0,086 % fällig am 25.03.2021 (c)(d)		100	0,31		
								0,104 % fällig am 26.01.2021 (c)(d)		1.600	4,91		
		927	2,84	Summe USA		766	2,35				3,900	11,97	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						2.451	7,52	Summe kurzfristige Instrumente			9.175	28,17	
Rio Oil Finance Trust 9,250 % fällig am 06.07.2024		683	2,33	<b>URUGUAY STAATSEMISSIONEN</b> Uruguay Monetary Regulation Bill 0,000 % fällig am 05.02.2021 (c)	UYU	3.300	0,24	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 22.934	70,41		
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b> China Government International Bond 2,890 % fällig am 19.11.2021	CNY	2.300	1,08	<b>AKTIEN</b>					
Banc of America Mortgage Trust 2,884 % fällig am 25.07.2034		1	0,00	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b> (3,480) % fällig am 13.09.2021 (c)(d)	ARS	2.520	0,06	<b>INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>					
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,800 % fällig am 25.05.2047 ^		10	0,03	<b>EGYPT TREASURY BILLS</b> 13,250 % fällig am 06.04.2021 (c)(d)	EGP	2.000	0,38	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)		120.805	3,69		
Bear Stearns ALT-A Trust 3,171 % fällig am 26.12.2046 ^		235	0,63	13,479 % fällig am 02.03.2021 (c)(d)		5.000	0,96	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)		31.472	1,26		
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust 2,728 % fällig am 26.12.2046 ^		19	0,05	13,501 % fällig am 16.02.2021 (c)(d)		2.000	0,38				1,612	4,95	
Citigroup Mortgage Loan Trust 0,218 % fällig am 25.01.2037		4	0,01	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b> (0,103) % fällig am 01.03.2021 (c)(d)	¥	160.000	4,76	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)		15.300	4,78		
3,361 % fällig am 25.09.2037 ^		135	0,40	(0,087) % fällig am 08.03.2021 (c)(d)		160.000	4,76					3,168	9,73
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 2,918 % fällig am 20.04.2035		1	0,00			3.100	9,52	Summe Investmentfonds		\$ 3.168	9,73		
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust 3,197 % fällig am 25.08.2035		5	0,01										
GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates 3,181 % fällig am 25.10.2033		1	0,01										
GSR Mortgage Loan Trust 3,050 % fällig am 25.01.2036 ^		2	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 <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	0,090 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 3.300	Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.09.2044	\$ (3.400)	\$ 3.300	\$ 3.300	10,13
	0,090	31.12.2020	04.01.2021	3.300	U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.08.2049	(3.379)	3.300	3.300	10,13
SSB	0,000	31.12.2020	04.01.2021	536	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021	(547)	536	536	1,65
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (7.326)	\$ 7.136	\$ 7.136	21,91

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**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-Year BRL-CDI		4,000 %	03.01.2022	BRL 1.700	\$ (3)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		4,100	02.01.2023	4.500	5	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI		4,500	04.01.2021	20.300	(64)	(0,20)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,000	04.01.2021	19.600	52	0,16
Erhalt	1-Year BRL-CDI		5,100	02.01.2024	400	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		5,150	02.01.2023	8.000	(4)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,250	02.01.2023	3.500	26	0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,660	02.01.2025	3.300	4	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,020	04.01.2027	1.500	(2)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,050	02.01.2025	4.700	(45)	(0,14)
Zahlung	1-Year BRL-CDI		6,140	04.01.2027	9.100	66	0,20
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,250	04.01.2027	700	(3)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,520	04.01.2027	10.200	(65)	(0,20)
Erhalt	1-Year BRL-CDI		6,930	04.01.2021	300	(3)	(0,01)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Short-Term Local Currency 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	6,950 %	04.01.2027	BRL 800	\$ (2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,960	04.01.2027	6.500	77	0,24
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,050	04.01.2021	4.600	42	0,13
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,800	04.01.2027	900	16	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,675	04.01.2027	1.700	(45)	(0,14)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,600	04.01.2027	2.700	(99)	(0,30)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,240	04.01.2027	500	(11)	(0,03)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	1,860	07.05.2025	CNY 21.500	31	0,10
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,155	29.09.2022	COP 806.700	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,650	24.07.2024	2.178.000	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,995	24.11.2025	1.281.000	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,975	23.06.2027	216.900	(2)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,495	10.10.2024	244.300	5	0,02
Erhalt	3-Month PLN-WIBOR	0,980	09.06.2030	PLN 300	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	17.06.2022	\$ 1.800	(42)	(0,13)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025	760	2	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	420	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2021	2.200	(34)	(0,10)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2024	180	(7)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2021	1.100	(2)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2022	900	(18)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2024	1.700	(50)	(0,15)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2022	4.800	(117)	(0,36)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,375	20.10.2026	ZAR 16.000	(20)	(0,06)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,410	11.02.2023	1.500	6	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,700	24.11.2022	CLP 53.800	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,905	24.11.2023	72.000	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	1,220	03.12.2022	1.112.000	5	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month CLP-CHILIBOR	1,265	03.12.2022	861.000	4	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,290	05.11.2025	123.100	1	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,684	04.06.2027	231.400	(3)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,715	04.06.2027	46.200	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,870	14.01.2022	304.100	(9)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,875	14.01.2022	324.000	(10)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,900	01.03.2023	210.000	(9)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,935	10.03.2025	288.700	(13)	(0,04)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,950	05.05.2026	318.600	10	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,005	01.03.2023	154.800	(7)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,020	30.04.2026	335.000	12	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,080	01.06.2030	62.000	(3)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,110	01.06.2030	20.000	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,480	24.11.2030	140.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,545	05.02.2026	88.000	8	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,565	27.11.2030	35.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,585	27.11.2030	35.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,640	01.03.2026	326.000	(29)	(0,09)
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	(17)	(0,05)
Zahlung <sup>(1)</sup>	28-Day MXN-TIE	4,515	17.08.2022	MXN 23.900	3	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIE	4,530	15.11.2022	14.600	2	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	28-Day MXN-TIE	4,700	25.08.2022	33.700	8	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIE	4,830	22.07.2025	1.400	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	4,880	07.11.2025	20.100	9	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIE	5,575	01.11.2030	11.500	(9)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	5,610	03.07.2030	4.100	(4)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,463	18.05.2040	800	(2)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	28-Day MXN-TIE	6,470	12.11.2030	9.976	(4)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,510	09.12.2021	18.500	21	0,06
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,600	26.02.2030	3.900	(9)	(0,03)
					\$ (348)	(1,07)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (348)</b>	<b>(1,07)</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend<sup>2</sup>, 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC USD versus BRL	BRL 5,300	24.02.2021	100	\$ 3	\$ 4	0,01
CBK	Put - OTC USD versus RUB	RUB 75,800	25.02.2021	100	3	3	0,01
	Put - OTC USD versus TRY	TRY 7,950	25.02.2021	100	2	6	0,02
HUS	Put - OTC USD versus RUB	RUB 75,000	12.02.2021	300	6	7	0,02
MYI	Put - OTC USD versus BRL	BRL 5,350	08.02.2021	100	3	5	0,01

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
UAG	Put - OTC USD versus MXN	MXN 20,100	24.02.2021	100	\$ 3	\$ 3	0,01
	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR 15,250	24.02.2021	100	3	5	0,02
	Put - OTC USD versus TRY	TRY 7,500	18.01.2021	100	1	2	0,01
					\$ 24	\$ 35	0,11

## VERKAUFSOPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500 %	20.01.2021	200	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	100	0	0	0,00
						\$ 0	\$ 0	0,00

## DEVIENSOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens	
BPS	Put - OTC USD versus BRL	BRL 5,150	24.02.2021	100	\$ (2)	\$ (3)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus BRL	5,700	24.02.2021	100	(2)	(1)	0,00	
CBK	Put - OTC USD versus RUB	RUB 73,750	25.02.2021	100	(1)	(2)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus RUB	81,100	25.02.2021	100	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC USD versus TRY	TRY 7,410	25.02.2021	100	(1)	(2)	(0,01)	
HUS	Call - OTC USD versus TRY	8,910	25.02.2021	100	(2)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus RUB	RUB 72,000	12.02.2021	600	(6)	(4)	(0,01)	
MYI	Call - OTC USD versus BRL	BRL 6,000	21.01.2021	400	(7)	0	0,00	
	Put - OTC USD versus BRL	5,157	08.02.2021	200	(3)	(4)	(0,01)	
UAG	Call - OTC USD versus BRL	5,700	18.02.2021	150	(2)	(1)	0,00	
	Put - OTC USD versus MXN	MXN 19,600	24.02.2021	100	(1)	(1)	0,00	
	Call - OTC USD versus MXN	21,400	24.02.2021	100	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR 14,800	24.02.2021	100	(1)	(3)	(0,01)	
	Call - OTC USD versus ZAR	16,350	24.02.2021	100	(1)	0	0,00	
	Call - OTC USD versus RUB	RUB 87,750	12.02.2021	300	(5)	0	0,00	
	Call - OTC USD versus TRY	TRY 10,000	28.01.2021	100	(1)	0	0,00	
	Call - OTC USD versus TRY	12,000	27.10.2021	100	(5)	(1)	(0,01)	
						\$ (42)	\$ (24)	(0,07)

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.12.2024	\$ 700	\$ 11	\$ (7)	\$ 4	0,01
	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	400	6	(4)	2	0,01
BRC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.06.2025	100	5	(4)	1	0,00
	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	400	8	(6)	2	0,01
					\$ 30	\$ (21)	\$ 9	0,03

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
FBF	Egypt Government International Bond	1,000 %	20.12.2021	\$ 100	\$ (8)	\$ 7	\$ (1)	0,00
GST	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2021	100	(1)	1	0	0,00
JPM	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2021	200	(16)	16	0	0,00
NGF	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	400	(1)	3	2	0,01
UAG	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	100	0	1	1	0,00
					\$ (26)	\$ 28	\$ 2	0,01

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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 Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

## CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Variabler Zinssatz entspricht 1-Month MXB-LIBOR abzgl. 0,140 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	05.05.2023	MXN 30.075	\$ 1.500	\$ (1)	\$ 14	\$ 13	0,04
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	30.05.2024	170	7.557	(1)	134	133	0,40
						\$ (2)	\$ 196	\$ 194	0,59

## ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Referenzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% 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	(2)	(2)	0,00
						\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

## VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt Volatilität	Referenzeinheit	Volatilität Ausübungskurs	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	USD versus MXN 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	14,400 %	24.11.2021	\$ 1	\$ 0	\$ 1	\$ 1	0,00
CBK	Zahlung	USD versus MXN 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	15,100	05.11.2021	1	0	1	1	0,01
	Zahlung	USD versus ZAR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	16,600	05.11.2021	1	0	1	1	0,00
DUB	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	6,425	05.11.2021	2	0	0	0	0,00
GLM	Zahlung	USD versus BRL 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	18,300	05.11.2021	1	0	0	0	0,00
	Zahlung	USD versus BRL 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	18,825	23.11.2021	1	0	1	1	0,00
JPM	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	6,350	24.11.2021	2	0	0	0	0,00
	Zahlung	USD versus RUB 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	15,700	03.11.2021	1	0	1	1	0,01
MYI	Zahlung	USD versus RUB 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	15,500	23.11.2021	1	0	1	1	0,00
	Zahlung	USD versus ZAR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	16,000	24.11.2021	1	0	0	0	0,00
						\$ 0	\$ 6	\$ 6	0,02

<sup>(1)</sup> Varianz-Swaps

## DEVISETERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	03.2021	\$ 180	THB 5.412	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BOA	01.2021	CLP 113.089	\$ 146	0	(14)	(14)	(0,04)
	01.2021	COP 612.362	176	0	(3)	(3)	(0,01)
	01.2021	CZK 2.312	99	0	(8)	(8)	(0,03)
	01.2021	€ 53	64	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	HUF 13.798	46	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	MXN 3.759	180	0	(9)	(9)	(0,03)
	01.2021	\$ 296	CLP 225.066	21	0	21	0,07
	01.2021	109	HUF 33.672	5	0	5	0,01
	01.2021	157	¥ 16.400	1	0	1	0,00
	01.2021	694	PLN 2.685	26	0	26	0,08
	01.2021	ZAR 1.028	\$ 66	0	(3)	(3)	(0,01)
	02.2021	CZK 587	26	0	(1)	(1)	0,00
	03.2021	¥ 160.000	1.533	0	(18)	(18)	(0,05)
	03.2021	\$ 94	INR 7.022	1	0	1	0,00
BPS	01.2021	BRL 2.056	\$ 396	0	0	0	0,00
	01.2021	CLP 52.676	66	0	(8)	(8)	(0,02)
	01.2021	€ 153	185	0	(2)	(2)	(0,01)
	01.2021	MXN 4.894	247	2	0	2	0,01

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2021	\$	404 BRL	2.056	\$ 0	\$ (8)	(0,02)
	01.2021		25 CLP	18.836	1	0	0,00
	01.2021		103 COP	397.374	13	0	0,04
	01.2021		419 €	344	2	0	0,01
	01.2021		235 PLN	911	9	0	0,03
	02.2021		313 RUB	23.087	1	(3)	(0,01)
	03.2021		16 HKD	123	0	0	0,00
	03.2021		1.200 IDR	17.121.336	24	0	0,07
	03.2021		2.515 INR	188.646	48	0	0,15
	03.2021		29 MYR	120	1	0	0,00
	03.2021		580 PHP	27.959	0	0	0,00
	03.2021		1.544 SGD	2.084	33	0	0,10
	03.2021		1.868 TWD	52.301	17	0	0,05
BRC	01.2021	BRL	531 \$	102	0	0	0,00
	01.2021	MXN	2.279	108	0	(6)	(0,02)
	01.2021	\$	101 BRL	531	1	0	0,00
	01.2021		942 TRY	7.428	52	0	0,16
	02.2021	BRL	531 \$	101	0	(1)	0,00
	02.2021	CZK	1.790	80	0	(3)	(0,01)
	02.2021	\$	208 CZK	4.559	5	0	0,01
	03.2021	MYR	459 \$	113	0	(1)	0,00
	03.2021	\$	116 MYR	473	2	0	0,01
BSS	01.2021	CLP	726.088	\$ 894	0	(129)	(0,39)
	07.2021		1.008.897	1.359	0	(63)	(0,19)
CBK	09.2021	\$	39 UYU	1.773	1	0	0,00
	01.2021	BRL	2.110	\$ 408	3	(1)	0,01
	01.2021	CLP	29.115	37	0	(4)	(0,01)
	01.2021	CZK	2.153	93	0	(7)	(0,02)
	01.2021	PEN	3.257	904	3	0	0,01
	01.2021	PLN	454	123	1	0	0,00
	01.2021	\$	403 BRL	2.110	4	(1)	0,01
	01.2021		63 CLP	47.596	4	0	0,01
	01.2021		20 HUF	6.142	1	0	0,00
	01.2021		12 PLN	45	0	0	0,00
	01.2021		203 RUB	15.635	8	0	0,02
	01.2021		2 TRY	15	0	0	0,00
	01.2021		77 UYU	3.318	1	0	0,00
	01.2021	ZAR	3.908	\$ 249	0	(16)	(0,05)
	02.2021	EGP	2.000	121	0	(4)	(0,01)
	02.2021	PEN	5.952	1.661	15	0	0,05
	02.2021	\$	328 PEN	1.183	0	(1)	0,00
	02.2021		195 RUB	14.369	0	(2)	(0,01)
	03.2021	¥	160.000	\$ 1.535	0	(15)	(0,05)
	03.2021	\$	1.827 CNH	12.203	42	0	0,13
	03.2021		132 CNY	869	1	0	0,00
	03.2021		279 PEN	999	0	(3)	(0,01)
	03.2021		10 UYU	431	0	0	0,00
	04.2021	EGP	8.547	\$ 520	0	(9)	(0,03)
	05.2021	\$	1.575 PEN	5.705	6	(4)	0,01
DUB	01.2021	BRL	957 \$	180	0	(4)	(0,01)
	01.2021	CLP	55.859	71	0	(8)	(0,02)
	01.2021	\$	184 BRL	957	0	0	0,00
	01.2021		6 RUB	452	0	0	0,00
	02.2021	PEN	544 \$	151	1	0	0,00
GLM	01.2021	BRL	1.480	285	0	0	0,00
	01.2021	CLP	796	1	0	0	0,00
	01.2021	DOP	2.693	46	0	(1)	0,00
	01.2021	HUF	22.135	71	0	(4)	(0,01)
	01.2021	MXN	3.518	171	0	(5)	(0,01)
	01.2021	\$	287 BRL	1.480	3	(5)	(0,01)
	01.2021		82 CLP	61.865	5	0	0,02
	01.2021		71 COP	264.781	6	0	0,02
	01.2021		88 HUF	26.006	0	(1)	0,00
	01.2021		936 MXN	19.356	34	0	0,10
	01.2021		30 PEN	108	0	0	0,00
	01.2021		289 RUB	22.098	9	0	0,03
	01.2021		32 TRY	248	1	0	0,00
	02.2021	DOP	13.297	\$ 225	0	(2)	(0,01)
	02.2021	\$	141 CZK	3.050	2	0	0,01
	02.2021		250 HKD	1.937	0	0	0,00
	02.2021		570 RON	2.343	18	0	0,05
	02.2021		61 RUB	4.675	2	0	0,01
	03.2021	DOP	37.280	\$ 627	0	(8)	(0,02)
	03.2021	MXN	12.471	625	4	0	0,01
	03.2021	\$	629 DOP	37.280	7	0	0,02
	03.2021		58 MYR	236	1	0	0,00
	03.2021		44 PHP	2.129	0	0	0,00
	03.2021		1.550 THB	47.161	25	0	0,08
	04.2021	DOP	23.438	\$ 394	0	(3)	(0,01)
	04.2021	\$	487 COP	1.790.833	35	0	0,11
HUS	05.2021	DOP	13.232	\$ 223	0	(1)	0,00
	01.2021	BRL	5.223	1.032	27	0	0,08

# Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

## Aufstellung der Wertpapieranlagen

(Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	01.2021	£	96	\$	128	\$	0
	01.2021	MXN	1.246		62		(3)
	01.2021	\$	1.005	BRL	5.223		(1)
	01.2021		360	COP	1.231.466		0
	01.2021		119	MXN	2.445		0
	01.2021		591	PLN	2.256		4
	01.2021		88	UYU	3.742		0
	01.2021	ZAR	5.188	\$	330		0
	02.2021	HKD	1.937		249		(23)
	02.2021	\$	1.032	BRL	5.223		(1)
	02.2021		461	RUB	34.281		(26)
	02.2021	UYU	3.960	\$	93		(1)
	03.2021	CLP	2.104.781		2.654		0
	03.2021	COP	1.189.734		347		(310)
	03.2021	EGP	5.000		302		0
	03.2021	INR	14.555		195		(11)
	03.2021	\$	306	CNH	2.019		(3)
	03.2021		845	CNY	5.607		0
	03.2021		94	INR	7.005		4
	03.2021		779	SGD	1.045		12
	03.2021		21	UYU	907		0
	04.2021	COP	737.634	\$	183		0
	04.2021	\$	65	PEN	236		(32)
	11.2021	CNH	2.300	\$	345		0
	01.2022	BRL	302		53		(2)
IND	01.2021	PLN	185		49		(4)
	02.2021	RON	167		42		(1)
	02.2021	\$	277	CZK	6.108		0
	03.2021		69	TWD	1.913		8
JPM	01.2021	BRL	1.097	\$	211		0
	01.2021	CLP	56.429		71		0
	01.2021	COP	1.281.259		352		(8)
	01.2021	MXN	4.777		237		(8)
	01.2021	RSD	6.335	€	54		(23)
	01.2021	\$	214	BRL	1.097		(3)
	01.2021		3.950	CLP	3.107.519		0
	01.2021		11	€	9		424
	01.2021		379	TRY	3.001		0
	01.2021		92	UYU	3.973		24
	02.2021	CZK	1.955	\$	91		1
	02.2021	ILS	2.379		689		0
	02.2021	\$	645	CZK	14.507		(53)
	02.2021		54	ILS	175		31
	02.2021		39	RON	160		0
	03.2021	EGP	231	\$	13		(1)
	03.2021	IDR	1.276.972		89		(1)
	03.2021	\$	46	IDR	654.810		(2)
	03.2021		187	INR	13.920		0
	03.2021		22	PHP	1.066		2
MYI	01.2021	COP	79.025	\$	23		0
	01.2021	PEN	72		20		0
	01.2021	\$	35	CLP	25.895		0
	01.2021		93	PLN	353		1
	01.2021		9	TRY	78		0
	01.2021	ZAR	1.007	\$	68		0
	02.2021	\$	175	RUB	13.005		0
	03.2021	CNH	1.896	\$	288		0
	03.2021	MXN	12.500		622		(2)
	03.2021	\$	257	CNY	1.689		(1)
	03.2021		13	EGP	231		0
	03.2021		92	IDR	1.305.719		1
	10.2021		14	TRY	138		0
	11.2022	ILS	2.700	\$	840		3
RBC	01.2021	CLP	25.486		35		(11)
	01.2021	¥	16.400		158		(1)
	01.2021	\$	156	€	128		(1)
RYL	02.2021		63	ILS	214		1
	03.2021	THB	3.525	\$	117		3
	03.2021	\$	139	TWD	3.850		(1)
SCX	01.2021	BRL	604	\$	116		0
	01.2021	€	410		491		0
	01.2021	TRY	752		98		(11)
	01.2021	\$	115	BRL	604		(3)
	01.2021		23	COP	79.025		0
	01.2021		652	HUF	199.239		0
	01.2021		155	ZAR	2.322		20
	02.2021	€	410	\$	502		2
	02.2021	\$	1.062	ILS	3.646		0
	03.2021	COP	79.025	\$	23		0
	03.2021	\$	247	KRW	268.551		0
	03.2021		1.490	MYR	6.065		0
SOG	01.2021	HUF	16.837	\$	57		0

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens					
SSB	03.2021	SGD	233	\$	175	\$	0	(2)	(0,01)			
	01.2021	MXN	137		7		0	0	0,00			
	01.2021	\$	614	BRL	3.260		14	0	0,04			
	01.2021		192	PLN	705		0	(3)	(0,01)			
	02.2021	RUB	12.634	\$	167		0	(3)	(0,01)			
	03.2021	KRW	319.743		289		0	(5)	(0,01)			
	03.2021	PHP	2.084		43		0	0	0,00			
	03.2021	TWD	5.562		200		0	0	0,00			
	03.2021	\$	3.197	KRW	3.557.871		76	0	76	0,23		
	03.2021		2.441	MXN	50.057		49	0	49	0,15		
TOR	03.2021		270	SGD	361		3	0	0,01			
	01.2021	BRL	4.651	\$	917		22	0	0,07			
UAG	01.2021	TRY	78		9		0	(1)	0,00			
	01.2021	\$	896	BRL	4.651		0	(1)	0,00			
	01.2021		833	MXN	16.883		12	0	0,04			
	02.2021	ILS	114	\$	35		0	0	0,00			
	02.2021	\$	365	CZK	8.029		9	0	0,03			
	02.2021		771	RUB	57.519		6	(2)	0,01			
	03.2021	CNH	1.086	\$	166		0	(1)	0,00			
	03.2021	\$	123	KRW	133.834		0	0	0,00			
	10.2021	TRY	138	\$	14		0	(3)	(0,01)			
							\$	1.402	\$	(954)	\$	448
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$	670	2,06				
Summe Anlagen						\$	33.560	103,04				
Sonstige Aktiva und Passiva						\$	(989)	(3,04)				
Nettovermögen						\$	32.571	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) 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) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 281 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 211 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	0	322	0	322
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.612</b>	<b>\$ 31.848</b>	<b>\$ 100</b>	<b>\$ 33.560</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 65.520	\$ 24	\$ 65.544
Investmentfonds	6.623	0	0	6.623
Pensionsgeschäfte	0	178	0	178
Einlagen bei Kreditinstituten	0	501	0	501
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	1.037	0	1.037
<b>Summen</b>	<b>\$ 6.623</b>	<b>\$ 67.236</b>	<b>\$ 24</b>	<b>\$ 73.883</b>

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

# Aufstellung der Wertpapieranlagen

## Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

(Forts.)

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

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

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
	\$	\$	\$
AZD	1	0	1
BOA	1	0	1
BPS	143	(230)	(87)
BRC	52	(10)	42
BSS	(191)	0	(191)
CBK	28	0	28
DUB	(11)	(40)	(51)
FBF	(1)	0	(1)
GLM	306	(260)	46
HUS	(338)	281	(57)
IND	7	0	7
JPM	395	(330)	65
MYI	(1)	0	(1)
NGF	2	0	2
RBC	(1)	0	(1)
RYL	2	0	2
SCX	104	0	104
SOG	(2)	0	(2)
SSB	79	0	79
TOR	52	0	52
UAG	43	0	43

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	32,27	53,25
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	36,16	34,97
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,98	0,00
Investmentfonds	9,73	8,92
Pensionsgeschäfte	21,91	0,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,07)	(0,18)
Freiverkehrsinanzderivate	2,06	1,58
Einlagenzertifikate	k. A.	0,67

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Argentinien	0,83	0,68
Australien	k. A.	0,27
Brasilien	3,67	5,91
Kanada	k. A.	2,30
Cayman-Inseln	0,69	2,36
Chile	4,36	1,87
China	0,63	3,60
Kolumbien	3,21	5,12
Dominikanische Republik	2,73	2,50
Ägypten	1,24	0,41
El Salvador	k. A.	0,15
Frankreich	0,11	0,04
Ghana	0,54	k. A.
Deutschland	k. A.	2,90
Guatemala	k. A.	1,01
Hongkong	1,24	2,31
Ungarn	0,23	4,06
Indien	0,63	2,73
Indonesien	k. A.	1,97
Irland	k. A.	2,58
Israel	2,64	0,56
Italien	0,38	0,15
Japan	k. A.	0,27
Luxemburg	0,94	1,43
Mauritius	0,67	0,27
Mexiko	0,47	5,02
Niederlande	k. A.	1,16
Peru	2,17	1,61
Katar	0,39	0,60
Russland	0,16	1,06

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Serbien	0,20	k. A.
Singapur	k. A.	0,54
Südafrika	4,99	0,14
Südkorea	k. A.	0,55
Supranational	0,62	0,28
Tansania	k. A.	0,03
Ukraine	0,31	0,56
Vereinigte Arabische Emirate	k. A.	0,68
Großbritannien	0,43	2,62
USA	7,52	23,35
Uruguay	0,24	k. A.
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	0,41
Kurzfristige Instrumente	28,17	4,16
Investmentfonds	9,73	8,92
Pensionsgeschäfte	21,91	0,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(1,07)	(0,18)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,11	0,01
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Devisenoptionen	(0,07)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,03	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Cross-Currency Swaps	0,59	0,12
Zinsswaps	0,00	0,06
Volatilitätsswaps	0,02	k. A.
Devisenterminkontrakte	1,37	1,39
Einlagenzertifikate	k. A.	0,67
Sonstige Aktiva und Passiva	(3,04)	0,55
Nettovermögen	100,00	100,00



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
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 0,465 % fällig am 30.05.2024	€ 700	€ 714	0,02	Deutsche Telekom International Finance BV 1,950 % fällig am 19.09.2021	\$ 1.800	€ 1.485	0,05	Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	€ 2.300	€ 2.311	0,07
Temasek Financial Ltd. 0,500 % fällig am 01.03.2022	1.000	1.006	0,03	2,125 % fällig am 18.01.2021	€ 2.000	2.002	0,06	Utah Acquisition Sub, Inc. 3,150 % fällig am 15.06.2021	\$ 500	413	0,01
UBS AG 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h)	\$ 1.950	1.765	0,05	Diageo Finance PLC 0,250 % fällig am 22.10.2021	600	603	0,02	Virgin Media Secured Finance PLC 5,000 % fällig am 15.04.2027	£ 2.100	2.465	0,08
UBS Group AG 0,159 % fällig am 20.09.2022	€ 500	502	0,02	Equifax, Inc. 3,600 % fällig am 15.08.2021	\$ 200	167	0,01	Volkswagen International Finance NV 0,500 % fällig am 30.03.2021	€ 2.400	2.403	0,07
1,250 % fällig am 17.04.2025	1.600	1.668	0,05	Essity AB 0,500 % fällig am 26.05.2021	€ 5.600	5.615	0,17	2,000 % fällig am 26.03.2021	1.300	1.307	0,04
4,125 % fällig am 24.09.2025	\$ 2.400	2.248	0,07	Fidelity National Information Services, Inc. 0,125 % fällig am 21.05.2021	2.300	2.303	0,07	Vulcan Materials Co. 0,875 % fällig am 01.03.2021	\$ 200	164	0,01
5,750 % fällig am 19.02.2022 (f)(h)	€ 5.575	5.856	0,18	0,125 % fällig am 03.12.2022	5.000	5.027	0,15	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 0,989 % fällig am 19.03.2021	133	109	0,00
Volkswagen Bank GmbH 0,000 % fällig am 15.06.2021	1.500	1.502	0,05	G4S International Finance PLC 1,500 % fällig am 09.01.2023	200	201	0,01	1,414 % fällig am 13.12.2022	€ 3.100	3.186	0,10
0,168 % fällig am 08.12.2021	5.000	5.017	0,15	General Electric Co. 0,875 % fällig am 17.05.2025	800	825	0,03	3,150 % fällig am 01.04.2022	\$ 3.100	2.606	0,08
0,625 % fällig am 08.09.2021	1.000	1.006	0,03	Imperial Brands Finance PLC 0,500 % fällig am 27.07.2021	1.600	1.604	0,05	3,550 % fällig am 01.04.2025	200	181	0,01
0,955 % fällig am 01.08.2022	1.800	1.830	0,06	3,375 % fällig am 26.02.2026	7.500	8.573	0,26			150.801	4,65
1,250 % fällig am 01.08.2022	200	204	0,01	International Flavors & Fragrances, Inc. 0,500 % fällig am 25.09.2021	1.200	1.205	0,04	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
1,875 % fällig am 31.01.2024	2.000	2.108	0,06	Interpublic Group of Cos., Inc. 4,000 % fällig am 15.03.2022	\$ 400	340	0,01	AES Corp. 1,375 % fällig am 15.01.2026	9.400	7.756	0,24
Volkswagen Financial Services AG 0,287 % fällig am 15.02.2021	2.600	2.602	0,08	IQVIA, Inc. 2,875 % fällig am 15.09.2025	€ 2.100	2.131	0,07	AT&T, Inc. 0,326 % fällig am 05.09.2023	€ 6.700	6.794	0,21
0,875 % fällig am 12.04.2023	300	306	0,01	3,250 % fällig am 15.03.2025	800	810	0,02	BG Energy Capital PLC 4,000 % fällig am 15.10.2021	\$ 400	336	0,01
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£ 2.800	3.160	0,10	Japan Tobacco, Inc. 2,000 % fällig am 13.04.2021	\$ 600	492	0,01	British Telecommunications PLC 0,625 % fällig am 10.03.2021	€ 4.000	4.007	0,12
Volkswagen Leasing GmbH 0,250 % fällig am 16.02.2021	€ 7.800	7.805	0,24	Keurig Dr Pepper, Inc. 2,530 % fällig am 15.11.2021	1.000	833	0,03	2,125 % fällig am 26.09.2028	200	226	0,01
1,000 % fällig am 16.02.2023	700	715	0,02	Komatsu Finance America, Inc. 0,849 % fällig am 09.09.2023	4.400	3.625	0,11	Duke Energy Corp. 3,050 % fällig am 15.08.2022	\$ 300	254	0,01
1,375 % fällig am 20.01.2025	700	733	0,02	Molnlycke Holding AB 1,750 % fällig am 28.02.2024	€ 400	422	0,01	E.ON SE 0,375 % fällig am 23.08.2021	€ 1.900	1.905	0,06
Vonovia Finance BV 5,000 % fällig am 02.10.2023	\$ 500	437	0,01	1,875 % fällig am 28.02.2025	400	429	0,01	Eversource Energy 2,750 % fällig am 15.03.2022	\$ 200	168	0,01
Wells Fargo & Co. 0,000 % fällig am 31.01.2022	€ 10.200	10.243	0,32	Molson Coors Beverage Co. 2,100 % fällig am 15.07.2021	\$ 200	165	0,01	FLUVIUS System Operator CVBA 4,500 % fällig am 08.11.2021	€ 600	623	0,02
1,144 % fällig am 11.02.2022	\$ 900	736	0,02	2,000 % fällig am 28.10.2021	400	331	0,01	Ohio Power Co. 5,375 % fällig am 01.10.2021	\$ 500	423	0,01
1,325 % fällig am 24.01.2023	3.400	2.803	0,09	Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	€ 5.300	5.528	0,17	Petrobras Global Finance BV 5,093 % fällig am 15.01.2030	506	463	0,01
1,741 % fällig am 04.05.2030	€ 2.500	2.778	0,09	Oracle Corp. 3,600 % fällig am 01.04.2040	\$ 2.800	2.686	0,08	SPP-Distribucija A/S 2,625 % fällig am 23.06.2021	€ 800	811	0,02
		882.493	27,21	3,600 % fällig am 01.04.2050	3.000	2.862	0,09	Sprint Communications, Inc. 6,000 % fällig am 15.11.2022	\$ 100	88	0,00
				3,850 % fällig am 01.04.2060	1.200	1.209	0,04	SSE PLC 1,750 % fällig am 16.04.2030	€ 2.000	2.243	0,07
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Origin Energy Finance Ltd. 3,500 % fällig am 04.10.2021	€ 800	822	0,02	Telenor ASA 0,000 % fällig am 25.09.2023 (c)	5.400	5.437	0,17
AbbVie, Inc. 3,375 % fällig am 14.11.2021	\$ 1.300	1.091	0,03	4,300 % fällig am 15.07.2047	\$ 622	613	0,02	Telstra Corp. Ltd. 4,800 % fällig am 12.10.2021	\$ 800	676	0,02
5,000 % fällig am 15.12.2021	100	84	0,00	Penske Truck Leasing Co. LP 3,375 % fällig am 01.02.2022	400	336	0,01	Verizon Communications, Inc. 3,875 % fällig am 08.02.2029	2.000	1.927	0,06
Anheuser-Busch InBev S.A. 3,250 % fällig am 24.01.2033	€ 2.500	3.277	0,10	Philip Morris International, Inc. 2,500 % fällig am 02.11.2022	300	255	0,01			34.137	1,05
Arrow Electronics, Inc. 3,500 % fällig am 01.04.2022	\$ 700	589	0,02	ProSiebenSat.1 Media SE 2,625 % fällig am 15.04.2021	€ 500	500	0,02	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		1.067.431	32,91
AstraZeneca PLC 0,250 % fällig am 12.05.2021	€ 2.300	2.301	0,07	Raytheon Technologies Corp. 2,800 % fällig am 15.03.2022	\$ 1.100	925	0,03	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Bacardi Ltd. 2,750 % fällig am 03.07.2023	1.000	1.052	0,03	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 2,375 % fällig am 24.06.2022	200	168	0,01	Fannie Mae 0,191 % fällig am 25.07.2037	8	7	0,00
BAT Capital Corp. 0,000 % fällig am 16.08.2021	5.900	5.910	0,18	Refinitiv U.S. Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 15.05.2026	€ 2.000	2.110	0,06	0,548 % fällig am 25.06.2036	60	49	0,00
Bayer AG 0,375 % fällig am 06.07.2024	9.100	9.231	0,28	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2,400 % fällig am 23.09.2021	\$ 191	158	0,00	Freddie Mac 0,499 % fällig am 15.01.2038	889	727	0,02
1,875 % fällig am 25.01.2021	3.500	3.504	0,11	Southern Co. 2,350 % fällig am 01.07.2021	3.626	2.987	0,09	2,663 % fällig am 15.01.2038 (a)	889	44	0,00
Bayer Capital Corp. BV 0,009 % fällig am 26.06.2022	3.800	3.814	0,12	Syngenta Finance NV 1,875 % fällig am 02.11.2021	€ 900	910	0,03	2,869 % fällig am 01.09.2037	1.634	1.409	0,04
BMW Finance NV 0,061 % fällig am 24.06.2022	15.500	15.592	0,48	3,933 % fällig am 23.04.2021	€ 1.200	987	0,03	3,500 % fällig am 01.10.2047	5.797	5.035	0,16
Campbell Soup Co. 0,847 % fällig am 15.03.2021	\$ 200	164	0,01	TDF Infrastructure SASU 2,500 % fällig am 07.04.2026	€ 800	878	0,03	Ginnie Mae 0,590 % fällig am 20.08.2066	32	26	0,00
Capgemini SE 2,500 % fällig am 01.07.2023	€ 3.300	3.500	0,11	Teleperformance 1,875 % fällig am 02.07.2025	300	323	0,01	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2029 - 01.08.2041	1.222	1.122	0,04
Charter Communications Operating LLC 4,464 % fällig am 23.07.2022	\$ 500	431	0,01	Tesco PLC 6,125 % fällig am 24.02.2022	£ 75	89	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	226.000	191.259	5,90
CVS Health Corp. 0,950 % fällig am 09.03.2021	900	736	0,02	Time Warner Cable LLC 4,000 % fällig am 01.09.2021	\$ 700	580	0,02	2,500 % fällig am 01.03.2051	103.800	89.160	2,75
Daimler Canada Finance, Inc. 0,155 % fällig am 11.09.2022	€ 12.700	12.779	0,39					3,000 % fällig am 01.01.2051	56.600	48.471	1,49
Daimler Finance North America LLC 2,200 % fällig am 30.10.2021	\$ 150	124	0,00					3,500 % fällig am 01.01.2036 - 01.02.2051	107.700	93.071	2,87
3,350 % fällig am 04.05.2021	300	248	0,01								
Daimler International Finance BV 0,000 % fällig am 11.05.2022	€ 2.500	2.507	0,08								
Danone S.A. 2,077 % fällig am 02.11.2021	\$ 200	165	0,01								
Dell Bank International DAC 0,625 % fällig am 17.10.2022	€ 4.400	4.443	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
4,000 % fällig am 01.01.2051	\$68.600	€ 59.950	1,85	Dutch Property Finance BV 0,121 % fällig am 28.04.2051	€ 5.291	€ 5.284	0,16	RMAC Securities PLC 0,191 % fällig am 12.06.2044	£ 82	€ 87	0,00
		490.330	15,12	European Loan Conduit 1,000 % fällig am 17.02.2030	5.295	5.279	0,16	0,211 % fällig am 12.06.2044	1.453	1.569	0,05
<b>US-SCHATZOBIGLIGATIONEN</b>				European Residential Loan Securitisation DAC 0,276 % fällig am 24.03.2063	6.545	6.544	0,20	Rochester Financing PLC 1,337 % fällig am 18.06.2045	1.509	1.687	0,05
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e) 0,125 % fällig am 15.07.2030	29.959	27.491	0,85	Eurosail PLC 0,000 % fällig am 13.03.2045	1.827	1.804	0,06	SapphireOne Mortgages FCT 0,002 % fällig am 27.06.2061	€ 4.626	4.634	0,14
0,875 % fällig am 15.02.2047	2.157	2.375	0,07	0,198 % fällig am 10.12.2044	€ 411	457	0,01	Silverstone Master Issuer PLC 0,000 % fällig am 21.01.2070	3.591	3.594	0,11
1,000 % fällig am 15.02.2048	14.466	16.492	0,51	Feldspar PLC 0,743 % fällig am 15.09.2045	205	229	0,01	0,806 % fällig am 21.01.2070	€ 6.831	7.707	0,24
		46.358	1,43	Finsbury Square PLC 0,000 % fällig am 16.06.2070	4.833	5.439	0,17	Southern Pacific Financing PLC 0,211 % fällig am 10.06.2043	50	56	0,00
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				0,691 % fällig am 12.09.2065	931	1.040	0,03	Southern Pacific Securities PLC 0,338 % fällig am 10.03.2044	1.472	1.640	0,05
Adjustable Rate Mortgage Trust 2,746 % fällig am 25.01.2036 ^	17	13	0,00	0,854 % fällig am 16.03.2070	8.531	9.515	0,29	Storm BV 0,093 % fällig am 22.01.2064	€ 1.300	1.306	0,04
Alba PLC 0,234 % fällig am 25.11.2042	€ 361	392	0,01	1,016 % fällig am 16.06.2069	4.603	5.151	0,16	Stratton Mortgage Funding PLC 0,954 % fällig am 12.03.2052	€ 8.122	9.006	0,28
American Home Mortgage Investment Trust 1,757 % fällig am 25.09.2045	\$ 11	9	0,00	1,064 % fällig am 16.12.2069	5.933	6.645	0,21	Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,338 % fällig am 25.06.2036	\$ 111	90	0,00
6,500 % fällig am 25.03.2047	590	463	0,02	0,084 % fällig am 16.09.2069	5.422	6.075	0,19	0,652 % fällig am 19.07.2035	6	5	0,00
Avon Finance No. 2 PLC 0,954 % fällig am 20.09.2048	€ 6.712	7.491	0,23	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust 2,921 % fällig am 25.03.2035	\$ 41	26	0,00	0,852 % fällig am 19.12.2034	108	87	0,00
Banc of America Funding Trust 0,752 % fällig am 20.05.2047	\$ 94	75	0,00	Gosforth Funding PLC 0,000 % fällig am 15.02.2058	€ 6.069	6.071	0,19	0,852 % fällig am 19.02.2035	107	89	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 2,410 % fällig am 25.10.2035	45	37	0,00	Great Hall Mortgages PLC 0,000 % fällig am 18.03.2039	485	481	0,02	3,625 % fällig am 25.02.2036 ^	394	313	0,01
2,550 % fällig am 25.07.2033	6	4	0,00	0,187 % fällig am 18.06.2038	€ 151	166	0,01	Towd Point Mortgage Funding PLC 0,955 % fällig am 20.05.2045	€ 9.648	10.774	0,33
3,633 % fällig am 25.07.2036	390	229	0,01	0,366 % fällig am 18.06.2039	\$ 112	90	0,00	1,073 % fällig am 20.10.2051	14.322	16.064	0,50
4,130 % fällig am 25.08.2035 ^	108	87	0,00	GSR Mortgage Loan Trust 3,050 % fällig am 25.01.2036 ^	6	5	0,00	Trinity Square PLC 1,196 % fällig am 15.07.2051	121	135	0,00
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust 2,728 % fällig am 26.12.2046 ^	94	68	0,00	HarborView Mortgage Loan Trust 2,785 % fällig am 19.05.2033	5	4	0,00	Tudor Rose Mortgages PLC 1,303 % fällig am 20.06.2048	4.690	5.253	0,16
Bluestep Mortgage Securities DAC 0,000 % fällig am 10.08.2066	€ 774	774	0,02	Hawksmoor Mortgages PLC 1,104 % fällig am 25.05.2053	€ 16.742	18.734	0,58	Twin Bridges PLC 0,000 % fällig am 14.12.2054	7.051	7.940	0,25
Business Mortgage Finance PLC 0,000 % fällig am 15.08.2040	295	293	0,01	IndyMac Mortgage Loan Trust 0,338 % fällig am 25.09.2046	\$ 803	603	0,02	Uropa Securities PLC 0,238 % fällig am 10.06.2059	542	582	0,02
Canada Square Funding PLC 1,156 % fällig am 17.10.2051	€ 9.398	10.511	0,32	1,064 % fällig am 25.11.2035	108	83	0,00	0,388 % fällig am 10.06.2059	140	146	0,01
Canterbury Finance No. 1 PLC 1,225 % fällig am 16.05.2056	1.211	1.357	0,04	Jubilee Place BV 0,485 % fällig am 17.10.2057	€ 4.000	3.997	0,12	0,588 % fällig am 10.06.2059	109	110	0,00
Canterbury Finance No. 3 PLC 1,053 % fällig am 16.05.2057	3.819	4.254	0,13	Jupiter Mortgage Ltd. 1,000 % fällig am 01.06.2060 (b)	€ 16.600	18.384	0,57	0,788 % fällig am 10.06.2059	117	121	0,00
Chase Mortgage Finance Trust 3,356 % fällig am 25.01.2036	\$ 3.556	2.816	0,09	Lanebrook Mortgage Transaction PLC 1,154 % fällig am 12.06.2057	3.855	4.315	0,13	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,517 % fällig am 25.05.2037 ^	\$ 1.059	838	0,03
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	109	63	0,00	Mansard Mortgages PLC 0,693 % fällig am 15.12.2049	1.597	1.762	0,06	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 1,359 % fällig am 25.02.2047 ^	3.784	2.760	0,09
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates 0,653 % fällig am 16.01.2057	€ 4.152	4.628	0,14	Mars SRL 0,789 % fällig am 25.10.2050	€ 323	325	0,01	Wells Fargo Alternative Loan Trust 3,327 % fällig am 25.07.2037 ^	46	34	0,00
Ciel No. 1 PLC 1,091 % fällig am 12.06.2046	2.421	2.710	0,08	MASTR Asset Securitization Trust 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	\$ 156	112	0,00				
Citigroup Mortgage Loan Trust 2,520 % fällig am 25.11.2035	\$ 48	38	0,00	Miravet SARL 0,322 % fällig am 26.05.2065	€ 7.100	6.967	0,22	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
4,005 % fällig am 25.03.2034	2	2	0,00	Newgate Funding PLC 0,173 % fällig am 15.12.2050	€ 52	58	0,00	Accunia European CLO BV 0,950 % fällig am 15.07.2030	€ 7.300	7.304	0,22
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 3,494 % fällig am 25.08.2035 ^	591	480	0,02	1,043 % fällig am 15.12.2050	324	348	0,01	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,298 % fällig am 25.07.2036	\$ 576	230	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates				Oncilla Mortgage Funding PLC 1,435 % fällig am 12.12.2043	1.700	1.903	0,06	Adagio CLO Ltd. 0,660 % fällig am 15.10.2029	€ 990	989	0,03
2,674 % fällig am 25.09.2035 ^	818	623	0,02	Paragon Mortgages PLC 1,105 % fällig am 15.05.2045	4.001	4.492	0,14	AlbaCore EURO CLO DAC 1,530 % fällig am 18.07.2031	6.000	6.037	0,19
Countrywide Alternative Loan Trust 0,488 % fällig am 25.11.2036	89	82	0,00	Polaris PLC 1,301 % fällig am 27.05.2057	7.852	8.798	0,27	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
0,568 % fällig am 25.07.2046	173	132	0,00	Residential Accredited Loans, Inc. Trust 0,308 % fällig am 25.03.2047	\$ 1.599	1.231	0,04	0,853 % fällig am 25.01.2036	\$ 2.000	1.626	0,05
0,598 % fällig am 25.09.2035 ^	1.858	1.000	0,03	0,508 % fällig am 25.07.2036 ^	1.578	742	0,02	Arbour CLO DAC 0,580 % fällig am 15.03.2029	€ 978	977	0,03
0,804 % fällig am 20.11.2035	425	323	0,01	0,508 % fällig am 25.06.2046	358	104	0,00	0,870 % fällig am 15.01.2030	€ 7.000	7.002	0,22
1,609 % fällig am 25.12.2035	5	4	0,00	6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	70	57	0,00	Asset-Backed European Securitisation Transaction 0,000 % fällig am 23.08.2030	605	606	0,02
3,446 % fällig am 25.06.2037 ^	86	64	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	506	404	0,01	Asset-Backed Funding Certificates Trust 1,148 % fällig am 25.06.2037	\$ 96	72	0,00
5,250 % fällig am 25.06.2035 ^	6	4	0,00	Residential Asset Securitization Trust 5,750 % fällig am 25.02.2036	1.700	1.338	0,04	Aurium CLO DAC 0,670 % fällig am 16.04.2030	€ 6.100	6.078	0,19
6,000 % fällig am 25.03.2036 ^	243	139	0,00	Residential Mortgage Securities PLC 1,234 % fällig am 20.09.2065	€ 449	502	0,02	0,680 % fällig am 13.10.2029	5.471	5.475	0,17
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	353	212	0,01	1,304 % fällig am 20.06.2070	6.619	7.440	0,23	Auto ABS French Leases 0,007 % fällig am 28.05.2030	2.038	2.040	0,06
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0,728 % fällig am 25.04.2035	163	122	0,00	Resloc UK PLC 0,000 % fällig am 15.12.2043	€ 1.073	1.033	0,03	Babson Euro CLO BV 0,309 % fällig am 25.10.2029	4.954	4.917	0,15
0,788 % fällig am 25.03.2035	213	155	0,01	Ripon Mortgages PLC 0,851 % fällig am 20.08.2056	€ 11.494	12.834	0,40	Barings Euro CLO BV 0,680 % fällig am 27.07.2030	3.226	3.222	0,10
0,888 % fällig am 25.02.2035	220	163	0,01	RMAC PLC 0,741 % fällig am 12.06.2046	217	241	0,01	1,050 % fällig am 27.07.2030	285	285	0,01
2,627 % fällig am 25.04.2035	136	97	0,00								
3,209 % fällig am 20.05.2036 ^	61	51	0,00								
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 0,338 % fällig am 25.08.2047	4.333	3.203	0,10								
Durham Mortgages A PLC 0,601 % fällig am 31.03.2053	€ 3.567	3.982	0,12								
Durham Mortgages B PLC 0,651 % fällig am 31.03.2054	3.349	3.734	0,12								



# Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
(0,150) % fällig am 12.01.2021 (c)(d)	¥ 7.860.000	€ 62.222	1,92	<b>BORSENGEHADELTE FONDS</b>			
(0,095) % fällig am 18.01.2021 (c)(d)	3.700.000	29.290	0,90	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (g)			
(0,079) % fällig am 01.02.2021 (c)(d)	3.270.000	25.888	0,80	431.390	€ 43.025	1,33	
		117.400	3,62	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (g)			
Summe kurzfristige Instrumente		150.639	4,64	2.795.000	273.839	8,44	
Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 3.233.815		99,70	Summe Investmentfonds	€ 316.864	9,77	

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	(2,400) %	31.12.2020	04.01.2021	€ 143.300	Belgium Government International Bond 0,200 % - 0,800 % fällig am 22.10.2023 - 22.06.2028	€ (143.374)	€ 143.300	€ 143.262	4,42
FICC	0,000	31.12.2020	04.01.2021	\$ 5.328	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	(4.442)	4.355	4.355	0,13
Summe Pensionsgeschäfte						€ (147.816)	€ 147.655	€ 147.617	4,55

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

AN EINEM GEREGLTEN 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
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 135,750 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond February 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Short	01.2021	514	€ 46	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 136,000 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Short	02.2021	519	50	0,00
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2021	2.413	(124)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	726	586	0,02
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2021	448	(30)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	1.125	(75)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	930	267	0,01
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	2.724	1.338	0,04
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2021	1.943	(170)	(0,01)
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	33	0	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2021	4.145	(769)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	2.004	471	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	1.017	(104)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	236	112	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	52	(94)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	357	419	0,01
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	373	(632)	(0,02)
				€ 1.291	0,04
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 1.291	0,04

<sup>(1)</sup> 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.12.2022	\$ 200	€ (18)	0,00

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 3.500	€ (1)	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 3.800	4	0,00
				€ 3	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,394 %	21.11.2023	\$ 126.600	€ (101)	0,00
Zahlung <sup>(2)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	16.06.2051	€ 6.000	(17)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2026	4.100	(5)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	124.100	(16)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	16.06.2031	£ 36.500	282	0,01
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051	300	(6)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,400	15.12.2024	105.500	3.475	0,11
Zahlung	UKRPI	3,473	15.08.2025	24.200	384	0,01
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	34.600	942	0,03
Zahlung	UKRPI	3,513	15.12.2029	19.200	812	0,02
					€ 5.750	0,18
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>€ 5.735</b>	<b>0,18</b>

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend<sup>2</sup>, außer Anzahl der Kontrakte)

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

## OPTIONSKAUF

## DEVISOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
HUS	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,315	07.01.2021	58.700	€ 615	€ 7	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,100 %	22.11.2021	27.000	€ 1.242	€ 1.094	0,03
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,195	02.11.2022	11.660	7	651	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	14.640	943	816	0,03
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	10.600	990	956	0,03
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	6.760	426	377	0,01
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,100	22.11.2021	20.900	982	847	0,03
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	8.500	773	767	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,344	17.11.2022	297.800	281	402	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,200	15.03.2021	11.500	1	853	0,03
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	11.200	702	631	0,02
						€ 6.347	€ 7.394	0,23	

## VERKAUFSOPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450 %	20.01.2021	36.200	€ (27)	€ (20)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	55.700	(76)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	11.800	(14)	(13)	0,00
BPS	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	13.800	(5)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	4.800	(5)	(3)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	13.800	(12)	(9)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	2.500	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	13.000	(12)	(15)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	13.000	(20)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	22.900	(23)	(15)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	32.900	(21)	(15)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	32.900	(26)	(30)	0,00
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	25.000	(27)	(16)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	14.400	(17)	(16)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	50.600	(20)	(20)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	50.600	(73)	(70)	(0,01)
DUB	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	3.300	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	21.400	(29)	(2)	0,00
FBF	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	12.000	(15)	(8)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
GST	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800 %	17.03.2021	2.400	€ (3)	€ (2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	15.000	(9)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	15.000	(13)	(14)	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	15.000	(23)	(2)	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	11.000	(5)	(4)	0,00
MYC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	11.000	(9)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	10.500	(12)	(7)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	9.300	(10)	(5)	0,00
						€ (511)	€ (314)	(0,01)

### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000 %	02.11.2022	35.000	€ 0	€ (602)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	43.990	(923)	(761)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	31.800	(967)	(954)	(0,03)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,200	22.11.2021	27.000	(880)	(870)	(0,03)
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,550	22.11.2021	27.000	(335)	(298)	(0,01)
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	20.310	(420)	(351)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	248.200	(325)	(270)	(0,01)
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	5.000	(190)	(34)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,200	22.11.2021	20.900	(655)	(673)	(0,02)
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,550	22.11.2021	20.900	(258)	(231)	(0,01)
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	25.500	(760)	(765)	(0,02)
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	3.000	(110)	(20)	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	33.600	(700)	(578)	(0,02)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	17.02.2021	5.000	(142)	(31)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,100	15.03.2021	23.000	0	(331)	(0,01)
						€ (6.665)	€ (6.769)	(0,21)	

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	\$ 102,906	11.03.2021	6.700	€ (19)	€ (38)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2050	103,367	14.01.2021	11.000	(41)	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2051	103,594	14.01.2021	15.000	(49)	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	8.700	(12)	(7)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	6.600	(13)	(24)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	5.700	(9)	(22)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	5.300	(11)	(11)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	99,688	04.02.2021	16.700	(84)	(69)	(0,01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,188	04.02.2021	13.200	(27)	(24)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,266	04.02.2021	13.500	(27)	(25)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	6.300	(16)	(5)	0,00
					€ (308)	€ (227)	(0,01)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
GST	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	\$ 200	€ (8)	€ 6	€ (2)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	21.500	(838)	518	(320)	(0,01)
					€ (846)	€ 524	€ (322)	(0,01)

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	01.2021	PLN	\$ 225	\$ 58	€ 0	€ (2)	0,00	
	02.2021	€	1.019	£ 911	0	(2)	0,00	
BPS	01.2021		\$ 32.277	\$ 39.502	5	5	0,00	
	01.2021	PLN	76	20	0	(1)	0,00	
BRC	02.2021	DKK	249.399	€ 33.513	9	9	0,00	
	03.2021	KRW	174.417	\$ 158	0	(2)	0,00	
	01.2021	€	992	1.202	0	(10)	0,00	
	01.2021	¥	11.560.000	€ 93.248	1.750	0	1.750	0,05
	01.2021	\$	135.027	110.528	180	0	180	0,01
	02.2021	€	1.066	£ 961	6	0	6	0,00
CBK	04.2022	DKK	44.600	€ 5.993	1	0	1	0,00
	07.2022		143.225	19.248	4	0	4	0,00
	01.2021	PLN	17	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2021	\$	8	RUB 592	0	0	0	0,00
	01.2021	ZAR	188	\$ 12	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$	9	RUB 687	0	0	0	0,00
	03.2021		6.191	MXN 126.471	81	0	81	0,00
DUB	06.2021	MXN	117.388	\$ 5.558	0	(185)	(185)	(0,01)
GLM	01.2021	\$	10	RUB 737	0	0	0	0,00
	02.2021	DKK	83.816	€ 11.262	3	0	3	0,00
	02.2021	€	8.910	DKK 66.295	0	(4)	(4)	0,00
	02.2021		1.062	£ 957	7	0	7	0,00
	02.2021		16.324	¥ 2.065.400	17	0	17	0,00
	02.2021	\$	6	RUB 420	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	PLN	189	\$ 50	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	ZAR	132	8	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	DKK	1.487.453	€ 199.859	37	0	37	0,00
	02.2021	¥	3.513.900	28.331	530	0	530	0,02
	02.2021	\$	30	RUB 2.236	0	0	0	0,00
	03.2021		39.264	CNH 258.614	289	0	289	0,01
JPM	03.2021		264	IDR 3.775.447	5	0	5	0,00
	01.2021	€	1.580	\$ 1.908	0	(21)	(21)	0,00
	02.2021	£	1.599	€ 1.766	0	(19)	(19)	0,00
MYI	02.2021	¥	3.270.000	26.397	520	0	520	0,02
	01.2021	€	5.324	\$ 6.384	0	(106)	(106)	0,00
	02.2021		15.921	AUD 25.847	370	0	370	0,01
	02.2021		1.030	£ 928	5	0	5	0,00
RYL	02.2021		15.992	NOK 170.825	296	0	296	0,01
	02.2021	£	1.274	€ 1.396	0	(26)	(26)	0,00
	02.2021	CHF	7.287	6.754	14	0	14	0,00
	02.2021	€	2.531	£ 2.290	33	(7)	26	0,00
SCX	03.2021	MXN	117.388	\$ 5.819	0	(16)	(16)	0,00
	06.2021	\$	5.770	MXN 117.388	12	0	12	0,00
	01.2021		337.166	€ 281.533	5.969	0	5.969	0,18
	02.2021	€	1.876	£ 1.718	42	0	42	0,00
SSB	02.2021	£	218.771	€ 243.129	0	(1.100)	(1.100)	(0,03)
	02.2021	\$	344.705	281.533	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	€	1.113	£ 1.010	14	0	14	0,00
UAG	02.2021	\$	32	RUB 2.408	0	0	0	0,00
				€ 10.199	€ (1.505)	€ 8.694	0,27	

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	€ 65.674	CHF 71.202	€ 161	€ 0	€ 161	0,00
BRC	01.2021	25.731	27.864	33	0	33	0,00
MYI	01.2021	88.632	95.748	0	(103)	(103)	0,00
SCX	01.2021	102.955	111.318	37	(66)	(29)	0,00
				€ 231	€ (169)	€ 62	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ 8.525	0,26
Summe Anlagen						€ 3.713.885	114,50
Sonstige Aktiva und Passiva						€ (470.430)	(14,50)
Nettovermögen						€ 3.243.455	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.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro 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) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 820 und Barmittel in Höhe von EUR 277 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 32.753 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	1.291	14.271	(11)	15.551
<b>Summen</b>	<b>€ 44.316</b>	<b>€ 3.651.196</b>	<b>€ 18.373</b>	<b>€ 3.713.885</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	€ 3.003.468	€ 0	€ 3.003.468
Investmentfonds	230.462	0	0	230.462
Pensionsgeschäfte	0	18.200	0	18.200
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(16.139)	16.563	0	424
<b>Summen</b>	<b>€ 214.323</b>	<b>€ 3.038.231</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 3.252.554</b>

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ 117	€ 0	€ 117
BPS	(52)	152	100
BRC	1.868	(2.290)	(422)
CBK	80	0	80
DUB	(189)	(170)	(359)
FBF	(8)	0	(8)
GLM	(338)	440	102
GST	(345)	438	93
HUS	866	(970)	(104)
JLN	(2)	0	(2)
JPM	235	(380)	(145)
MYC	926	(1.900)	(974)
MYI	436	67	503
RYL	36	0	36
SCX	4.881	(8.230)	(3.349)
SSB	14	0	14

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	75,39	80,81
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	23,55	18,86
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,76	k. A.
Investmentfonds	9,77	7,65
Pensionsgeschäfte	4,55	0,60
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	(0,53)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,18	0,03
Freiverkehrsfinanzderivate	0,26	0,52

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

<b>Anlagen zum Marktwert</b>	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,01	0,01
Unternehmensanleihen und Wechsel	32,91	28,06
US-Regierungsbehörden	15,12	9,56
US-Schatzobligationen	1,43	5,14
Non-Agency-MBS	8,77	5,92
Forderungsbesicherte Wertpapiere	12,56	13,10
Staatsemissionen	24,20	23,58
Vorzugswertpapiere	0,06	k. A.
Kurzfristige Instrumente	4,64	14,30
Investmentfonds	9,77	7,65
Pensionsgeschäfte	4,55	0,60
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,04	(0,53)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	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	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,02)
Zinsswaps	0,18	0,05
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	0,23	0,08
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	(0,03)
Zinsswapoptionen	(0,21)	(0,14)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	0,27	0,52
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,00	0,10
Sonstige Aktiva und Passiva	(14,50)	(7,94)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro 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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
Allice France S.A.				1,750 % fällig am 12.03.2029	€ 100	€ 106	0,01	0,875 % fällig am 20.10.2022	€ 1.400	€ 1.416	0,12
3,000 % fällig am 31.01.2026	€ 4.876	€ 4.802	0,42	2,200 % fällig am 24.07.2025	400	429	0,04	General Motors Financial Co., Inc.			
4,237 % fällig am 14.08.2026	\$ 491	401	0,03	BMW International Investment BV				0,009 % fällig am 26.03.2022	500	499	0,04
Charter Communications Operating LLC				0,750 % fällig am 08.03.2024	£ 500	566	0,05	1,779 % fällig am 14.01.2022	\$ 100	82	0,01
1,900 % fällig am 01.02.2027	3.368	2.742	0,24	BNP Paribas Cardiff S.A.				2,200 % fällig am 01.04.2024	€ 600	636	0,06
Dell International LLC				1,000 % fällig am 29.11.2024	€ 1.000	1.027	0,09	Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
2,750 % fällig am 19.09.2025	1.105	905	0,08	BNP Paribas S.A.				2,875 % fällig am 20.06.2022	3.300	3.404	0,30
Hilton Worldwide Finance LLC				0,500 % fällig am 04.06.2026	5.400	5.504	0,48	3,000 % fällig am 29.03.2025	2.000	2.114	0,18
1,898 % fällig am 22.06.2026	3.240	2.623	0,23	1,125 % fällig am 22.11.2023	1.600	1.658	0,14	Goldman Sachs Group, Inc.			
INEOS Finance PLC				4,400 % fällig am 14.08.2028	\$ 1.000	970	0,08	0,078 % fällig am 26.09.2023	2.000	2.008	0,17
2,500 % fällig am 01.04.2024	€ 4.774	4.718	0,41	4,705 % fällig am 10.01.2025	16.300	14.819	1,29	1,375 % fällig am 15.05.2024	18.700	19.312	1,68
		16.191	1,41	BPCE S.A.				2,000 % fällig am 27.07.2023	5.600	5.909	0,51
				0,500 % fällig am 15.09.2027	€ 8.400	8.537	0,74	2,125 % fällig am 30.09.2024	3.200	3.447	0,30
				3,000 % fällig am 22.05.2022	\$ 10.750	9.095	0,79	Groupe Bruxelles Lambert S.A.			
				CA Immobilien Anlagen AG				1,875 % fällig am 19.06.2025	2.400	2.593	0,23
				0,875 % fällig am 05.02.2027	€ 900	906	0,08	Guardian Life Global Funding			
				1,000 % fällig am 27.10.2025	700	713	0,06	1,100 % fällig am 23.06.2025	\$ 100	83	0,01
				CaixaBank S.A.				Hamburg Commercial Bank AG			
				0,750 % fällig am 10.07.2026	4.600	4.729	0,41	0,750 % fällig am 23.11.2023	€ 3.400	3.427	0,30
				Chubb INA Holdings, Inc.				HSBC Holdings PLC			
				0,875 % fällig am 15.06.2027	1.300	1.369	0,12	0,309 % fällig am 13.11.2026	100	101	0,01
				Citigroup, Inc.				1,589 % fällig am 24.05.2027	\$ 6.500	5.405	0,47
				0,000 % fällig am 21.03.2023	9.600	9.660	0,84	3,803 % fällig am 11.03.2025	1.700	1.518	0,13
				Cooperative Rabobank UA				3,950 % fällig am 18.05.2024	6.200	5.468	0,48
				3,875 % fällig am 08.02.2022	\$ 750	637	0,06	6,500 % fällig am 20.05.2024	€ 2.600	3.465	0,30
				6,625 % fällig am 29.06.2021 (d)(f)	€ 400	412	0,04	Huarong Finance Co. Ltd.			
				CPI Property Group S.A.				2,125 % fällig am 30.09.2023	\$ 4.000	3.296	0,29
				1,625 % fällig am 23.04.2027	700	720	0,06	3,250 % fällig am 03.06.2021	400	329	0,03
				2,750 % fällig am 12.05.2026	800	870	0,08	IMMOFINANZ AG			
				4,750 % fällig am 08.03.2023	\$ 4.300	3.770	0,33	2,625 % fällig am 27.01.2023	€ 2.000	2.068	0,18
				Credit Agricole S.A.				ING Bank NV			
				1,907 % fällig am 16.06.2026	3.200	2.716	0,24	0,000 % fällig am 08.04.2022	5.500	5.535	0,48
				Credit Suisse Group AG				Intesa Sanpaolo SpA			
				1,250 % fällig am 17.07.2025	€ 10.200	10.623	0,92	3,125 % fällig am 14.07.2022	\$ 7.100	6.011	0,52
				2,997 % fällig am 14.12.2023	\$ 9.400	8.038	0,70	3,375 % fällig am 12.01.2023	3.100	2.655	0,23
				Cromwell Ereit Lux Finco SARL				4,000 % fällig am 23.09.2029	1.400	1.292	0,11
				2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 4.700	4.802	0,42	JAB Holdings BV			
				CyrusOne LP				1,625 % fällig am 30.04.2025	€ 4.200	4.467	0,39
				1,450 % fällig am 22.01.2027	200	203	0,02	1,750 % fällig am 25.06.2026	1.100	1.183	0,10
				Deutsche Bank AG				JPMorgan Chase & Co.			
				1,000 % fällig am 19.11.2025	100	102	0,01	2,750 % fällig am 24.08.2022	1.700	1.785	0,15
				1,375 % fällig am 03.09.2026	2.100	2.169	0,19	4,203 % fällig am 23.07.2029	\$ 6.200	6.064	0,53
				1,625 % fällig am 20.01.2027	2.800	2.928	0,25	Jyske Realkredit A/S			
				1,750 % fällig am 17.01.2028	600	633	0,05	1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 54.735	7.449	0,65
				2,129 % fällig am 24.11.2026 (g)	\$ 400	335	0,03	1,000 % fällig am 01.10.2053	35.700	4.830	0,42
				2,222 % fällig am 18.09.2024	€ 2.700	2.272	0,20	1,500 % fällig am 01.10.2037	453	64	0,01
				2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 2.100	2.475	0,21	Kojamo Oyj			
				2,625 % fällig am 12.02.2026	€ 2.000	2.196	0,19	1,500 % fällig am 19.06.2024	€ 500	522	0,05
				3,375 % fällig am 12.05.2021	\$ 4.200	3.464	0,30	La Mondiale SAM			
				3,547 % fällig am 18.09.2031	1.300	1.154	0,10	2,125 % fällig am 23.06.2031	700	744	0,06
				3,700 % fällig am 30.05.2024	400	352	0,03	LeasePlan Corp. NV			
				4,250 % fällig am 14.10.2021	6.100	5.113	0,44	0,750 % fällig am 03.10.2022	3.500	3.548	0,31
				5,000 % fällig am 14.02.2022	1.700	1.453	0,13	1,000 % fällig am 24.05.2021	500	502	0,04
				Digital Euro Finco LLC				1,000 % fällig am 02.05.2023	7.400	7.578	0,66
				1,125 % fällig am 09.04.2028	€ 2.900	3.059	0,27	Liberty Mutual Finance Europe DAC			
				2,625 % fällig am 15.04.2024	2.600	2.818	0,24	1,750 % fällig am 27.03.2024	400	422	0,04
				Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust				Liberty Mutual Group, Inc.			
				5,125 % fällig am 30.11.2024	\$ 220	170	0,01	2,750 % fällig am 04.05.2026	700	796	0,07
				Euroclear Bank S.A.				Lloyds Banking Group PLC			
				0,125 % fällig am 07.07.2025	€ 2.200	2.231	0,19	2,250 % fällig am 16.10.2024	£ 5.100	5.984	0,52
				0,500 % fällig am 10.07.2023	600	613	0,05	3,500 % fällig am 01.04.2026	€ 100	114	0,01
				Fairfax Financial Holdings Ltd.				4,050 % fällig am 16.08.2023	\$ 4.600	4.111	0,36
				2,750 % fällig am 29.03.2028	1.600	1.784	0,15	Logicor Financing SARL			
				FCE Bank PLC				2,250 % fällig am 13.05.2025	€ 8.100	8.773	0,76
				0,869 % fällig am 13.09.2021	2.100	2.099	0,18	3,250 % fällig am 13.11.2028	2.500	2.947	0,26
				1,875 % fällig am 24.06.2021	1.400	1.404	0,12	Marsh & McLennan Cos., Inc.			
				FFP				1,349 % fällig am 21.09.2026	800	856	0,07
				1,875 % fällig am 30.10.2026	1.200	1.149	0,10	Merlin Properties Socimi S.A.			
				Ford Motor Credit Co. LLC				1,750 % fällig am 26.05.2025	2.800	2.942	0,26
				0,000 % fällig am 14.05.2021	1.600	1.594	0,14	1,875 % fällig am 04.12.2034	400	408	0,04
				0,000 % fällig am 01.12.2021	300	297	0,03	2,375 % fällig am 13.07.2027	3.500	3.775	0,33
				0,000 % fällig am 07.12.2022	1.100	1.064	0,09	Metropolitan Life Global Funding			
				1,048 % fällig am 05.04.2021	\$ 200	163	0,01	0,375 % fällig am 09.04.2024	6.600	6.722	0,58
				3,021 % fällig am 06.03.2024	€ 300	312	0,03	1,250 % fällig am 17.09.2021	5.700	5.769	0,50
				3,550 % fällig am 07.10.2022	\$ 3.000	2.506	0,22	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
				5,596 % fällig am 07.01.2022	500	423	0,04	0,022 % fällig am 30.05.2023	784	789	0,07
				GE Capital Funding LLC							
				3,450 % fällig am 15.05.2025	3.000	2.707	0,24				
				GELF Bond Issuer S.A.							



# Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro 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
Mitchells & Butlers Finance PLC				British Telecommunications PLC	€ 1.100	€ 1.121	0,10	Newgate Funding PLC			
0,667 % fällig am 15.12.2030	\$ 538	€ 400	0,03	0,500 % fällig am 12.09.2025	2.300	2.382	0,21	0,057 % fällig am 15.12.2050	€ 245	€ 240	0,02
5,965 % fällig am 15.12.2025	€ 26	30	0,00	1,000 % fällig am 21.11.2024				RMAC Securities PLC			
6,013 % fällig am 15.12.2030	120	143	0,01	CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.				0,191 % fällig am 12.06.2044	€ 118	127	0,01
Molnlycke Holding AB				0,750 % fällig am 17.04.2026	2.200	2.269	0,20	Southern Pacific Financing PLC			
1,875 % fällig am 28.02.2025	€ 2.100	2.254	0,20	1,125 % fällig am 17.10.2028	1.600	1.685	0,14	0,191 % fällig am 10.03.2044	56	62	0,01
Mondi Finance PLC				1,500 % fällig am 17.10.2031	5.900	6.354	0,55	0,211 % fällig am 10.06.2043	23	26	0,00
1,500 % fällig am 15.04.2024	1.700	1.781	0,15	CNOOC Finance Ltd.				Structured Asset Mortgage Investments Trust			
Motability Operations Group PLC				3,000 % fällig am 09.05.2023	\$ 900	766	0,07	0,852 % fällig am 19.12.2034	\$ 110	88	0,01
0,375 % fällig am 03.01.2026	3.100	3.166	0,28	CNPC Global Capital Ltd.				Towd Point Mortgage Funding PLC			
0,875 % fällig am 14.03.2025	800	836	0,07	1,125 % fällig am 23.06.2023	2.400	1.965	0,17	1,073 % fällig am 20.10.2051	€ 2.472	2.773	0,24
National Grid Electricity Transmission PLC				Enel Finance International NV							
0,823 % fällig am 07.07.2032	2.300	2.412	0,21	2,875 % fällig am 25.05.2022	800	675	0,06				
Nissan Motor Co. Ltd.				4,625 % fällig am 14.09.2025	400	381	0,03				
1,940 % fällig am 15.09.2023	1.300	1.356	0,12	Engle S.A.							
2,652 % fällig am 17.03.2026	3.100	3.282	0,29	2,875 % fällig am 10.10.2022	1.700	1.446	0,12				
3,043 % fällig am 15.09.2023	\$ 2.200	1.881	0,16	Eutelsat S.A.							
PerkinElmer, Inc.				1,500 % fällig am 13.10.2028	€ 900	915	0,08				
0,600 % fällig am 09.04.2021	€ 2.500	2.505	0,22	Galp Energia SGPS S.A.							
Petroleos Mexicanos				2,000 % fällig am 15.01.2026	2.000	2.067	0,18				
4,750 % fällig am 26.02.2029	1.800	1.820	0,16	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC							
4,875 % fällig am 21.02.2028	1.700	1.740	0,15	3,000 % fällig am 29.06.2027	\$ 400	335	0,03				
Philip Morris International, Inc.				Global Switch Holdings Ltd.							
0,125 % fällig am 03.08.2026	2.600	2.603	0,23	1,500 % fällig am 31.01.2024	€ 900	937	0,08				
2,750 % fällig am 19.03.2025	3.100	3.462	0,30	Madrikena Red de Gas Finance BV							
Poste Italiane SpA				1,375 % fällig am 11.04.2025	300	310	0,03				
0,500 % fällig am 10.12.2028	3.000	3.018	0,26	NGPL PipeCo LLC							
ProSiebenSat.1 Media SE				4,375 % fällig am 15.08.2022	\$ 300	256	0,02				
2,625 % fällig am 15.04.2021	5.700	5.705	0,50	Pacific Gas & Electric Co.							
RCS & RDS S.A.				1,750 % fällig am 16.06.2022	4.400	3.607	0,31				
2,500 % fällig am 05.02.2025	500	497	0,04	2,100 % fällig am 01.08.2027	100	83	0,01				
RELX Finance BV				2,500 % fällig am 01.02.2031	200	164	0,01				
0,000 % fällig am 18.03.2024 (b)	100	100	0,01	3,150 % fällig am 01.01.2026	100	87	0,01				
0,375 % fällig am 22.03.2021	1.600	1.601	0,14	3,300 % fällig am 15.03.2027 ^	100	88	0,01				
0,500 % fällig am 10.03.2028	100	102	0,01	3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	300	261	0,02				
Rockies Express Pipeline LLC				3,450 % fällig am 01.07.2025	100	89	0,01				
3,600 % fällig am 15.05.2025	\$ 100	84	0,01	3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	100	88	0,01				
Sabine Pass Liquefaction LLC				3,750 % fällig am 15.02.2024 ^	100	87	0,01				
5,625 % fällig am 01.03.2025	2.100	2.003	0,17	3,750 % fällig am 01.07.2028	100	89	0,01				
5,875 % fällig am 30.06.2026	100	99	0,01	3,850 % fällig am 15.11.2023 ^	100	87	0,01				
Safran S.A.				4,250 % fällig am 01.08.2023	100	88	0,01				
0,029 % fällig am 28.06.2021	€ 1.500	1.501	0,13	4,650 % fällig am 01.08.2028	200	187	0,01				
Saudi Arabian Oil Co.				Petrobras Global Finance BV							
1,250 % fällig am 24.11.2023	\$ 500	414	0,04	6,250 % fällig am 14.12.2026	€ 200	266	0,02				
SEB S.A.				Redexis Gas Finance BV							
1,500 % fällig am 31.05.2024	€ 3.800	3.919	0,34	1,875 % fällig am 28.05.2025	€ 100	107	0,01				
Smurfit Kappa Treasury ULC				SPP-Distribucija A/S							
1,500 % fällig am 15.09.2027	3.800	3.984	0,35	2,625 % fällig am 23.06.2021	4.500	4.561	0,40				
Swedish Match AB				State Grid Overseas Investment Ltd.							
0,875 % fällig am 26.02.2027	900	906	0,08	0,797 % fällig am 05.08.2026	1.900	1.942	0,17				
1,200 % fällig am 10.11.2025	2.200	2.261	0,20								
Syngenta Finance NV											
3,375 % fällig am 16.04.2026	3.600	3.888	0,34								
4,441 % fällig am 24.04.2023	\$ 500	429	0,04								
4,892 % fällig am 24.04.2025	4.700	4.125	0,36								
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.											
2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 1.200	1.351	0,12								
TDF Infrastructure SASU											
2,875 % fällig am 19.10.2022	7.800	8.114	0,71								
Teva Pharmaceutical Finance Co. BV											
3,650 % fällig am 10.11.2021	€ 6.800	5.640	0,49								
Ubisoft Entertainment S.A.											
0,878 % fällig am 24.11.2027	€ 1.700	1.708	0,15								
1,289 % fällig am 30.01.2023	3.900	3.987	0,35								
UCB S.A.											
1,875 % fällig am 02.04.2022	3.200	3.266	0,28								
4,125 % fällig am 04.01.2021	5.873	5.873	0,51								
VMware, Inc.											
2,950 % fällig am 21.08.2022	\$ 200	170	0,01								
4,500 % fällig am 15.05.2025	1.100	1.030	0,09								
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.											
3,200 % fällig am 15.06.2025	200	177	0,02								
Zimmer Biomet Holdings, Inc.											
1,164 % fällig am 15.11.2027	€ 600	630	0,05								
2,425 % fällig am 13.12.2026	200	224	0,02								
		261.995	22,78								

## VERSORGUNGSUNTERNEHMEN

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
Toro European CLO DAC 0,900 % fällig am 15.10.2030	€ 3.600	€ 3.599	0,31	Qatar Government International Bond 3,375 % fällig am 14.03.2024	\$ 1.700	€ 1.507	0,13	ARGENTINA TREASURY BILLS (3,480) % fällig am 13.09.2021 (b)(c) ARS	76	€ 1	0,00
		67.871	5,90	3,875 % fällig am 23.04.2023	2.600	2.286	0,20	Summe kurzfristige Instrumente		4.826	0,42
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Romania Government International Bond 4,625 % fällig am 03.04.2049	€ 1.500	2.028	0,18	Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 1.080.854	93,98	
Indonesia Government International Bond 0,900 % fällig am 14.02.2027	300	306	0,03	Saudi Government International Bond 2,875 % fällig am 04.03.2023	\$ 200	171	0,01	<b>AKTIEN</b>			
1,450 % fällig am 18.09.2026	100	105	0,01	4,000 % fällig am 17.04.2025	3.700	3.382	0,29	<b>BORSENGEHADELTE FONDS</b>			
Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	\$ 200	195	0,02	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	197.500	19.350	1,68
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,300 % fällig am 23.06.2025	1.000	855	0,07	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				Summe Investmentfonds	€ 19.350	1,68	
2,800 % fällig am 23.06.2030	600	521	0,05	Pacific Gas & Electric Co. 1,600 % fällig am 15.11.2021	5.900	4.825	0,42				
3,800 % fällig am 23.06.2050	400	362	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 <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 1.117	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	€ (931)	€ 913	€ 913	0,08
RYL	(2,500)	31.12.2020	04.01.2021	€ 15.500	Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2027	(15.490)	15.500	15.496	1,35
Summe Pensionsgeschäfte						€ (16.421)	€ 16.413	€ 16.409	1,43

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.**AN EINEM GEREGLTEN 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
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2021	992	€ (16)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	1.037	(63)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	234	85	0,01
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2021	136	(4)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2021	37	(7)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	1	(1)	0,00
				€ (6)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (6)	0,00

**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<sup>(1)</sup>**

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Group Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 5.600	€ 33	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	\$ 14.400	196	0,02
Auchan Holding S.A.	1,000	20.12.2027	€ 900	24	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	2.300	6	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	4.500	9	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2025	\$ 3.900	9	0,00
Glencore Finance	5,000	20.06.2024	€ 5.000	(181)	(0,01)
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2023	1.800	2	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	(345)	(0,03)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	400	(31)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.12.2024	9.900	(77)	(0,01)
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2024	2.600	26	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2024	4.000	11	0,00
				€ (326)	(0,03)

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	€ 67.600	€ 366	0,03

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Credit Fund (Forts.)

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750 %	16.12.2022	\$ 31.400	€ (6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	17.06.2022	43.600	145	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025	9.400	(6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	8.400	30	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025	12.800	41	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2021	53.000	(237)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2024	57.700	(2.040)	(0,18)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2021	97.600	56	0,01
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	16.06.2051	€ 2.300	(6)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031	41.600	(32)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2023	£ 12.500	(1)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	18.600	(2)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	16.06.2031	1.300	(10)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051	500	(10)	0,00
					€ (2.078)	(0,18)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>€ (2.038)</b>	<b>(0,18)</b>

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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 <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.01.2021	2.500	€ (4)	€ 0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	1.200	(2)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450	20.01.2021	6.300	(5)	(4)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	9.500	(13)	(1)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	1.400	(2)	(2)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	3.600	(9)	(1)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	1.200	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	1.000	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	500	0	0	0,00	
BPS	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	3.100	(3)	(4)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	2.500	(4)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	3.100	(5)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	3.600	(6)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	2.900	(3)	(2)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	8.800	(6)	(4)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	3.100	(2)	(3)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	4.700	(5)	(5)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	8.800	(7)	(8)	(0,01)	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	3.100	(3)	(3)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	3.000	(2)	(1)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	3.000	(4)	(4)	0,00	
	BRC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	4.900	(9)	0	0,00
		Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	3.200	(3)	(2)	0,00
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,700	17.03.2021	3.000	(3)	(3)	0,00	
Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Kauf	0,375	21.04.2021	5.500	(2)	(2)	0,00	
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,750	21.04.2021	5.500	(8)	(8)	0,00	
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	1.400	(2)	(2)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,950	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	1.100	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	500	0	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	3.500	(5)	0	0,00	
FBF	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	3.500	(2)	(2)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	3.500	(4)	(2)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	1.200	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	17.02.2021	1.100	(2)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	2.400	(3)	(2)	0,00	
GST	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	1.200	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	500	(1)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	1.400	(1)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	3.300	(2)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 33 5-Year Index	Verkauf	4,250	16.06.2021	10.200	(11)	0	0,00	

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425 %	17.02.2021	3.700	€ (2)	€ (2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	3.700	(3)	(2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	5.900	(3)	(3)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	3.300	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	5.900	(5)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	3.300	(3)	(2)	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	3.200	(5)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	3.500	(6)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	1.800	(3)	0	0,00
MYC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	2.200	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	2.000	(2)	(1)	0,00
						€ (188)	€ (87)	(0,01)

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

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens	
BPS	Hammerson PLC	1,000 %	20.12.2022	€ 200	€ 2	€ (8)	€ (6)	0,00	
BRC	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	400	3	(16)	(13)	0,00	
GST	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	2.300	11	(83)	(72)	(0,01)	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 100	(1)	2	1	0,00	
HUS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(4)	9	5	0,00	
JPM	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(1)	3	2	0,00	
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	(3)	10	7	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	300	(3)	5	2	0,00	
						€ 4	€ (78)	€ (74)	(0,01)

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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 Nettvermögens		
BOA	01.2021	PLN	481	124	0	€ (4)	0,00		
BPS	01.2021	€	3.224	3.921	4	(24)	0,00		
	01.2021	PLN	163	42	0	(1)	0,00		
	01.2021	\$	1.132	925	0	0	0,00		
	02.2021	DKK	56.449	7.585	2	2	0,00		
	02.2021	€	15.946	DKK 118.660	0	(6)	0,00		
CBK	01.2021	MXN	4.694	\$ 220	0	(12)	0,00		
	01.2021	PLN	37	10	0	0	0,00		
	01.2021	RUB	489	6	0	0	0,00		
	02.2021		568	8	0	0	0,00		
GLM	01.2021		608	8	0	0	0,00		
	02.2021	DKK	18.971	€ 2.549	1	1	0,00		
	02.2021	€	625	DKK 4.650	0	0	0,00		
	02.2021	£	1.316	€ 1.470	3	(2)	0,00		
	02.2021	RUB	2.614	\$ 34	0	(1)	0,00		
	03.2021	\$	13.843	CNH 91.044	85	85	0,01		
HUS	01.2021	PLN	404	\$ 106	0	(2)	0,00		
	02.2021	DKK	336.671	€ 45.236	8	8	0,00		
	02.2021	RUB	2.972	\$ 40	0	0	0,00		
JPM	01.2021	\$	8.440	€ 6.953	56	56	0,01		
	02.2021	DKK	70.755	9.507	2	2	0,00		
MYI	01.2021	€	16.975	\$ 20.495	0	(226)	(0,02)		
SCX	01.2021	\$	266.869	€ 222.835	4.725	0	4.725	0,41	
	02.2021	£	47.105	\$ 52.350	0	(237)	(0,02)		
	02.2021	\$	272.836	222.835	0	(1)	0,00		
UAG	02.2021	RUB	7.365	\$ 97	0	(2)	0,00		
						€ 4.886	€ (518)	€ 4.368	0,39

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ 4.207 0,37

Summe Anlagen

€ 1.118.780 97,28

Sonstige Aktiva und Passiva

€ 31.278 2,72

Nettvermögen

€ 1.150.058 100,00

**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	2,129 %	24.11.2026	17.11.2020	€ 337	€ 335	0,03

Barmittel in Höhe von EUR 21.635 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von EUR 260 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(6)	2.169	0	2.163
<b>Summen</b>	<b>€ (6)</b>	<b>€ 1.112.695</b>	<b>€ 6.091</b>	<b>€ 1.118.780</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	€ 1.025.580	€ 0	€ 1.025.580
Pensionsgeschäfte	0	2.166	0	2.166
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(3.797)	3.588	0	(209)
<b>Summen</b>	<b>€ (3.797)</b>	<b>€ 1.031.334</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 1.027.537</b>

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

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (11)	€ 0	€ (11)
BPS	(67)	0	(67)
BRC	(30)	0	(30)
CBK	(12)	0	(12)
DUB	(4)	(10)	(14)
FBF	(2)	0	(2)
GLM	86	0	86
GST	(89)	260	171
HUS	11	0	11
JPM	60	0	60
MYC	6	0	6
MYI	(226)	0	(226)
SCX	4.487	(5.390)	(903)
UAG	(2)	0	(2)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,07	88,36
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	5,45	18,31
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,46	k. A.
Investmentfonds	1,68	k. A.
Pensionsgeschäfte	1,43	0,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	(0,40)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,18)	0,05
Freiverkehrsfinanzderivate	0,37	0,32
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,22)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,41	1,78
Unternehmensanleihen und Wechsel	83,29	85,31
US-Regierungsbehörden	k. A.	9,70
Non-Agency-MBS	1,94	1,62
Forderungsbesicherte Wertpapiere	5,90	5,94
Staatsemissionen	1,02	1,65
Kurzfristige Instrumente	0,42	0,67
Investmentfonds	1,68	k. A.
Pensionsgeschäfte	1,43	0,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,00	(0,40)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,03)	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,03	0,04
Zinsswaps	(0,18)	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	0,01
Devisenterminkontrakte	0,39	0,33
Sonstige Aktiva und Passiva	2,72	(6,87)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Income 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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
Allice Financing S.A. 2,897 % fällig am 31.01.2026	\$ 2.248	€ 1.801	0,06	Annington Funding PLC 1,650 % fällig am 12.07.2024	€ 1.100	€ 1.155	0,04	Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % fällig am 15.04.2023	€ 11.600	€ 9.678	0,30
Allice France S.A. 3,000 % fällig am 31.01.2026	€ 6.067	5.975	0,19	Aroundtown S.A. 0,625 % fällig am 09.07.2025	5.300	5.389	0,17	CPI Property Group S.A. 1,625 % fällig am 23.04.2027	8.700	8.952	0,28
3,846 % fällig am 31.01.2026	\$ 9.089	7.382	0,23	1,450 % fällig am 09.07.2028	700	742	0,02	2,750 % fällig am 12.05.2026	100	109	0,00
4,237 % fällig am 14.08.2026	2.947	2.403	0,07	1,500 % fällig am 28.05.2026	12.900	13.663	0,43	4,750 % fällig am 08.03.2023	\$ 6.900	6.050	0,19
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 3,250 % fällig am 01.12.2027	5.800	4.749	0,15	2,000 % fällig am 02.11.2026	9.300	10.144	0,32	Credit Agricole S.A. 1,907 % fällig am 16.06.2026	2.700	2.291	0,07
Casino Guichard Perrachon S.A. 5,500 % fällig am 31.01.2024	€ 21.400	21.351	0,67	3,250 % fällig am 18.07.2027	€ 1.100	1.379	0,04	Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	11.200	10.331	0,32
Charter Communications Operating LLC 1,900 % fällig am 01.02.2027	\$ 4.318	3.516	0,11	5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 3.600	3.515	0,11	Credit Suisse Group AG 1,250 % fällig am 17.07.2025	€ 7.000	7.290	0,23
Connect Finco SARL 0,375 % - 5,500 % fällig am 11.12.2026	3.176	2.610	0,08	Athora Netherlands NV 7,000 % fällig am 19.06.2025 (e)(g)	€ 800	898	0,03	3,750 % fällig am 26.03.2025	\$ 1.550	1.408	0,04
Dell International LLC 2,750 % fällig am 19.09.2025	1.276	1.044	0,03	Atrium European Real Estate Ltd. 3,000 % fällig am 11.09.2025	3.000	3.072	0,10	Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 13.000	13.282	0,42
Grifols S.A. 2,250 % fällig am 15.11.2027	€ 16.236	16.264	0,51	3,625 % fällig am 17.10.2022	7.196	7.394	0,23	CyrusOne LP 1,450 % fällig am 22.01.2027	500	507	0,02
Hilton Worldwide Finance LLC 1,898 % fällig am 22.06.2026	\$ 3.798	3.074	0,10	Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025	\$ 13.700	11.439	0,36	Deutsche Bank AG 1,000 % fällig am 19.11.2025	3.100	3.151	0,10
INEOS Finance PLC 2,500 % fällig am 01.04.2024	€ 19.333	19.109	0,60	4,250 % fällig am 15.04.2026	300	264	0,01	1,463 % fällig am 27.02.2023	\$ 200	163	0,01
Level 3 Financing, Inc. 1,897 % fällig am 01.03.2027	\$ 2.764	2.229	0,07	Banca Carige SpA 0,977 % fällig am 25.05.2022	€ 4.800	4.827	0,15	1,500 % fällig am 20.01.2022	€ 5.700	5.791	0,18
Nielsen Finance LLC 2,146 % fällig am 04.10.2023	4.740	3.867	0,12	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,625 % fällig am 24.09.2024	23.300	24.633	0,77	1,625 % fällig am 20.01.2027	14.200	14.850	0,47
4,750 % fällig am 04.06.2025	299	246	0,01	4,000 % fällig am 10.07.2022	2.400	2.497	0,08	1,750 % fällig am 17.01.2028	4.600	4.852	0,15
Numericable Group S.A. 2,897 % fällig am 31.07.2025	1.670	1.339	0,04	5,375 % fällig am 18.01.2028	4.467	3.892	0,12	1,750 % fällig am 19.11.2030	5.100	5.365	0,17
Perstorp Holding AB 4,750 % fällig am 27.02.2026	€ 4.000	3.793	0,12	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 8,875 % fällig am 14.04.2021 (e)(g)	7.400	7.573	0,24	2,129 % fällig am 24.11.2026 (h)	\$ 5.100	4.268	0,13
Sigma Bidco BV 3,500 % fällig am 02.07.2025	9.000	8.867	0,28	Banco de Sabadell S.A. 1,125 % fällig am 27.03.2025	18.500	18.864	0,59	2,222 % fällig am 18.09.2024	€ 6.500	5.469	0,17
Summer (BC) Holdco B SARL 4,750 % fällig am 04.12.2026	5.000	4.999	0,16	Banco Santander S.A. 2,746 % fällig am 28.05.2025	\$ 200	175	0,01	2,625 % fällig am 12.02.2026	€ 100	110	0,00
TDC A/S 3,000 % fällig am 04.06.2025	5.736	5.713	0,18	6,250 % fällig am 11.09.2021 (e)(g)	€ 1.400	1.436	0,04	3,375 % fällig am 12.05.2021	\$ 4.400	3.629	0,11
Ziggo BV 3,000 % fällig am 31.01.2029	6.300	6.298	0,20	Bank of America Corp. 0,808 % fällig am 09.05.2026	7.100	7.333	0,23	3,547 % fällig am 18.09.2031	1.100	976	0,03
Ziggo Financing Partnership 2,659 % fällig am 30.04.2028	\$ 5.566	4.518	0,14	Bank of Ireland 10,000 % fällig am 19.12.2022	700	830	0,03	3,700 % fällig am 30.05.2024	700	616	0,02
		131.147	4,12	Bank of Ireland Group PLC 1,000 % fällig am 25.11.2025	11.000	11.306	0,35	3,875 % fällig am 12.02.2024	€ 400	484	0,02
				1,375 % fällig am 29.08.2023	4.800	4.971	0,16	4,250 % fällig am 14.10.2021	\$ 5.700	4.778	0,15
				Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022 (g)	\$ 548	498	0,02	5,000 % fällig am 14.02.2022	2.700	2.308	0,07
				Barclays PLC 0,750 % fällig am 09.06.2025	€ 8.900	9.083	0,29	Digital Dutch Finco BV 0,125 % fällig am 15.10.2022	€ 200	201	0,01
				3,375 % fällig am 02.04.2025	1.400	1.546	0,05	Digital Euro Finco LLC 1,125 % fällig am 09.04.2028	9.100	9.600	0,30
				3,650 % fällig am 16.03.2025	\$ 10.700	9.647	0,30	2,500 % fällig am 16.01.2026	4.700	5.241	0,16
				4,610 % fällig am 15.02.2023	2.400	2.048	0,06	2,625 % fällig am 15.04.2024	300	325	0,01
				Bevco Lux SARL 1,500 % fällig am 16.09.2027	€ 1.800	1.899	0,06	Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	21.600	24.080	0,76
				Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 1,250 % fällig am 26.04.2027	3.700	3.795	0,12	Fastighets AB Balder 1,125 % fällig am 14.03.2022	3.400	3.441	0,11
				1,400 % fällig am 06.07.2022	1.600	1.626	0,05	FCE Bank PLC 0,869 % fällig am 13.09.2021	300	300	0,01
				1,750 % fällig am 12.03.2029	1.300	1.373	0,04	1,875 % fällig am 24.06.2021	600	602	0,02
				2,000 % fällig am 15.02.2024	2.200	2.310	0,07	FFP 1,875 % fällig am 30.10.2026	3.200	3.064	0,10
				2,200 % fällig am 24.07.2025	4.300	4.614	0,14	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 14.05.2021	900	897	0,03
				BNP Paribas Cardif S.A. 1,000 % fällig am 29.11.2024	400	411	0,01	0,000 % fällig am 01.12.2021	3.400	3.370	0,11
				BNP Paribas S.A. 0,500 % fällig am 04.06.2026	2.500	2.548	0,08	0,000 % fällig am 07.12.2022	1.100	1.064	0,03
				4,400 % fällig am 14.08.2028	\$ 700	679	0,02	1,048 % fällig am 05.04.2021	\$ 700	570	0,02
				4,705 % fällig am 10.01.2025	32.800	29.820	0,94	1,104 % fällig am 12.10.2021	600	485	0,02
				BPCE S.A. 2,375 % fällig am 14.01.2025	100	86	0,00	1,456 % fällig am 15.02.2023	200	158	0,00
				5,700 % fällig am 22.10.2023	3.900	3.610	0,11	1,514 % fällig am 17.02.2023	€ 3.100	3.102	0,10
				Bureau Veritas S.A. 1,875 % fällig am 06.01.2025	€ 5.900	6.278	0,20	1,744 % fällig am 19.07.2024	7.600	7.585	0,24
				CA Immobilien Anlagen AG 0,875 % fällig am 05.02.2027	3.000	3.020	0,09	2,330 % fällig am 25.11.2025	12.000	12.226	0,38
				1,000 % fällig am 27.10.2025	900	917	0,03	3,021 % fällig am 06.03.2024	2.000	2.077	0,07
				CaixaBank S.A. 0,750 % fällig am 10.07.2026	1.800	1.850	0,06	3,096 % fällig am 04.05.2023	\$ 500	413	0,01
				Castellum AB 2,125 % fällig am 20.11.2023	100	106	0,00	3,336 % fällig am 18.03.2021	200	164	0,01
				Ceetrus S.A. 2,750 % fällig am 26.11.2026	9.100	9.839	0,31	3,360 % fällig am 07.01.2022	300	247	0,01
				Chubb INA Holdings, Inc. 0,875 % fällig am 15.06.2027	2.500	2.632	0,08	3,470 % fällig am 05.04.2021	4.600	3.771	0,12
				Cooperatieve Rabobank UA 6,625 % fällig am 29.06.2021 (e)(g)	3.000	3.088	0,10	3,550 % fällig am 07.10.2022	9.200	7.684	0,24
								5,584 % fällig am 18.03.2024	600	530	0,02
								5,596 % fällig am 07.01.2022	3.000	2.541	0,08
								GE Capital Funding LLC 4,050 % fällig am 15.05.2027	6.600	6.176	0,19
								GE Capital UK Funding Unlimited Co. 4,125 % fällig am 13.09.2023	€ 960	1.173	0,04
								General Motors Financial Co., Inc. 0,009 % fällig am 26.03.2022	€ 4.500	4.495	0,14
								2,200 % fällig am 01.04.2024	200	212	0,01
								Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,875 % fällig am 20.06.2022	9.600	9.903	0,31
								3,000 % fällig am 29.03.2025	5.200	5.497	0,17
								Goldman Sachs Group, Inc. 0,041 % fällig am 21.04.2023	6.200	6.217	0,20



# Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Income 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
Babcock International Group PLC 1,375 % fällig am 13.09.2027	€12.400	€ 12.844	0,40	0,625 % fällig am 11.09.2024	€ 4.500	€ 4.557	0,14	Philip Morris International, Inc. 2,750 % fällig am 19.03.2025	€ 7.350	€ 8.207	0,26
Bacardi Ltd. 2,750 % fällig am 03.07.2023	1.900	2.000	0,06	Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1,625 % fällig am 18.09.2029	2.900	3.088	0,10	ProSiebenSat.1 Media SE 2,625 % fällig am 15.04.2021	14.654	14.669	0,46
BAT Capital Corp. 0,000 % fällig am 16.08.2021 1,125 % fällig am 16.11.2023	400 800	401 823	0,01 0,03	Hyatt Hotels Corp. 3,225 % fällig am 01.09.2022	\$ 2.500	2.067	0,07	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. 5,838 % fällig am 30.09.2027	\$ 250	239	0,01
BAT International Finance PLC 0,875 % fällig am 13.10.2023	10.300	10.531	0,33	IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK) 3,625 % fällig am 15.05.2025 (c)	€11.200	11.451	0,36	RCS & RDS S.A. 2,500 % fällig am 05.02.2025	€ 1.500	1.492	0,05
BEL S.A. 1,500 % fällig am 18.04.2024	9.900	10.256	0,32	IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)	6.100	6.287	0,20	RELX Finance BV 0,000 % fällig am 18.03.2024 (d)	600	602	0,02
BMW Finance NV 0,000 % fällig am 24.03.2023 (d)	12.800	12.850	0,40	IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK) 3,875 % fällig am 15.05.2027 (c)	6.300	6.561	0,21	Renault S.A. 1,250 % fällig am 24.06.2025	10.200	10.002	0,31
Bureau Veritas S.A. 1,125 % fällig am 18.01.2027 1,250 % fällig am 07.09.2023	2.200 1.600	2.258 1.648	0,07 0,05	IMCD NV 2,500 % fällig am 26.03.2025	8.530	8.872	0,28	2,375 % fällig am 25.05.2026	1.100	1.115	0,04
Centene Corp. 4,250 % fällig am 15.12.2027 4,625 % fällig am 15.12.2029 4,750 % fällig am 15.01.2025	\$ 900 1.000 700	781 908 588	0,02 0,03 0,02	Imperial Brands Finance PLC 1,125 % fällig am 14.08.2023 2,125 % fällig am 12.02.2027 3,125 % fällig am 26.07.2024	3.900 3.000 \$ 1.140	4.003 3.252 999	0,13 0,10 0,03	Roadster Finance DAC 1,625 % fällig am 09.12.2029 2,375 % fällig am 08.12.2032	200 400	203 412	0,01 0,01
Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026 1,000 % fällig am 31.07.2031	€ 1.900 1.700	1.929 1.755	0,06 0,06	Ingenico Group S.A. 1,625 % fällig am 13.09.2024	20.300	21.232	0,67	Rockies Express Pipeline LLC 3,600 % fällig am 15.05.2025 4,800 % fällig am 15.05.2030	\$ 200 2.800	169 2.351	0,01 0,07
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5,125 % fällig am 30.06.2027	\$ 8.600	8.326	0,26	InterContinental Hotels Group PLC 1,625 % fällig am 08.10.2024	4.300	4.414	0,14	Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 800	868	0,03
Cie Plastic Omnium S.A. 1,250 % fällig am 26.06.2024	€11.000	11.164	0,35	ITV PLC 1,375 % fällig am 26.09.2026	3.000	3.092	0,10	5,625 % fällig am 01.03.2025 5,750 % fällig am 15.05.2024	\$ 1.200 1.000	1.144 935	0,04 0,03
Cirsa Finance International SARL 7,875 % fällig am 20.12.2023	\$ 3.152	2.602	0,08	Jaguar Land Rover Automotive PLC 3,875 % fällig am 01.03.2023	€12.600	13.768	0,43	5,125 % fällig am 08.08.2025	1.700	1.562	0,05
Connect Finco SARL 6,750 % fällig am 01.10.2026	1.600	1.411	0,04	5,000 % fällig am 15.02.2022 5,875 % fällig am 15.11.2024	400 € 300	452 307	0,01 0,01	Saudi Arabian Oil Co. 1,250 % fällig am 24.11.2023	1.700	1.408	0,04
Conti-Gummi Finance BV 1,125 % fällig am 25.09.2024 2,125 % fällig am 27.11.2023	€11.600 1.700	12.018 1.799	0,38 0,06	James Hardie International Finance DAC 3,625 % fällig am 01.10.2026	1.000	1.034	0,03	SEB S.A. 1,375 % fällig am 16.06.2025 1,500 % fällig am 31.05.2024	€ 4.200 6.400	4.334 6.600	0,14 0,21
Continental Airlines Pass-Through Trust 4,750 % fällig am 12.07.2022	\$ 117	96	0,00	John Lewis PLC 6,125 % fällig am 21.01.2025	€ 2.870	3.628	0,11	SIG Combibloc Purchase Co. SARL 1,875 % fällig am 18.06.2023	7.900	8.180	0,26
Coty, Inc. 4,000 % fällig am 15.04.2023	€ 6.200	5.986	0,19	Kemira Oyj 1,750 % fällig am 30.05.2024 2,250 % fällig am 13.05.2022	€ 300 3.200	309 3.277	0,10 0,10	Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	2.500	2.548	0,08
Dell Bank International DAC 0,625 % fällig am 17.10.2022 1,625 % fällig am 24.06.2024	2.500 5.300	2.525 5.500	0,08 0,17	Kinder Morgan Energy Partners LP 4,300 % fällig am 01.05.2024	\$ 100	91	0,00	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875 % fällig am 15.01.2026	10.700	11.858	0,37
Dell International LLC 5,850 % fällig am 15.07.2025 6,020 % fällig am 15.06.2026	\$ 7.300 2.300	7.170 2.295	0,23 0,07	Kinder Morgan, Inc. 1,500 % fällig am 16.03.2022 1,517 % fällig am 15.01.2023	€ 7.200 \$ 1.000	7.337 826	0,23 0,03	Smurfit Kappa Treasury ULC 1,500 % fällig am 15.09.2027	3.400	3.565	0,11
Delta Air Lines, Inc. 4,500 % fällig am 20.10.2025	1.100	961	0,03	Kraft Heinz Foods Co. 1,500 % fällig am 24.05.2024 2,000 % fällig am 30.06.2023	€ 1.400 6.300	1.440 6.534	0,05 0,21	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	9.500	9.628	0,30
DS Smith PLC 0,875 % fällig am 12.09.2026	€ 5.900	6.028	0,19	Las Vegas Sands Corp. 2,900 % fällig am 25.06.2025	\$ 1.600	1.370	0,04	Stryker Corp. 1,125 % fällig am 30.11.2023 2,625 % fällig am 30.11.2030	2.200 6.500	2.281 7.863	0,07 0,25
Eiffage S.A. 1,625 % fällig am 14.01.2027	5.200	5.489	0,17	Loxam S.A.S. 3,250 % fällig am 14.01.2025	€19.800	19.901	0,63	Swedish Match AB 1,200 % fällig am 10.11.2025	5.300	5.447	0,17
Energy Transfer Operating LP 2,900 % fällig am 15.05.2025 4,500 % fällig am 15.04.2024 5,000 % fällig am 15.05.2050	\$ 400 100 1.100	346 89 976	0,01 0,00 0,03	Marks & Spencer PLC 4,250 % fällig am 08.12.2023 4,500 % fällig am 10.07.2027 6,000 % fällig am 12.06.2025	€ 400 4.100 3.093	469 4.773 3.862	0,01 0,15 0,12	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026 3,933 % fällig am 23.04.2021	11.100 \$ 200	11.988 165	0,38 0,01
Energy Transfer Partners LP 5,000 % fällig am 01.10.2022	1.800	1.562	0,05	Metsa Board Oyj 2,750 % fällig am 29.09.2027	€ 1.300	1.473	0,05	4,441 % fällig am 24.04.2023 4,892 % fällig am 24.04.2025	1.000 8.225	858 7.219	0,03 0,23
Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,125 % fällig am 17.04.2021 3,500 % fällig am 09.10.2025	€14.416 15.900	14.544 16.855	0,46 0,53	Mitchells & Butlers Finance PLC 0,493 % fällig am 15.12.2030 0,667 % fällig am 15.12.2030	€ 591 \$ 1.021	602 760	0,02 0,02	TDF Infrastructure SASU 2,500 % fällig am 07.04.2026 2,875 % fällig am 19.10.2022	€ 8.500 8.400	9.333 8.738	0,29 0,27
Eurofins Scientific SE 2,125 % fällig am 25.07.2024 3,375 % fällig am 30.01.2023	9.300 6.000	9.908 6.373	0,31 0,20	Mohawk Capital Finance S.A. 1,750 % fällig am 12.06.2027	€ 3.300	3.409	0,11	Tesco Corporate Treasury Services PLC 1,375 % fällig am 24.10.2023	2.800	2.904	0,09
Flex Ltd. 3,750 % fällig am 01.02.2026	\$ 700	641	0,02	Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023 2,652 % fällig am 17.03.2026 3,522 % fällig am 17.09.2025	2.400 9.900 \$ 3.400	2.503 10.481 2.978	0,08 0,33 0,09	Tesco PLC 6,125 % fällig am 24.02.2022	€ 256	304	0,01
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024 2,125 % fällig am 09.07.2027	€ 8.900 10.600	9.181 11.350	0,29 0,36	PerkinElmer, Inc. 0,600 % fällig am 09.04.2021	€ 5.000	5.009	0,16	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 3,650 % fällig am 10.11.2021	\$ 3.000	2.489	0,08
G4S International Finance PLC 1,500 % fällig am 09.01.2023 1,875 % fällig am 24.05.2025	6.100 11.095	6.129 11.149	0,19 0,35	Petroleos Mexicanos 2,750 % fällig am 21.04.2027 4,875 % fällig am 21.02.2028	300 12.500	283 12.797	0,01 0,40	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,125 % fällig am 15.10.2024 1,250 % fällig am 31.03.2023 3,250 % fällig am 15.04.2022	€ 6.700 4.500 3.200	6.240 4.360 3.254	0,20 0,14 0,10
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,949 % fällig am 24.01.2024	700	738	0,02	thysssenkrupp AG 1,875 % fällig am 06.03.2023	600	602	0,02	Travis Perkins PLC 4,500 % fällig am 07.09.2023	€ 5.600	6.690	0,21
General Electric Co. 0,875 % fällig am 17.05.2025	1.600	1.650	0,05	Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027 1,289 % fällig am 30.01.2023	\$ 700 1.700	572 1.469	0,02 0,05	General Motors Co. 5,400 % fällig am 02.10.2023 (h)	€ 900 6.900	904 7.054	0,03 0,22
Glencore Finance Europe Ltd.											





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	
Nomura Home Equity Loan Trust				Structured Asset Investment Loan Trust	81	€ 64	0,00	3,375 % fällig am 28.01.2050	€ 3.600	4.153	0,13	
6,032 % fällig am 25.10.2036 ^	\$ 168	€ 55	0,00	0,298 % fällig am 25.09.2036				Russia Government International Bond				
NovaStar Mortgage Funding Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust	1.879	1.563	0,05	2,875 % fällig am 04.12.2025	14.200	15.701	0,49	
0,298 % fällig am 25.09.2036	179	87	0,00	1,898 % fällig am 25.04.2031				Saudi Government International Bond				
0,448 % fällig am 25.06.2036	108	74	0,00	Tikehau CLO BV				4,000 % fällig am 17.04.2025	\$ 7.800	7.131	0,22	
0,468 % fällig am 25.05.2036	623	502	0,02	0,600 % fällig am 04.08.2028	€ 509	509	0,02	Senegal Government International Bond				
OAK Hill European Credit Partners Designated Activity Co.				0,880 % fällig am 07.12.2029	5.300	5.298	0,17	4,750 % fällig am 13.03.2028	€ 5.600	5.991	0,19	
0,720 % fällig am 21.02.2030	€ 8.300	8.282	0,26	Toro European CLO DAC				Turkey Government International Bond				
0,730 % fällig am 20.01.2032	300	300	0,01	0,650 % fällig am 15.04.2030	5.800	5.791	0,18	4,250 % fällig am 13.03.2025	\$ 7.600	6.244	0,20	
Option One Mortgage Loan Trust				0,740 % fällig am 15.10.2030	1.200	1.198	0,04	4,625 % fällig am 31.03.2025	€ 3.500	3.718	0,12	
0,368 % fällig am 25.01.2037	\$ 321	187	0,01	0,900 % fällig am 15.10.2030	7.300	7.299	0,23	5,600 % fällig am 14.11.2024	\$ 1.200	1.030	0,03	
0,478 % fällig am 25.04.2037	115	62	0,00	Towd Point Mortgage Trust				Ukraine Government International Bond				
Orwell Park CLO Designated Activity Co.				3,750 % fällig am 25.05.2058	\$ 6.341	5.524	0,17	7,750 % fällig am 01.09.2021	1.900	1.612	0,05	
0,780 % fällig am 18.07.2029	€ 836	836	0,03	Vendome Funding CLO DAC				7,750 % fällig am 01.09.2022	9.900	8.672	0,27	
OZLME BV				1,860 % fällig am 20.07.2031	€ 2.000	2.005	0,06	7,750 % fällig am 01.09.2023	6.500	5.852	0,18	
0,820 % fällig am 18.01.2030	2.700	2.699	0,09	Voya Euro CLO DAC								
Palmer Square European Loan Funding DAC				0,750 % fällig am 15.10.2030	4.000	3.991	0,13			138.812	4,36	
0,870 % fällig am 15.02.2030	4.200	4.198	0,13			257.845	8,10	Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 3.414.315	107,27		
1,150 % fällig am 15.01.2030	2.000	2.004	0,06	<b>STAATSEMISSIONEN</b>								
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Albania Government International Bond								
0,883 % fällig am 25.08.2035	\$ 460	371	0,01	3,500 % fällig am 16.06.2027	4.700	5.032	0,16	<b>AKTIEN</b>				
PCL Funding PLC				Argentina Government International Bond				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				
1,104 % fällig am 15.09.2024	€ 2.700	3.019	0,10	0,125 % fällig am 09.07.2030	\$ 3.220	1.076	0,03	<b>PIMCO Funds: Global Investors</b>				
Renaissance Home Equity Loan Trust				1,000 % fällig am 09.07.2029	71	25	0,00	<b>Series plc - PIMCO</b>				
1,948 % fällig am 25.09.2037	\$ 196	145	0,00	Banque Centrale de Tunisie Government International Bond				<b>European High Yield Bond Fund (f)</b>				
5,879 % fällig am 25.06.2037 ^	3.494	1.158	0,04	5,625 % fällig am 17.02.2024	€ 5.500	5.105	0,16	1.694.264	17.807	0,56		
7,238 % fällig am 25.09.2037 ^	237	112	0,00	6,375 % fällig am 15.07.2026	10.000	9.151	0,29	<b>PIMCO Funds: Global Investors</b>				
Residential Asset Securities Corp. Trust				Egypt Government International Bond				<b>Series plc - US Short-Term Fund (f)</b>				
0,408 % fällig am 25.11.2036	1.186	893	0,03	4,750 % fällig am 11.04.2025	12.800	13.358	0,42	13.154.723	109.663	3,44		
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				Indonesia Government International Bond				<b>Summe Investmentfonds</b>				
0,328 % fällig am 25.07.2036	221	88	0,00	1,750 % fällig am 24.04.2025	5.000	5.289	0,17	€ 127.470	4,00			
0,468 % fällig am 25.07.2036	216	88	0,00	3,375 % fällig am 30.07.2025	15.400	17.454	0,55					
0,628 % fällig am 25.07.2036	185	77	0,00	3,750 % fällig am 14.06.2028	800	971	0,03					
0,648 % fällig am 25.05.2036	819	468	0,02	Oman Government International Bond								
Soundview Home Loan Trust				6,750 % fällig am 17.01.2048	\$ 1.800	1.461	0,05					
0,258 % fällig am 25.02.2037	293	89	0,00	Qatar Government International Bond								
0,328 % fällig am 25.02.2037	433	135	0,00	3,375 % fällig am 14.03.2024	2.000	1.773	0,06					
0,428 % fällig am 25.06.2037	180	120	0,00	3,875 % fällig am 23.04.2023	5.000	4.397	0,14					
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				Romania Government International Bond								
0,298 % fällig am 25.09.2037	88	61	0,00	2,000 % fällig am 08.12.2026	€ 7.300	7.817	0,24					
St Paul's CLO DAC				2,375 % fällig am 19.04.2027	5.300	5.799	0,18					
0,850 % fällig am 25.04.2030	€ 700	699	0,02									
0,850 % fällig am 20.08.2030	7.293	7.303	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 <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 3.514	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	€ (2.929)	€ 2.872	€ 2.872	0,09
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>€ (2.929)</b>	<b>€ 2.872</b>	<b>€ 2.872</b>	<b>0,09</b>

(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-Bobl March Futures	Short	03.2021	1.059	€ 30	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	1.127	(24)	0,00
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2021	7.065	276	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	1.353	(27)	0,00
				€ 255	0,01
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>€ 255</b>	<b>0,01</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Income 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Group Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 8.000	€ 49	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	\$ 22.700	25	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 1.600	6	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	8.700	17	0,00
Casino Guichard Perrachon S.A.	1,000	20.12.2021	3.500	250	0,01
Casino Guichard Perrachon S.A.	5,000	20.12.2022	200	18	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	\$ 3.600	66	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	4.400	97	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	3.500	93	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2025	5.600	14	0,00
Glencore Finance	5,000	20.06.2024	€ 12.500	4	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	3.300	46	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	7.100	450	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	12.100	851	0,03
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.12.2024	16.700	(4)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2024	4.000	20	0,00
				€ 2.002	0,06

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 35.800	€ (954)	(0,03)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 34 5-Year Index	5,000 %	20.12.2025	€ 230.900	€ 9.274	0,29
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	188.600	1.018	0,04
				€ 10.292	0,33

#### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		0,750 %	16.12.2021	\$ 139.700	€ (18)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		0,750	16.12.2022	255.600	(6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2025	55.600	207	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,000	16.06.2051	€ 25.300	17	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,500	17.03.2026	95.500	(250)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,500	16.06.2026	88.100	197	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,000	16.06.2026	£ 53.300	(7)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,250	16.06.2031	14.800	(80)	(0,01)
						€ 60	0,00
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>€ 11.400</b>	<b>0,36</b>

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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 <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.01.2021	6.900	€ (10)	€ (1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	3.400	(5)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	3.500	(5)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450	20.01.2021	17.500	(13)	(10)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	26.300	(36)	(3)	0,00
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	3.800	(5)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	9.900	(23)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	3.400	(4)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	2.700	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	1.400	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	8.700	(8)	(10)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	6.900	(11)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	8.700	(13)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	9.900	(16)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	8.100	(8)	(5)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	25.100	(16)	(12)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	8.700	(6)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	13.300	(15)	(14)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	25.100	(20)	(23)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	8.700	(9)	(7)	0,00
Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	8.300	(4)	(3)	0,00	
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	8.300	(10)	(12)	0,00	
BRC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	13.700	(25)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	8.900	(10)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	8.400	(10)	(9)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	15.200	(6)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	15.200	(22)	(21)	0,00
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	3.900	(5)	(5)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,950	20.01.2021	3.500	(5)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	3.200	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	1.400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	9.700	(13)	(1)	0,00
FBF	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	9.700	(5)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	9.700	(10)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	3.300	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	17.02.2021	3.100	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	6.600	(8)	(4)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	3.400	(3)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	5.000	(3)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	11.400	(8)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 33 5-Year Index	Verkauf	4,250	16.06.2021	35.200	(37)	0	0,00
JLN	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	10.300	(6)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	10.300	(9)	(5)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	16.300	(9)	(8)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	9.200	(5)	(8)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	16.300	(15)	(15)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	9.200	(10)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	9.000	(14)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	9.700	(17)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	5.000	(8)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	6.100	(7)	(4)	0,00
MYC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	5.500	(6)	(3)	0,00
						€ (532)	€ (243)	(0,01)

<sup>(1)</sup> Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens	
BRC	Intrum AB	5,000 %	20.12.2024	€ 800	€ 69	€ (12)	€ 57	0,00	
DUB	Hammerson PLC	1,000	20.12.2024	1.600	(34)	(82)	(116)	0,00	
FBF	Intrum AB	5,000	20.12.2024	3.600	308	(50)	258	0,01	
GST	Hammerson PLC	1,000	20.12.2022	3.600	31	(144)	(113)	0,00	
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	15.900	1.565	(423)	1.142	0,03	
JPM	Intrum AB	5,000	20.12.2024	700	59	(9)	50	0,00	
MYC	Intrum AB	5,000	20.12.2024	5.400	502	(114)	388	0,01	
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	3.800	358	(85)	273	0,01	
						€ 2.858	€ (919)	€ 1.939	0,06

<sup>(1)</sup> 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.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Income Bond Fund (Forts.)

<sup>(2)</sup> 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	01.2021	€	\$	36.443	44.478	€ 42	€ (94)		
	01.2021	PLN		124	32		(1)		
	01.2021	\$	€	3.030	2.483	7	7		
	02.2021	DKK		23.905	3.213	1	1		
	02.2021	€	AUD	15.893	25.872	413	413		
	02.2021		£	2.987	2.692	18	18		
	02.2021		NOK	16.116	171.960	280	280		
	03.2021	INR	\$	18.242	242	0	(4)		
	01.2021	€		16.915	20.549	13	(135)		
	01.2021	PLN		42	11	0	0		
BPS	01.2021	\$	€	21.410	17.634	137	137		
	02.2021	DKK		235.575	31.655	9	9		
	03.2021	\$	IDR	19.041	271.443.181	294	294		
	01.2021	BRL	\$	790	149	0	(3)		
	01.2021	\$	BRL	152	790	0	0		
	01.2021		€	3.153	2.581	4	4		
	02.2021	£		3.542	3.939	0	(15)		
	01.2021	BRL	\$	790	152	0	0		
	01.2021	\$	BRL	156	790	0	(3)		
	01.2021		€	1.680	1.377	4	4		
CBK	01.2021		ZAR	18.510	292.049	1.081	1.081		
	02.2021	BRL	\$	790	156	3	3		
	03.2021	\$	MXN	408	8.341	5	5		
	01.2021	BRL	\$	199.622	39.276	690	690		
	01.2021	€		6.712	8.186	10	(32)		
	01.2021	\$	BRL	19.699	99.811	0	(395)		
	02.2021	DKK	€	79.170	10.638	3	3		
	02.2021	€	DKK	2.898	21.560	0	(1)		
	02.2021	£	€	1.231	1.369	0	(5)		
	02.2021	SEK		1.225	119	0	(2)		
GLM	02.2021	\$	BRL	19.627	99.811	0	(341)		
	02.2021		RUB	4.927	375.671	109	109		
	03.2021		CNH	20.235	133.083	125	125		
	01.2021	PLN	\$	105	27	0	(1)		
	01.2021	\$	MXN	18.691	384.668	472	472		
	02.2021	DKK	€	1.405.002	188.780	35	35		
	02.2021	€	¥	16.283	2.019.600	0	(304)		
	02.2021	\$	RUB	3.347	250.204	19	19		
	03.2021		IDR	213	3.055.526	4	4		
	01.2021		€	17.908	14.780	145	145		
JPM	02.2021	DKK		294.750	39.606	10	10		
	03.2021	\$	CNH	18.860	125.676	321	321		
	01.2021	€	\$	50.107	60.534	5	(642)		
	01.2021	\$	€	11.475	9.419	43	(2)		
	03.2021	TWD	\$	4.773	170	0	(2)		
	01.2021	€		4.115	5.050	12	12		
	01.2021	\$	€	900.790	752.157	15.948	15.948		
	02.2021	€	SEK	16.040	163.085	181	181		
	02.2021	£	€	175.153	194.765	39	(811)		
	02.2021	\$		920.933	752.157	0	(3)		
SSB	01.2021	€	\$	1.552	1.900	1	1		
	01.2021	\$	€	5.510	4.550	47	47		
	02.2021	€	£	6.533	5.935	92	92		
	02.2021	£	€	2.132	2.338	0	(42)		
	02.2021	\$	RUB	10.866	827.038	224	224		
						€ 20.846	€ (2.880)	€ 17.966	0,57

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ 19.662 0,62

Summe Anlagen

€ 3.575.974 112,35

Sonstige Aktiva und Passiva

€ (393.107) (12,35)

Nettovermögen

€ 3.182.867 100,00

## 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	€ 4.268	0,13
General Motors Co.	5,400	02.10.2023	07.05.2020	1.391	1.374	0,04
				€ 5.686	€ 5.642	0,17

- (i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 31. Dezember 2020 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von EUR 3.453 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von EUR 666 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von EUR 56.578 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von EUR 825 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	255	31.062	0	31.317
<b>Summen</b>	<b>€ 127.725</b>	<b>€ 3.431.083</b>	<b>€ 17.166</b>	<b>€ 3.575.974</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	€ 3.142.404	€ 4.454	€ 3.146.858
Investmentfonds	306.749	0	0	306.749
Pensionsgeschäfte	0	4.241	0	4.241
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(4.180)	22.854	44	18.718
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(143.243)	0	(143.243)
<b>Summen</b>	<b>€ 302.569</b>	<b>€ 3.026.256</b>	<b>€ 4.498</b>	<b>€ 3.333.323</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
CFR	(0,850) %	03.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	€ (2.601)	€ (2.600)	(0,08)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>€ (2.600)</b>	<b>(0,08)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ 602	€ (237)	€ 365
BPS	218	0	218
BRC	(5)	0	(5)
CBK	1.090	(1.062)	28
DUB	(129)	147	18
FBF	252	(212)	40
GLM	161	278	439
GST	980	(1.030)	(50)
HUS	225	0	225
JLN	(2)	0	(2)

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
JPM	€ 526	€ (515)	€ 11
MYC	381	(433)	(52)
MYI	(323)	335	12
RBC	(2)	0	(2)
SCX	15.366	(20.874)	(5.508)
SSB	1	0	1
TOR	47	0	47
UAG	274	(237)	37

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	81,07	71,12
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	22,96	28,30
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,24	k. A.
Investmentfonds	4,00	9,69
Pensionsgeschäfte	0,09	0,13
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	(0,13)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,36	0,31
Freiverkehrsfinanzderivate	0,62	0,42
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(4,53)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,08)	(0,48)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	4,12	4,48
Unternehmensanleihen und Wechsel	71,09	61,03
Wandelanleihen & Wechsel	0,20	0,03
US-Regierungsbehörden	15,20	19,67
Non-Agency-MBS	4,20	3,12
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,10	5,02
Staatsemissionen	4,36	5,67
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,40
Investmentfonds	4,00	9,69
Pensionsgeschäfte	0,09	0,13
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	(0,13)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,06	0,04
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,03)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,33	0,03
Zinsswaps	0,00	0,24
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,06	0,11
Devisenterminkontrakte	0,57	0,33
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(4,53)
Sonstige Aktiva und Passiva	(12,35)	(5,31)
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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				<b>SapphireOne Mortgages FCT</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Fannie Mae</b>				0,002 % fällig am 27.06.2061			€ 151 € 151 0,08
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				0,191 % fällig am 25.07.2037			\$ 9 € 7 0,00	<b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>			
AMCO - Asset Management Co. SpA	€ 400	€ 415	0,23	Uniform Mortgage-Backed Security	1.491	1.286	0,71	0,954 % fällig am 12.03.2052			€ 290 322 0,18
1,500 % fällig am 17.07.2023				3,500 % fällig am 01.07.2048				1,254 % fällig am 25.05.2051			87 97 0,05
Atrium European Real Estate Ltd.		390	0,22	3,810 % fällig am 01.08.2036	1	1	0,00	<b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>			
3,625 % fällig am 17.10.2022				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				0,652 % fällig am 19.07.2035			\$ 25 20 0,01
Banca Carige SpA		600	0,33	2,000 % fällig am 01.03.2051	12.900	10.917	5,98	<b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>			
0,877 % fällig am 25.02.2021				2,500 % fällig am 01.03.2051	5.900	5.068	2,78	0,788 % fällig am 25.09.2043			29 24 0,01
Bank of America Corp.		500	0,28	3,500 % fällig am 01.02.2051	5.900	5.104	2,80	<b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>			
0,260 % fällig am 04.05.2023								0,955 % fällig am 20.05.2045			€ 386 431 0,24
Bank of China Ltd.						22.383	12,27	1,073 % fällig am 20.10.2051			654 734 0,40
0,950 % fällig am 21.09.2023	\$ 600	491	0,27	<b>US-SCHATZOBBLIGATIONEN</b>				<b>Twin Bridges PLC</b>			
Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL	€ 400	406	0,22	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				0,000 % fällig am 14.12.2054			199 224 0,12
1,400 % fällig am 06.07.2022				0,125 % fällig am 15.07.2030			914 839 0,46				
CK Hutchison Finance Ltd.		400	0,23	0,875 % fällig am 15.01.2029			423 406 0,22				
1,250 % fällig am 06.04.2023				0,875 % fällig am 15.02.2047			216 237 0,13				
Deutsche Bank AG		300	0,17	1,000 % fällig am 15.02.2048			856 976 0,54				
1,000 % fällig am 19.11.2025											
Europäische Union		1.000	0,56	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
0,000 % fällig am 04.07.2035 (b)				Alba PLC				Accunia European CLO BV			
Goldman Sachs Group, Inc.		300	0,17	0,000 % fällig am 15.12.2038			€ 272 265 0,14	0,950 % fällig am 15.07.2030			€ 700 700 0,38
0,096 % fällig am 09.09.2022				Avon Finance No. 2 PLC				AlbaCore EURO CLO DAC			
JPMorgan Chase & Co.	\$ 500	416	0,23	0,954 % fällig am 20.09.2048			€ 778 868 0,48	1,530 % fällig am 18.07.2031			400 402 0,22
1,445 % fällig am 24.10.2023				Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				Arbour CLO DAC			
Jyske Realkredit A/S	DKK 6.467	878	0,48	2,550 % fällig am 25.07.2033			\$ 6 4 0,00	0,580 % fällig am 15.03.2029			267 266 0,15
1,000 % fällig am 01.10.2050		92	0,01	Bluestep Mortgage Securities DAC				Aurium CLO DAC			
1,500 % fällig am 01.10.2050		38	0,00	0,207 % fällig am 10.08.2066			€ 167 167 0,09	0,680 % fällig am 13.10.2029			849 850 0,47
2,000 % fällig am 01.10.2050				Canterbury Finance No. 1 PLC				Auto Abs UK Loans			
LeasePlan Corp. NV	€ 200	209	0,11	1,225 % fällig am 16.05.2056			€ 145 163 0,09	0,711 % fällig am 27.11.2027			€ 383 428 0,23
1,375 % fällig am 07.03.2024				Canterbury Finance No. 3 PLC				BBVA Consumer Auto			
Natwest Group PLC	\$ 200	170	0,09	1,053 % fällig am 16.05.2057			178 198 0,11	0,270 % fällig am 20.07.2031			€ 290 290 0,16
8,625 % fällig am 15.08.2021 (e)(g)				Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				BlueMountain Fuji Eur CLO DAC			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab	DKK 10.269	1.397	0,77	0,653 % fällig am 16.01.2057			173 193 0,11	0,910 % fällig am 15.01.2033			400 400 0,22
1,000 % fällig am 01.10.2050		38	0,00	Ciel No. 1 PLC				BNPP AM Euro CLO BV			
2,000 % fällig am 01.10.2050				1,091 % fällig am 12.06.2046			259 290 0,16	0,650 % fällig am 15.10.2031			250 249 0,14
Nova Ljubljanska Banka d.d.	€ 100	91	0,05	Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				Cairn CLO BV			
3,400 % fällig am 05.02.2030				2,785 % fällig am 25.07.2033			\$ 11 9 0,00	0,790 % fällig am 25.07.2029			1.067 1.067 0,58
Nykredit Realkredit A/S	DKK 3.000	412	0,23	0,141 % fällig am 28.07.2054			€ 544 543 0,30	0,930 % fällig am 30.04.2031			100 100 0,05
1,000 % fällig am 01.07.2022		70.713	9,601	Eurohome UK Mortgages PLC				1,000 % fällig am 15.10.2031			300 300 0,16
1,000 % fällig am 01.10.2050		5.500	0,742	0,193 % fällig am 15.06.2044			€ 254 276 0,15	CVC Cordatus Loan Fund DAC			
1,000 % fällig am 01.10.2053		2	0,00	European Residential Loan Securitisation DAC				0,650 % fällig am 21.07.2030			1.400 1.393 0,76
1,500 % fällig am 01.10.2047		36	0,00	Eurosail PLC				CVC Cordatus Loan Fund Ltd.			
1,500 % fällig am 01.10.2050		44	0,00	0,198 % fällig am 10.12.2044			€ 25 28 0,02	0,970 % fällig am 22.04.2030			650 650 0,36
2,000 % fällig am 01.10.2050				Finsbury Square PLC				Dartry Park CLO DAC			
RCI Banque S.A.	€ 400	401	0,22	0,000 % fällig am 16.06.2070			284 320 0,17	1,300 % fällig am 28.04.2029			70 70 0,04
0,124 % fällig am 14.03.2022				Great Hall Mortgages PLC				Euro-Galaxy CLO BV			
Realkredit Danmark A/S	DKK 700	96	0,05	0,000 % fällig am 18.03.2039			€ 126 125 0,07	0,820 % fällig am 10.11.2030			400 400 0,22
1,000 % fällig am 01.04.2022				0,366 % fällig am 18.06.2039			\$ 45 36 0,02	Fair Oaks Loan Funding DAC			
SIX Finance Luxembourg S.A.	€ 400	400	0,22	Hawksmoor Mortgages PLC				1,900 % fällig am 15.07.2031			600 604 0,33
0,000 % fällig am 02.12.2025 (b)				1,104 % fällig am 25.05.2053			€ 1.099 1.230 0,67	<b>GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC</b>			
SLM Student Loan Trust		664	0,34	Jubilee Place BV				1,550 % fällig am 20.07.2031			400 401 0,22
0,007 % fällig am 15.12.2033				0,485 % fällig am 17.10.2057			€ 200 200 0,11	Halcyon Loan Advisors European Funding DAC			
Standard Chartered PLC	\$ 200	165	0,09	1,000 % fällig am 01.06.2060 (a)			€ 800 886 0,49	0,770 % fällig am 18.01.2031			200 199 0,11
1,319 % fällig am 14.10.2023				Jupiter Mortgage Ltd.				Hayfin Emerald CLO DAC			
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	€ 800	809	0,44	Landmark Mortgage Securities PLC				1,450 % fällig am 15.02.2033			400 402 0,22
0,010 % fällig am 10.09.2025				0,237 % fällig am 17.06.2039			232 249 0,14	<b>Mackay Shields Euro CLO DAC</b>			
UBS Group AG	\$ 400	331	0,18	0,328 % fällig am 17.04.2044			919 979 0,54	1,550 % fällig am 15.08.2033			400 403 0,22
6,875 % fällig am 22.03.2021 (e)(g)				Ludgate Funding PLC				Man GLG Euro CLO DAC			
Volkswagen Bank GmbH	€ 200	200	0,11	0,221 % fällig am 01.01.2061			109 116 0,06	0,870 % fällig am 15.01.2030			1.000 997 0,55
0,000 % fällig am 15.06.2021		300	0,16	0,232 % fällig am 01.12.2060			275 295 0,16	NovaStar Mortgage Funding Trust			
0,168 % fällig am 08.12.2021		600	0,33					0,853 % fällig am 25.01.2036			\$ 1.000 810 0,44
0,955 % fällig am 01.08.2022				Newgate Funding PLC				OZLME BV			
Volkswagen Financial Services AG		300	0,17	0,057 % fällig am 15.12.2050			€ 954 935 0,51	0,820 % fällig am 18.01.2030			€ 800 800 0,44
0,625 % fällig am 01.04.2022				0,173 % fällig am 15.12.2050			€ 11 12 0,01	Palmer Square European Loan Funding DAC			
		23.045	12,63	Polaris PLC				0,870 % fällig am 15.02.2030			600 600 0,33
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				1,301 % fällig am 27.05.2057			294 330 0,18	1,150 % fällig am 15.01.2030			400 401 0,22
Barry Callebaut Services NV	\$ 400	356	0,19	Residential Mortgage Securities PLC				Penta CLO BV			
5,500 % fällig am 15.06.2023				0,837 % fällig am 20.03.2050			173 193 0,11	0,790 % fällig am 04.08.2028			655 655 0,36
Bayer AG	€ 100	102	0,06	1,234 % fällig am 20.09.2065			75 84 0,05	<b>Purple Master Credit Cards</b>			
0,375 % fällig am 06.07.2024				RMAC Securities PLC				0,127 % fällig am 25.05.2034			400 404 0,22
Sixt SE		300	0,17	0,191 % fällig am 12.06.2044			261 279 0,15				
1,750 % fällig am 09.12.2024											
		764	0,42								
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		23.809	13,05								

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Long Average Duration 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
Silver Arrow S.A. 0,146 % fällig am 15.02.2027 0,164 % fällig am 20.11.2030	€ 155	€ 547	0,09 0,30	China Development Bank 0,000 % fällig am 27.10.2023 (b)	€ 400	€ 400	0,22	Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 400	€ 332	0,18
SLM Student Loan Trust 0,000 % fällig am 17.06.2024 0,007 % fällig am 15.12.2033	80 196	80 182	0,04 0,10	Croatia Government International Bond 1,500 % fällig am 17.06.2031	400	439	0,24	Slovenia Government International Bond 0,875 % fällig am 15.07.2030 1,750 % fällig am 03.11.2040 (h)	€ 400 1.700	441 2.212	0,24 1,21
St Paul's CLO DAC 0,850 % fällig am 25.04.2030 0,850 % fällig am 20.08.2030	300 1.598	300 1.601	0,16 0,88	France Government International Bond 1,250 % fällig am 25.05.2036 1,500 % fällig am 25.05.2050 1,750 % fällig am 25.06.2039	4.000 12.150 3.100	4.813 16.203 4.099	2,64 8,88 2,25	Societe Du Grand Paris EPIC 0,700 % fällig am 15.10.2060	300	306	0,17
Tikehau CLO BV 0,880 % fällig am 07.12.2029	1.100	1.100	0,60	Israel Government International Bond 0,000 % fällig am 25.05.2066 2,000 % fällig am 25.05.2048 3,250 % fällig am 25.05.2045	2.370 10.950 6.500	3.612 15.969 11.241	1,98 8,75 6,16	Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030 1,950 % fällig am 30.04.2026	2.200 400	2.460 451	1,35 0,25
Toro European CLO DAC 0,900 % fällig am 15.10.2030	1.200	1.200	0,66	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,500 % fällig am 25.04.2055 4,000 % fällig am 25.04.2060 4,500 % fällig am 25.04.2041	500 4.050 3.350	1.085 9.316 6.351	0,59 5,11 3,48			102.114	55,96
Vendome Funding CLO DAC 1,860 % fällig am 20.07.2031	400	401	0,22	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 25.04.2047	€ 329.673	2.623	1,44	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
Venture CLO Ltd. 1,366 % fällig am 22.10.2031	\$ 800	655	0,36	Netherlands Government International Bond 2,750 % fällig am 15.01.2047	€ 3.350	5.993	3,28	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b> (0,079) % fällig am 01.02.2021 (b)(c)	¥ 370.000	2.929	1,61
Voya Euro CLO DAC 0,750 % fällig am 15.10.2030	€ 400	399	0,22	Region Wallonne Belgium 0,650 % fällig am 16.01.2051	300	300	0,16	Summe kurzfristige Instrumente		2.929	1,61
		21.961	12,03	Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050 (b) 1,250 % fällig am 15.08.2048	4.800 2.400	5.044 3.387	2,76 1,86	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>	€	187.453	102,74
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029 (d)	€ 329.673	2.623	1,44	<b>AKTIEN</b>			
Austria Government International Bond 0,850 % fällig am 30.06.2120	110	146	0,08	Netherlands Government International Bond 2,750 % fällig am 15.01.2047	€ 3.350	5.993	3,28	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035 4,900 % fällig am 15.09.2021	200 500	271 518	0,15 0,28	Region Wallonne Belgium 0,650 % fällig am 16.01.2051	300	300	0,16	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
Caisse Francaise de Financement Local 0,000 % fällig am 25.02.2025	400	405	0,22	Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050 (b) 1,250 % fällig am 15.08.2048	4.800 2.400	5.044 3.387	2,76 1,86	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	104.000	10.189	5,58
								<b>Summe Investmentfonds</b>	€	10.189	5,58

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 206	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	€ (172)	€ 168	€ 168	0,09
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						€ (172)	€ 168	€ 168	0,09

<sup>(1)</sup> 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
Kafoptionen mit Ausübungskurs von EUR 114.400 auf Euro-Schatz Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	128	€ 0	0,00
Kafoptionen mit Ausübungskurs von EUR 115.000 auf Euro-Schatz Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	347	0	0,00
Kafoptionen mit Ausübungskurs von 135,750 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond February 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Short	01.2021	29	3	0,00
Kafoptionen mit Ausübungskurs von 136,000 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Short	02.2021	27	3	0,00
Kafoptionen mit Ausübungskurs von 139,500 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	85	0	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2021	98	9	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	3	0	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	232	93	0,05
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	200	89	0,05
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2021	449	38	0,02
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	3	(1)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2021	196	(36)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	187	37	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	39	(13)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	13	3	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	12	14	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	16	54	0,03
				€ 293	0,16

<sup>(1)</sup> Future-Style-Option.

## OPTIONSKAUF

### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note March 2021 Futures	\$ 111,000	19.02.2021	200	€ 2	€ 0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note March 2021 Futures	117,250	19.02.2021	24	0	0	0,00
				€ 2	€ 0	0,00
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>					<b>€ 293</b>	<b>0,16</b>

### 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 <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,394 %	21.11.2023	\$ 7.100	€ (6)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2051	€ 3.600	(34)	(0,02)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	16.06.2051	2.300	4	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2071	300	3	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	17.03.2031	3.500	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031	11.500	12	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035	8.600	144	0,08
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2023	400	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2026	200	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	7.000	(1)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	15.12.2040	8.500	105	0,06
Zahlung	UKRPI	3,330	15.01.2025	£ 1.300	34	0,02
Zahlung	UKRPI	3,400	15.12.2024	5.300	174	0,10
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	1.700	46	0,02
Zahlung	UKRPI	3,513	15.12.2029	1.100	47	0,02
					€ 528	0,29
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>€ 528</b>	<b>0,29</b>

<sup>(1)</sup> 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,195 %	02.11.2022	650	€ 0	€ 36	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	850	55	47	0,03
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	450	42	41	0,02
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	450	28	25	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	250	23	23	0,01
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,344	17.11.2022	16.800	16	23	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,200	15.03.2021	600	0	45	0,03
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	610	38	34	0,02
						€ 202	€ 274	0,15	

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450 %	20.01.2021	2.000	€ (2)	€ (1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	3.500	(5)	(1)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	400	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	200	0	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	1.500	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	1.500	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	1.500	(2)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	6.500	(4)	(3)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	2.200	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	6.500	(5)	(6)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	2.200	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	300	0	0	0,00
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	1.200	(2)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	2.700	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	2.700	(3)	(1)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FBF	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800 %	17.03.2021	800	€ (1)	€ (1)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	200	0	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	2.800	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	2.800	(3)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	2.100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	2.700	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	2.100	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	2.700	(3)	(2)	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	800	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	500	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	500	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	800	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	700	(1)	0	0,00
						€ (48)	€ (32)	(0,01)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000 %	02.11.2022	2.000	€ 0	€ (34)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	2.490	(52)	(43)	(0,03)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	1.350	(41)	(40)	(0,02)
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	1.310	(27)	(23)	(0,01)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	14.000	(18)	(15)	(0,01)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	300	(11)	(2)	0,00
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	750	(22)	(23)	(0,01)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	100	(4)	(1)	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	1.900	(40)	(33)	(0,02)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	17.02.2021	300	(9)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,100	15.03.2021	1.200	0	(17)	(0,01)
						€ (224)	€ (233)	(0,13)	

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	\$ 102,906	11.03.2021	300	€ (1)	€ (2)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2051	103,594	14.01.2021	700	(2)	0	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	200	0	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	99,688	04.02.2021	900	(5)	(4)	(0,01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,188	04.02.2021	700	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,266	04.02.2021	700	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	400	(1)	0	0,00
					€ (14)	€ (11)	(0,01)

<sup>(1)</sup> 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	02.2021	DKK 6.205	€ 834	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	02.2021	\$ 6.779	€ 5.543	9	0	9	0,01
BPS	02.2021	DKK 12.386	€ 1.664	0	0	0	0,00
	02.2021	€ 900	£ 830	26	0	26	0,01
	02.2021	\$ 218	€ 179	1	0	1	0,00
	04.2022	DKK 700	€ 94	0	0	0	0,00
BRC	02.2021	\$ 569	€ 478	13	0	13	0,01
	07.2022	DKK 2.930	€ 394	0	0	0	0,00
CBK	02.2021	\$ 339	€ 277	1	0	1	0,00
GLM	02.2021	€ 168	DKK 1.250	0	0	0	0,00
	02.2021	882	¥ 111.600	1	0	1	0,00
	02.2021	£ 281	€ 313	0	(1)	(1)	0,00
HUS	02.2021	DKK 73.872	€ 9.926	2	0	2	0,00
	02.2021	€ 330	\$ 405	0	0	0	0,00
	02.2021	¥ 335.200	€ 2.703	51	0	51	0,03
	03.2021	\$ 2.135	CNH 14.063	16	0	16	0,01
JPM	02.2021	DKK 4.160	€ 559	0	0	0	0,00
	02.2021	¥ 370.000	€ 2.987	59	0	59	0,03
MYI	02.2021	€ 873	AUD 1.418	20	0	20	0,01
	02.2021	350	DKK 2.605	0	0	0	0,00
	02.2021	867	NOK 9.265	16	0	16	0,01
RBC	02.2021	189	\$ 230	0	(2)	(2)	0,00
SCX	02.2021	184	£ 167	3	0	3	0,00
	02.2021	£ 7.436	€ 8.264	0	(37)	(37)	(0,02)
SSB	02.2021	€ 1.754	\$ 2.148	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	02.2021	\$ 10.285	€ 8.685	€ 288	€ 0	€ 288	0,16
				€ 506	€ (40)	€ 466	0,26
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						€ 464	0,26
<b>Summe Anlagen</b>						€ 199.095	109,12
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						€ (16.634)	(9,12)
<b>Nettovermögen</b>						€ 182.461	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 wurde zum 31. Dezember 2020 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von EUR 2.212 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 2.822 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	293	993	(1)	1.285
<b>Summen</b>	€ 293	€ 197.917	€ 885	€ 199.095

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	€ 169.614	€ 0	€ 169.614
Investmentfonds	3.000	0	0	3.000
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.402)	196	0	(1.206)
<b>Summen</b>	€ 1.598	€ 169.810	€ 0	€ 171.408

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	(0,850) %	12.08.2020	11.08.2022	€ (2.169)	€ (2.169)	(1,19)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					€ (2.169)	(1,19)

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ 7	€ 0	€ 7
BPS	19	0	19
BRC	15	0	15
CBK	1	0	1
DUB	(3)	0	(3)
FBF	(1)	0	(1)
GLM	(17)	0	(17)
GST	(10)	0	(10)
HUS	69	0	69
JPM	47	0	47
MYC	49	(120)	(71)
MYI	36	0	36
RBC	(2)	0	(2)
SCX	(34)	0	(34)
UAG	288	(270)	18

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	86,31	90,44
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	15,94	13,95
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,49	k. A.
Investmentfonds	5,58	1,85
Pensionsgeschäfte	0,09	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,16	(0,86)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,29	0,09
Freiverkehrsfinanzderivate	0,26	0,03
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,19)	(1,43)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	13,05	8,88
US-Regierungsbehörden	12,27	8,84
US-Schatzobligationen	1,35	5,31
Non-Agency-MBS	6,47	5,28
Forderungsbesicherte Wertpapiere	12,03	11,20
Staatsemissionen	55,96	61,67
Kurzfristige Instrumente	1,61	3,21
Investmentfonds	5,58	1,85
Pensionsgeschäfte	0,09	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,16	(0,86)
Futures		
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,02)
Zinsswaps	0,29	0,11
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,15	0,14
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	(0,04)
Zinsswapoptionen	(0,13)	(0,26)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,26	0,19
Sonstige Aktiva und Passiva	(9,12)	(5,50)
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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
Aircastle Ltd. 5,500 % fällig am 15.02.2022	\$ 800	€ 681	0,08	Equinix, Inc. 2,875 % fällig am 01.02.2026	€ 200	€ 204	0,03	NatWest Group PLC 8,625 % fällig am 15.08.2021 (d)(e)	\$ 600	€ 510	0,06
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	€ 1.200	1.245	0,15	Euroclear Bank S.A. 0,500 % fällig am 10.07.2023	200	204	0,03	NatWest Markets PLC 0,359 % fällig am 27.09.2021 0,625 % fällig am 02.03.2022	€ 400 9.600	402 9.683	0,05 1,20
Aroundtown S.A. 0,375 % fällig am 23.09.2022	4.500	4.530	0,56	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 14.05.2021 0,000 % fällig am 01.12.2021	€ 5.300 1.900	5.281 1.883	0,65 0,23	NE Property BV 2,625 % fällig am 22.05.2023	500	521	0,06
Atrium European Real Estate Ltd. 3,625 % fällig am 17.10.2022	1.600	1.644	0,20	First Abu Dhabi Bank PJSC 1,180 % fällig am 16.04.2022	\$ 7.400	6.084	0,75	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.01.2022 1,000 % fällig am 01.07.2022	DKK 4.700 15.500	641 2.128	0,08 0,26
Aviation Capital Group LLC 0,884 % fällig am 30.07.2021	\$ 200	162	0,02	General Motors Financial Co., Inc. 0,009 % fällig am 26.03.2022 0,167 % fällig am 10.05.2021	€ 5.300 1.600	5.294 1.601	0,66 0,20	PITCH 5,125 % fällig am 20.07.2022	€ 1.800	1.952	0,24
Banca Carige SpA 0,877 % fällig am 25.02.2021 1,189 % fällig am 25.10.2021	€ 1.100 7.000	1.100 7.040	0,14 0,87	Goldman Sachs Group, Inc. 0,041 % fällig am 21.04.2023 0,079 % fällig am 26.09.2023	6.700 1.500	6.718 1.506	0,83 0,19	Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd. 3,950 % fällig am 05.02.2023	\$ 700	596	0,07
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,250 % fällig am 20.01.2022 2,875 % fällig am 16.04.2021	6.100 2.000	6.196 2.018	0,77 0,25	Hamburg Commercial Bank AG 0,750 % fällig am 23.11.2023	800	806	0,10	QNB Finance Ltd. 1,310 % fällig am 12.02.2022 1,574 % fällig am 31.05.2021	300 7.400	246 6.068	0,03 0,75
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,094 % fällig am 12.04.2022 0,750 % fällig am 11.09.2022 1,000 % fällig am 20.01.2021 8,875 % fällig am 14.04.2021 (d)(e)	4.200 3.000 1.200 1.200	4.224 3.050 1.201	0,52 0,38 0,15	HSBC Holdings PLC 0,159 % fällig am 27.09.2022	5.700	5.725	0,71	Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.04.2022	DKK 26.600	3.638	0,45
Bank of America Corp. 0,189 % fällig am 25.04.2024 0,260 % fällig am 04.05.2023 6,125 % fällig am 15.09.2021	5.500 4.300 € 600	5.539 4.330 698	0,69 0,54 0,09	Hutchison Whampoa Europe Finance Ltd. 3,625 % fällig am 06.06.2022	600	631	0,08	Santander UK Group Holdings PLC 0,309 % fällig am 27.03.2024	€ 900	905	0,11
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,500 % fällig am 16.11.2022	€ 6.900	7.007	0,87	Hutchison Whampoa Finance Ltd. 1,375 % fällig am 31.10.2021	2.100	2.127	0,26	Scentre Group Trust 1,375 % fällig am 22.03.2023	2.900	2.978	0,37
Banque Ovest Africaine de Developpement 5,500 % fällig am 06.05.2021	\$ 1.600	1.330	0,16	IMMOFINANZ AG 2,625 % fällig am 27.01.2023 (g)	2.000	2.068	0,26	Societe Generale S.A. 0,000 % fällig am 27.05.2022 (b) 0,000 % fällig am 06.03.2023	4.700 1.500	4.722 1.507	0,58 0,19
Barclays Bank PLC 6,000 % fällig am 14.01.2021 6,625 % fällig am 30.03.2022 9,500 % fällig am 07.08.2021 10,000 % fällig am 21.05.2021	€ 2.400 1.700 € 340 900	2.404 1.841 399 1.039	0,30 0,23 0,05 0,13	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 1,000 % fällig am 09.09.2023	\$ 5.100	4.172	0,52	Standard Chartered PLC 1,319 % fällig am 14.10.2023 1,333 % fällig am 14.10.2023 1,368 % fällig am 20.01.2023 1,430 % fällig am 10.09.2022 2,744 % fällig am 10.09.2022	\$ 1.100 2.200 3.900 800 1.200	909 1.810 3.209 657 995	0,11 0,22 0,40 0,08 0,12
Barclays PLC 1,875 % fällig am 23.03.2021	€ 6.100	6.130	0,76	Intesa Sanpaolo Bank Luxembourg S.A. 0,208 % fällig am 26.09.2021 (f)	€ 3.400	3.409	0,42	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2,750 % fällig am 24.07.2023	€ 400	430	0,05
Bevco Lux SARL 1,750 % fällig am 09.02.2023	3.700	3.832	0,47	Intesa Sanpaolo SpA 0,443 % fällig am 19.04.2022 2,000 % fällig am 18.06.2021 7,000 % fällig am 19.01.2021 (d)(e)	2.500 200 1.600	2.520 202 1.607	0,31 0,03 0,20	UBS AG 4,750 % fällig am 12.02.2026 (e)	8.300	8.353	1,03
Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 1,400 % fällig am 06.07.2022	4.600	4.674	0,58	JPMorgan Chase & Co. 1,500 % fällig am 26.10.2022	7.500	7.750	0,96	UBS Group AG 6,875 % fällig am 22.03.2021 (d)(e)	\$ 200	165	0,02
BNP Paribas S.A. 0,093 % fällig am 22.05.2023 0,223 % fällig am 07.06.2024	200 1.000	202 1.012	0,03 0,13	Land Securities Capital Markets PLC 1,974 % fällig am 08.02.2026	€ 1.500	1.728	0,21	UniCredit SpA 1,000 % fällig am 18.01.2023 6,950 % fällig am 31.10.2022	€ 2.000 4.000	2.039 4.466	0,25 0,55
BPCE S.A. 0,000 % fällig am 23.03.2023	800	805	0,10	Landesbank Baden-Wuerttemberg 0,318 % fällig am 18.05.2021	3.100	3.466	0,43	Volkswagen Bank GmbH 0,000 % fällig am 15.06.2021	2.700	2.703	0,33
CaixaBank S.A. 1,750 % fällig am 24.10.2023	1.200	1.259	0,16	LeasePlan Corp. NV 0,000 % fällig am 25.01.2021 1,000 % fällig am 24.05.2021 1,000 % fällig am 25.02.2022 1,000 % fällig am 02.05.2023	€ 3.600 2.400 1.300 400	3.601 2.412 1.318 410	0,45 0,30 0,16 0,05	Volkswagen Financial Services AG 0,625 % fällig am 01.04.2022	1.100	1.110	0,14
Castellum AB 2,125 % fällig am 20.11.2023	200	212	0,03	Lloyds Banking Group PLC 0,239 % fällig am 21.06.2024	1.800	1.819	0,23	Volkswagen Leasing GmbH 0,000 % fällig am 06.07.2021 0,250 % fällig am 16.02.2021	600 3.600	601 3.602	0,07 0,45
Citigroup, Inc. 0,000 % fällig am 21.03.2023	2.300	2.314	0,29	Logicor Financing SARL 0,500 % fällig am 30.04.2021 1,500 % fällig am 14.11.2022	3.700 3.100	3.707 3.177	0,46 0,39	Wells Fargo & Co. 0,000 % fällig am 31.01.2022 1,125 % fällig am 29.10.2021 2,125 % fällig am 22.04.2022	2.000 3.500 € 5.000	2.008 3.546 5.708	0,25 0,44 0,71
CNP Assurances 6,875 % fällig am 30.09.2041	1.100	1.156	0,14	MDGH - GMTN BV 5,875 % fällig am 14.03.2021	3.080	3.121	0,39			301.303	37,31
Coöperatieve Rabobank UA 6,625 % fällig am 29.06.2021 (d)(e)	1.400	1.441	0,18	Merlin Properties Socimi S.A. 2,225 % fällig am 25.04.2023 2,375 % fällig am 23.05.2022	500 1.000	522 1.029	0,06 0,13	<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
Credit Agricole S.A. 0,073 % fällig am 06.03.2023 6,500 % fällig am 23.06.2021 (d)(e)	600 2.500	605 2.562	0,08 0,32	Metropolitan Life Global Funding 1,625 % fällig am 09.06.2022	€ 1.500	1.712	0,21	Alfa Laval Treasury International AB 1,375 % fällig am 12.09.2022	€ 3.400	3.474	0,43
Credit Suisse AG 1,375 % fällig am 31.01.2022 6,500 % fällig am 08.08.2023 (e)	3.000 \$ 400	3.058 369	0,38 0,05	Mizuho Financial Group, Inc. 0,000 % fällig am 10.04.2023	€ 600	603	0,07	Babcock International Group PLC 1,750 % fällig am 06.10.2022	400	410	0,05
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 1,250 % fällig am 14.04.2022	€ 8.700	8.863	1,10	Morgan Stanley 0,183 % fällig am 08.11.2022	2.800	2.812	0,35	Bacardi Ltd. 2,750 % fällig am 03.07.2023	1.600	1.684	0,21
Deutsche Bank AG 0,375 % fällig am 18.01.2021 1,250 % fällig am 08.09.2021 1,625 % fällig am 12.02.2021 1,750 % fällig am 16.12.2021 2,375 % fällig am 11.01.2023	200 900 € 7.200 2.500 € 800	200 908 7.214 2.823 839	0,02 0,11 0,89 0,35 0,10	MPT Operating Partnership LP 2,550 % fällig am 05.12.2023 4,000 % fällig am 19.08.2022	€ 1.000 € 300	1.138 314	0,14 0,04	Baidu, Inc. 3,875 % fällig am 29.09.2023	\$ 1.300	1.147	0,14
Deutsche Hypothekbank AG 0,297 % fällig am 22.03.2021	€ 6.400	7.153	0,89	Nasdaq, Inc. 1,750 % fällig am 19.05.2023	1.600	1.665	0,21	BAT Capital Corp. 0,000 % fällig am 16.08.2021	€ 7.100	7.112	0,88
Deutsche Pfandbriefbank AG 1,048 % fällig am 29.09.2023	1.000	1.139	0,14	Nationale-Niederlanden Bank NV 0,375 % fällig am 31.05.2023	1.700	1.725	0,21	BAT International Finance PLC 1,750 % fällig am 05.07.2021	€ 900	1.012	0,13
				Nationwide Building Society 1,000 % fällig am 24.01.2023 3,622 % fällig am 26.04.2023	€ 1.100 \$ 2.100	1.247 1.783	0,15 0,22	Bayer Capital Corp. BV 0,009 % fällig am 26.06.2022	€ 1.600	1.606	0,20
								BMW Finance NV 0,059 % fällig am 02.10.2023 0,061 % fällig am 24.06.2022 0,125 % fällig am 13.07.2022	1.900 4.100 2.500	1.916 4.124 2.514	0,24 0,51 0,31

# 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
Booking Holdings, Inc. 2,150 % fällig am 25.11.2022	€ 1.800	€ 1.868	0,23	Vilmorin & Cie S.A. 2,375 % fällig am 26.05.2021	€ 1.600	€ 1.609	0,20	Lanebrook Mortgage Transaction PLC 1,154 % fällig am 12.06.2057	€ 2.669	€ 2.988	0,37
Bureau Veritas S.A. 1,250 % fällig am 07.09.2023	6.800	7.002	0,87	Worldline S.A. 0,500 % fällig am 30.06.2023	1.600	1.625	0,20	London Wall Mortgage Capital PLC 0,898 % fällig am 15.11.2049	113	126	0,02
Campbell Soup Co. 0,847 % fällig am 15.03.2021	\$ 400	327	0,04	WPP Finance 3,000 % fällig am 20.11.2023	1.000	1.091	0,14	Mulcair Securities DAC 0,489 % fällig am 24.04.2071	€ 362	362	0,04
CRH Finance Germany GmbH 1,750 % fällig am 16.07.2021	€ 700	704	0,09			124.456	15,41	Paragon Mortgages PLC 1,105 % fällig am 15.05.2045	€ 1.353	1.519	0,19
Crown European Holdings S.A. 4,000 % fällig am 15.07.2022	400	418	0,05	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				Polaris PLC 1,301 % fällig am 27.05.2057	2.257	2.529	0,31
Daimler Canada Finance, Inc. 0,155 % fällig am 11.09.2022	3.900	3.924	0,49	Bharti Airtel International Netherlands BV 3,375 % fällig am 20.05.2021	4.100	4.152	0,52	Precise Mortgage Funding PLC 0,983 % fällig am 16.10.2056	95	106	0,01
Daimler International Finance BV 0,000 % fällig am 11.01.2023	1.300	1.303	0,16	British Transco International Finance BV 0,000 % fällig am 04.11.2021 (b)	\$ 100	81	0,01	Residential Mortgage Securities PLC 1,304 % fällig am 20.06.2070	95	106	0,01
0,625 % fällig am 27.02.2023	1.700	1.728	0,21	Global Switch Holdings Ltd. 1,500 % fällig am 31.01.2024	€ 3.600	3.747	0,46	Ripon Mortgages PLC 0,851 % fällig am 20.08.2056	4.168	4.654	0,58
Dell Bank International DAC 0,625 % fällig am 17.10.2022	300	303	0,04	Koninklijke KPN NV 3,250 % fällig am 01.02.2021	300	301	0,04	SapphireOne Mortgages FCT 0,002 % fällig am 27.06.2061	€ 1.270	1.272	0,16
Eastern Creation Investment Holdings Ltd. 1,000 % fällig am 10.09.2023	\$ 1.100	896	0,11	Redexis Gas Finance BV 2,750 % fällig am 08.04.2021	3.500	3.502	0,43	Silverstone Master Issuer PLC 0,526 % fällig am 21.01.2070	€ 1.500	1.681	0,21
Eurofins Scientific SE 3,375 % fällig am 30.01.2023	€ 5.300	5.630	0,70	Southern Power Co. 1,000 % fällig am 20.06.2022	1.700	1.729	0,22	Storm BV 0,093 % fällig am 22.01.2065	€ 800	807	0,10
Fidelity National Information Services, Inc. 0,125 % fällig am 21.05.2021	700	701	0,09	SPP-Distribucia A/S 2,625 % fällig am 23.06.2021	1.700	1.723	0,21	Stratton Mortgage Funding PLC 0,841 % fällig am 12.03.2044	€ 2.995	3.345	0,41
0,125 % fällig am 03.12.2022	2.500	2.514	0,31	Telecom Italia SpA 5,875 % fällig am 19.05.2023	€ 2.300	2.820	0,35	1,254 % fällig am 25.05.2051	347	388	0,05
0,750 % fällig am 21.05.2023	1.600	1.633	0,20			18.055	2,24	Towd Point Mortgage Funding PLC 0,955 % fällig am 20.05.2045	868	970	0,12
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 3,125 % fällig am 17.11.2023	2.600	2.773	0,34	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		443.814	54,96	1,073 % fällig am 20.10.2051	5.380	6.034	0,75
General Mills, Inc. 1,228 % fällig am 17.10.2023	\$ 100	83	0,01	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				Tower Bridge Funding No. 2 PLC 0,934 % fällig am 20.03.2056	59	66	0,01
Glencore Finance Europe Ltd. 6,000 % fällig am 03.04.2022	€ 5.000	5.969	0,74	Freddie Mac 0,650 % fällig am 27.10.2025	\$ 3.900	3.189	0,39	Tower Bridge Funding PLC 1,425 % fällig am 20.09.2063	1.800	2.021	0,25
Greif Nevada Holdings, Inc. SCS 7,375 % fällig am 15.07.2021	€ 1.000	1.040	0,13	0,700 % fällig am 19.08.2025	7.900	6.461	0,80	Vela Home SRL 0,000 % fällig am 25.10.2042	€ 92	92	0,01
Imperial Brands Finance PLC 0,500 % fällig am 27.07.2021	1.000	1.003	0,12	0,800 % fällig am 28.10.2026	4.200	3.434	0,43				
9,000 % fällig am 17.02.2022	€ 5.800	7.100	0,88			13.084	1,62				
Informa PLC 1,500 % fällig am 05.07.2023	€ 1.700	1.744	0,22	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
International Flavors & Fragrances, Inc. 0,500 % fällig am 25.09.2021	2.200	2.210	0,27	Arena NHG BV 0,000 % fällig am 17.06.2048	€ 1.478	1.481	0,18	Arbour CLO DAC 0,580 % fällig am 15.03.2029	356	355	0,04
Kinder Morgan, Inc. 1,500 % fällig am 16.03.2022	1.300	1.325	0,16	Avon Finance No. 2 PLC 0,954 % fällig am 20.09.2048	€ 2.821	3.148	0,39	Asset-Backed European Securitisation Transaction 0,000 % fällig am 23.08.2030	302	303	0,04
Lunar Funding for Swisscom AG 1,875 % fällig am 08.09.2021	300	305	0,04	Bluestep Mortgage Securities DAC 0,207 % fällig am 10.08.2066	€ 1.025	1.025	0,13	Auto ABS French Leases 0,007 % fällig am 28.05.2030	1.630	1.632	0,20
McDonald's Corp. 1,125 % fällig am 26.05.2022	1.600	1.631	0,20	Canada Square Funding PLC 1,156 % fällig am 17.10.2051	€ 1.928	2.156	0,27	Auto Abs UK Loans 0,711 % fällig am 27.11.2027	€ 4.782	5.348	0,66
Medtronic Global Holdings S.C.A. 0,000 % fällig am 07.03.2021	5.300	5.303	0,66	Canterbury Finance No. 1 PLC 1,405 % fällig am 16.05.2056	1.300	1.453	0,18	Bavarian Sky S.A. 0,000 % fällig am 20.10.2024	€ 110	109	0,01
0,000 % fällig am 15.03.2023 (b)	3.600	3.617	0,45	Canterbury Finance No. 3 PLC 1,053 % fällig am 16.05.2057	1.776	1.979	0,24	0,118 % fällig am 20.05.2027	1.110	1.119	0,14
Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	2.400	2.503	0,31	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates 0,653 % fällig am 16.01.2057	346	386	0,05	BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	4.857	4.863	0,60
Origin Energy Finance Ltd. 3,500 % fällig am 04.10.2021	1.000	1.028	0,13	Darrowby No. 5 PLC 0,583 % fällig am 20.12.2057	612	686	0,08	Bumper NL Finance BV 0,000 % fällig am 22.07.2031	943	944	0,12
Philip Morris International, Inc. 1,875 % fällig am 03.03.2021	800	803	0,10	Durham Mortgages A PLC 0,601 % fällig am 31.03.2053	642	717	0,09	Bumper UK Finance PLC 0,653 % fällig am 20.12.2028	€ 3.235	3.615	0,45
ProSiebenSat.1 Media SE 2,625 % fällig am 15.04.2021	4.700	4.704	0,58	Durham Mortgages B PLC 0,651 % fällig am 31.03.2054	533	594	0,07	Cairn CLO BV 0,670 % fällig am 31.01.2030	€ 2.100	2.098	0,26
SIG Combibloc Purchase Co. SARL 1,875 % fällig am 18.06.2023	400	414	0,05	Dutch Property Finance BV 0,141 % fällig am 28.07.2054	€ 272	272	0,03	Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC 0,680 % fällig am 16.09.2025	€ 5.669	6.339	0,79
Syngenta Finance NV 1,875 % fällig am 02.11.2021	1.500	1.517	0,19	Economic Master Issuer PLC 0,524 % fällig am 25.06.2072	€ 700	784	0,10	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,730 % fällig am 21.09.2029	€ 159	159	0,02
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 0,573 % fällig am 21.11.2022	800	812	0,10	European Residential Loan Securitisation DAC 0,276 % fällig am 24.03.2063	€ 1.571	1.571	0,19	Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC 0,266 % fällig am 15.12.2029	1.400	1.402	0,17
TDF Infrastructure SASU 2,875 % fällig am 19.10.2022	800	832	0,10	Finsbury Square PLC 0,691 % fällig am 12.09.2065	€ 137	153	0,02	Driver Australia Five Trust 1,022 % fällig am 21.07.2026	AUD 243	153	0,02
Teleperformance 1,500 % fällig am 03.04.2024	3.600	3.749	0,46	0,854 % fällig am 16.03.2070	1.125	1.255	0,16	Driver Australia Six Trust 0,910 % fällig am 21.12.2027	475	298	0,04
Tesco Corporate Treasury Services PLC 1,375 % fällig am 24.10.2023	1.900	1.971	0,24	0,106 % fällig am 16.06.2069	238	266	0,03	Driver Espana Four 0,000 % fällig am 21.04.2028	€ 1.733	1.735	0,22
Ubisoft Entertainment S.A. 1,289 % fällig am 30.01.2023	2.100	2.147	0,27	Friary No. 6 PLC 0,775 % fällig am 21.11.2067	836	941	0,12	Dryden Euro CLO BV 0,880 % fällig am 15.01.2030	1.300	1.300	0,16
UCB S.A. 4,125 % fällig am 04.01.2021	6.900	6.900	0,85	Harben Finance PLC 0,851 % fällig am 20.08.2056	2.739	3.061	0,38	FACT Master S.A. 0,000 % fällig am 20.11.2025	3.039	3.034	0,38
Vale S.A. 3,750 % fällig am 10.01.2023	4.400	4.698	0,58	Jupiter Mortgage Ltd. 1,000 % fällig am 01.06.2060 (a)	3.500	3.876	0,48	Jubilee CLO BV 0,334 % fällig am 12.07.2028	589	585	0,07
				Lanark Master Issuer PLC 0,000 % fällig am 22.12.2054	€ 5.087	5.093	0,63				
				0,866 % fällig am 22.12.2069	€ 1.267	1.419	0,18				

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
Palmer Square European Loan Funding DAC 0,870 % fällig am 15.02.2030	€ 600	€ 600	0,07	Israel Government International Bond 0,000 % fällig am 22.07.2022 (b)	€ 7.100	€ 7.129	0,88	(0,395) % fällig am 10.02.2021	€ 3.200	€ 3.202	0,40
Pepper Iberia Unsecured DAC 0,000 % fällig am 07.04.2028	200	200	0,02	Poland Government International Bond 0,000 % fällig am 07.07.2023 (b)	6.100	6.147	0,76			19.017	2,36
Purple Master Credit Cards 0,127 % fällig am 25.05.2034	2.100	2.119	0,26	Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 300	249	0,03	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
SC Germany Auto UG 0,000 % fällig am 13.12.2026	362	363	0,05	South Africa Government International Bond 5,875 % fällig am 30.05.2022	700	613	0,08	Pacific Gas & Electric Co. 1,600 % fällig am 15.11.2021	\$ 4.400	€ 3.598	0,45
SCF Rahoituspalvelut Kimi DAC 0,000 % fällig am 25.11.2026	208	208	0,03	Tokyo Metropolitan Government 0,770 % fällig am 20.12.2022	¥ 80.000	643	0,08	<b>FRANCE TREASURY BILLS</b>			
Silver Arrow S.A. 0,164 % fällig am 20.11.2030	1.275	1.279	0,16			43.708	5,41	(0,715) % fällig am 21.04.2021 (b)(c)	€ 15.000	15.030	1,86
SLM Student Loan Trust 0,000 % fällig am 25.01.2024	20	20	0,00	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>GERMANY TREASURY BILLS</b>			
0,000 % fällig am 17.06.2024	43	43	0,01	<b>COMMERCIAL PAPER</b>				(0,657) % fällig am 25.08.2021 (b)(c)	15.000	15.072	1,86
Sorrento Park CLO DAC 0,437 % fällig am 16.11.2027	553	552	0,07	Hannover Funding Co. LLC (0,335) % fällig am 28.01.2021	€ 600	600	0,07	(0,539) % fällig am 20.01.2021 (b)(c)	15.000	15.006	1,86
St Paul's CLO DAC 0,850 % fällig am 25.04.2030	200	200	0,02	(0,274) % fällig am 22.03.2021	€ 4.600	4.606	0,57			30.078	3,72
Toro European CLO DAC 0,740 % fällig am 15.10.2030	500	499	0,06	Pure Finance S.A. 0,152 % fällig am 06.01.2021	200	200	0,03	<b>IRELAND TREASURY BILLS</b>			
		41.474	5,14	0,152 % fällig am 06.04.2021	200	200	0,03	(1,340) % fällig am 22.02.2021 (b)(c)	12.700	12.710	1,57
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				0,152 % fällig am 07.04.2021	658	658	0,08	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
Autonomous Community of Catalonia 4,900 % fällig am 15.09.2021	8.300	8.593	1,06	0,152 % fällig am 11.05.2021	620	619	0,08	(0,110) % fällig am 16.06.2021 (b)(c)	¥ 1.020.000	8.078	1,00
Brazil Government International Bond 2,875 % fällig am 01.04.2021	4.300	4.334	0,54	0,152 % fällig am 16.06.2021	400	400	0,05	(0,104) % fällig am 01.03.2021 (b)(c)	1.850.000	14.647	1,81
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 0,750 % fällig am 02.09.2023	\$ 3.600	2.951	0,37	0,203 % fällig am 17.02.2021	CHF 100	92	0,01	(0,095) % fällig am 18.01.2021 (b)(c)	900.000	7.125	0,88
Fukuoka Prefecture 0,880 % fällig am 22.06.2022	¥ 680.000	5.452	0,67	0,223 % fällig am 25.02.2021	€ 1.300	1.300	0,16	(0,079) % fällig am 01.02.2021 (b)(c)	3.200.000	25.334	3,14
Infraestruturas de Portugal S.A. 4,250 % fällig am 13.12.2021	€ 7.300	7.597	0,94	0,441 % fällig am 17.02.2021	€ 964	1.076	0,13			55.184	6,83
				0,451 % fällig am 22.03.2021	€ 464	518	0,06	Summe kurzfristige Instrumente		135.617	16,79
				0,461 % fällig am 19.05.2021	200	223	0,03	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>	€	739.079	91,52
				0,641 % fällig am 14.04.2021	\$ 600	490	0,06				
				0,651 % fällig am 08.04.2021	200	163	0,02				
				0,691 % fällig am 07.01.2021	509	416	0,05				
				0,702 % fällig am 18.02.2021	300	245	0,03				
				0,722 % fällig am 01.02.2021	100	82	0,01				
				0,743 % fällig am 10.02.2021	400	327	0,04				
				Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 0,132 % fällig am 01.02.2021	€ 3.600	3.600	0,45				
				Vesteda Finance BV							

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	(2,400) %	31.12.2020	04.01.2021	€ 7.600	Belgium Government International Bond 2,150 % fällig am 22.06.2066	€ (7.614)	€ 7.600	€ 7.598	0,94
RYL	(2,500)	31.12.2020	04.01.2021	55.300	Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2027	(55.268)	55.300	55.285	6,85
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						€ (62.882)	€ 62.900	€ 62.883	7,79

(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-Schatz March Futures	Short	03.2021	341	€ 22	0,00
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				€ 22	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	6-Month EUR-EURIBOR	1,490 %	20.07.2068	€ 4.100	€ 3.512	0,44
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,510	20.07.2068	4.100	(3.525)	(0,44)
					€ (13)	0,00
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					€ (13)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Euro Short-Term 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

#### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Aus- übungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475 %	20.01.2021	7.100	€ (7)	€ (8)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	7.100	(11)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	7.100	(11)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	14.800	(9)	(7)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	7.500	(5)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	14.800	(12)	(13)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	7.500	(7)	(6)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	7.400	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	7.400	(9)	(10)	0,00
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	7.300	(10)	(9)	0,00
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	7.200	(10)	(1)	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	7.200	(11)	(1)	0,00
						€ (106)	€ (66)	(0,01)

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens	
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	\$ 102,906	11.03.2021	3.000	€ (8))	€ (17)	0,00	
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	6.000	(12))	(22)	(0,01)	
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	3.000	(5))	(12)	0,00	
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	3.000	(6))	(6)	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	3.000	(8))	(3)	0,00	
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,141	04.03.2021	4.000	(9))	(3)	0,00	
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	104,141	04.03.2021	4.000	(4))	(4)	0,00	
						€ (52))	€ (67)	(0,01)

<sup>(1)</sup> 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	01.2021	€ 8.059	¥ 1.020.000	€ 15	€ 0	€ 15	0,00
	01.2021	810	\$ 990	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	£ 23.987	€ 26.633	0	(164)	(164)	(0,02)
	02.2021	AUD 789	485	0	(13)	(13)	0,00
	06.2021	¥ 1.020.000	8.046	0	(15)	(15)	0,00
BPS	01.2021	\$ 2.897	2.369	2	0	2	0,00
BRC	01.2021	£ 2.281	2.528	0	(21)	(21)	0,00
	01.2021	¥ 900.000	7.197	74	0	74	0,01
	04.2022	DKK 10.495	1.410	0	0	0	0,00
	07.2022	4.500	605	0	0	0	0,00
CBK	04.2022	11.325	1.522	1	0	1	0,00
	07.2022	7.100	954	0	0	0	0,00
GLM	01.2021	£ 69.165	77.475	207	0	207	0,03
HUS	02.2021	¥ 773.600	6.237	117	0	117	0,01
	04.2022	DKK 5.365	721	0	0	0	0,00
JPM	01.2021	£ 1.787	1.991	0	(6)	(6)	0,00
	02.2021	¥ 3.200.000	25.832	509	0	509	0,06
	03.2021	1.850.000	14.907	272	0	272	0,03
	01.2022	DKK 4.700	631	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	€ 1.274	\$ 1.528	0	(26)	(26)	0,00
	01.2021	\$ 5.052	€ 4.184	55	0	55	0,01
RYL	02.2021	CHF 100	93	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	\$ 63.306	52.861	1.122	0	1.122	0,14
	02.2021	64.722	52.861	0	0	0	0,00
	07.2022	DKK 3.900	524	0	0	0	0,00
				€ 2.374	€ (246)	€ 2.128	0,27

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ 1.995 0,25

Summe Anlagen

€ 803.983 99,56

Sonstige Aktiva und Passiva

€ 3.555 0,44

Nettovermögen

€ 807.538 100,00

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

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Intesa Sanpaolo Bank Luxembourg S.A.	0,208 %	26.09.2021	01.07.2020 - 06.08.2020	€ 3.396	€ 3.409	0,42

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 31. Dezember 2020 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von EUR 1.551 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 226 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von EUR 40 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	22	1.988	(6)	2.004
<b>Summen</b>	<b>€ 22</b>	<b>€ 800.091</b>	<b>€ 3.870</b>	<b>€ 803.983</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	€ 697.702	€ 0	€ 697.702
Pensionsgeschäfte	0	287	0	287
Einlagen bei Kreditinstituten	0	1.517	0	1.517
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(150)	1.488	0	1.338
<b>Summen</b>	<b>€ (150)</b>	<b>€ 700.994</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 700.844</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BRC	(0,950) %	17.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.583)	€ (1.583)	(0,20)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>€ (1.583)</b>	<b>(0,20)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (178)	€ 40	€ (138)
BPS	(53)	0	(53)
BRC	44	0	44
CBK	1	0	1
DUB	(1)	0	(1)
GLM	207	(1.480)	(1.273)
HUS	117	0	117
JLN	(1)	0	(1)
JPM	708	(850)	(142)
MYI	29	0	29
SCX	1.122	(940)	182

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	77,45	94,60
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	12,73	3,66
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,34	k. A.
Pensionsgeschäfte	7,79	0,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	0,25	0,21
Einlagenzertifikate	k. A.	0,22
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,20)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

<b>Anlagen zum Marktwert</b>	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	54,96	58,75
US-Regierungsbehörden	1,62	k. A.
Non-Agency-MBS	7,60	3,82
Forderungsbesicherte Wertpapiere	5,14	9,63
Staatsemissionen	5,41	3,22
Kurzfristige Instrumente	16,79	22,84
Pensionsgeschäfte	7,79	0,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,00	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,00	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,27	0,21
Einlagenzertifikate	k. A.	0,22
Sonstige Aktiva und Passiva	0,44	1,29
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
<b>BELGIEN</b>				<b>IRLAND</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				Nidda Healthcare Holding GmbH				3,625 % fällig am 01.04.2024			
5,750 % fällig am 21.02.2027				3,500 % fällig am 21.08.2026				€ 1.600 € 1.587 0,98			
								Matterhorn Telecom S.A.			
								3,125 % fällig am 15.09.2026			
								2,050 2,039 1,26			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Summe Deutschland</b>				10,490 6,47			
Sarens Finance Co. NV				Summe Irland				3,169 1,95			
5,750 % fällig am 21.02.2027				Virgin Media Vendor Financing Notes DAC				4,625 % fällig am 05.01.2026			
€ 650 € 605 0,37				4,875 % fällig am 15.07.2028				1,000 1,042 0,64			
				€ 400 457 0,28				1,150 1,216 0,75			
								14,659 9,05			
<b>KANADA</b>				<b>ITALIEN</b>				<b>MEXIKO</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bombardier, Inc.				Atlantia SpA				Petroleos Mexicanos			
7,500 % fällig am 01.12.2024				2,125 % fällig am 03.02.2025				3,625 % fällig am 24.11.2025			
7,500 % fällig am 15.03.2025				5,375 % fällig am 18.01.2028				€ 4.300 4,298 2,65			
Summe Kanada				10,500 % fällig am 23.07.2029				€ 4.300 4,319 2,66			
610 0,38				Immobiliare Grande Distribuzione SIQ SpA							
<b>DÄNEMARK</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA							
DKT Finance ApS				2,125 % fällig am 28.11.2024							
7,000 % fällig am 17.06.2023				3,250 % fällig am 15.12.2024							
€ 1.000 1,033 0,64				Sofima Holding SpA							
<b>FINNLAND</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Telecom Italia SpA							
Nokia Oyj				4,000 % fällig am 11.04.2024							
4,375 % fällig am 12.06.2027				3,750 % fällig am 15.01.2028							
\$ 200 179 0,11				UniCredit SpA							
<b>FRANKREICH</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,459 % fällig am 30.06.2035							
Altice France S.A.				7,500 % fällig am 03.06.2026 (d)(f)							
2,125 % fällig am 15.02.2025				Summe Italien							
2,500 % fällig am 15.01.2025				13,091 8,08							
Banijay Entertainment SASU				<b>JAPAN</b>							
5,375 % fällig am 01.03.2025				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
CMA CGM S.A.				SoftBank Group Corp.							
5,250 % fällig am 15.01.2025				3,125 % fällig am 19.09.2025							
7,500 % fällig am 15.01.2026				4,000 % fällig am 19.09.2029							
1,000 1,075 0,66				5,000 % fällig am 15.04.2028							
<b>Crown European Holdings S.A.</b>				Summe Japan							
2,875 % fällig am 01.02.2026				2,970 1,83							
4,000 % fällig am 15.07.2022				<b>JERSEY, KANALINSELN</b>							
Loxam S.A.S.				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
2,875 % fällig am 15.04.2026				Adient Global Holdings Ltd.							
3,250 % fällig am 14.01.2025				3,500 % fällig am 15.08.2024							
700 704 0,43				CPUK Finance Ltd.							
<b>Parts Europe S.A.</b>				6,500 % fällig am 28.08.2026							
6,500 % fällig am 16.07.2025				€ 1.000 1,170 0,72							
1,500 1,569 0,97				HSBC Bank Capital Funding Sterling LP							
<b>Renault S.A.</b>				5,844 % fällig am 05.11.2031 (d)							
1,125 % fällig am 04.10.2027				HSBC Capital Funding Dollar LP							
900 847 0,52				10,176 % fällig am 30.06.2030 (d)							
1,250 % fällig am 24.06.2025				LHC3 PLC (4,125 % bar oder 4,875 % PIK)							
2,300 2,255 1,39				4,125 % fällig am 15.08.2024 (b)							
				€ 1.700 1,734 1,07							
				Summe Jersey, Kanalinseln							
14,381 8,87				4,401 2,71							
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>LUXEMBURG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Casino Guichard Perrachon S.A.				Corestate Capital Holding S.A.							
5,500 % fällig am 31.01.2024				1,375 % fällig am 28.11.2022							
1,900 1,896 1,17				200 160 0,10							
Summe Frankreich				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
16,277 10,04				ADLER Group S.A.							
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Altice Financing S.A.							
Cheplapharm Arzneimittel GmbH				2,250 % fällig am 15.01.2025							
3,500 % fällig am 11.02.2027				3,000 % fällig am 15.01.2028							
900 906 0,56				Altice France Holding S.A.							
4,375 % fällig am 15.01.2028				8,000 % fällig am 15.05.2027							
100 103 0,07				1,600 1,742 1,08							
<b>Clearstream Banking AG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
0,000 % fällig am 01.12.2025 (c)				CeramTec AcquiCo GmbH							
100 101 0,06				2,500 % fällig am 07.03.2025							
<b>Deutsche Bank AG</b>				2,625 % fällig am 16.12.2024							
2,625 % fällig am 16.12.2024				€ 1.000 1,179 0,73							
6,000 % fällig am 30.10.2025 (d)(f)				\$ 200 164 0,10							
Nidda Healthcare Holding GmbH				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
3,500 % fällig am 30.09.2024				ADLER Group S.A.							
€ 1.300 1,293 0,80				2,750 % fällig am 13.11.2026							
<b>Sixt SE</b>				Techem Verwaltungsgesellschaft mbH							
1,750 % fällig am 09.12.2024				2,000 % fällig am 15.07.2025							
400 408 0,25				ZF Finance GmbH							
<b>Techem Verwaltungsgesellschaft mbH</b>				3,750 % fällig am 21.09.2028							
2,000 % fällig am 15.07.2025				2,200 2,370 1,46							
800 797 0,49				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>							
<b>ZF Finance GmbH</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
3,750 % fällig am 21.09.2028				Corestate Capital Holding S.A.							
2,200 2,370 1,46				3,500 % fällig am 15.04.2023							
				Lincoln Financing SARL							
7,321 4,52											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
CeramTec AcquiCo GmbH				Corestate Capital Holding S.A.							
2,500 % fällig am 07.03.2025				3,500 % fällig am 15.04.2023							
1,626 1,582 0,97				300 250 0,15							
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Boels Topholding BV				Corestate Capital Holding S.A.							
4,000 % fällig am 06.02.2027				3,500 % fällig am 15.04.2023							
1,200 1,204 0,74				200 160 0,10							
<b>Sigma Bidco BV</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
3,500 % fällig am 02.07.2025				Corestate Capital Holding S.A.							
1,000 985 0,61				3,500 % fällig am 15.04.2023							
<b>Starfruit Finco BV</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
3,250 % fällig am 01.10.2025				Corestate Capital Holding S.A.							
944 943 0,58				3,500 % fällig am 15.04.2023							
<b>Summe Niederlande</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
3,132 1,93				Corestate Capital Holding S.A.							
9,863 6,09				Lincoln Financing SARL							
<b>NORWEGEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Adevinta ASA				Corestate Capital Holding S.A.							
2,625 % fällig am 15.11.2025				3,500 % fällig am 15.04.2023							
750 768 0,47				300 250 0,15							
3,000 % fällig am 15.11.2027				Lincoln Financing SARL							
750 778 0,48				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>Summe Norwegen</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
1,546 0,95				Corestate Capital Holding S.A.							
<b>RUMÄNIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
RCS & RDS S.A.				Corestate Capital Holding S.A.							
2,500 % fällig am 05.02.2025				3,500 % fällig am 15.04.2023							
900 895 0,55				300 250 0,15							
3,250 % fällig am 05.02.2028				Corestate Capital Holding S.A.							
800 802 0,50				Lincoln Financing SARL							
<b>Summe Rumänien</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
1,697 1,05				Corestate Capital Holding S.A.							
<b>SPANIEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Santander S.A.				Corestate Capital Holding S.A.							
4,375 % fällig am 14.01.2026 (d)				3,500 % fällig am 15.04.2023							
600 603 0,37				300 250 0,15							

# 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
Grifols S.A. 1,625 % fällig am 15.02.2025	€ 1.900	€ 1.909	1,18	Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£ 1.600	€ 1.843	1,14	Occidental Petroleum Corp. 6,625 % fällig am 01.09.2030	\$ 1.000	€ 889	0,55
3,200 % fällig am 01.05.2025	800	810	0,50	5,500 % fällig am 15.05.2029	\$ 500	444	0,27	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	1.666	1.535	0,95
Summe Spanien		3.322	2,05	Virgin Money UK PLC 7,875 % fällig am 14.12.2028	£ 1.600	2.035	1,26	Scientific Games International, Inc. 3,375 % fällig am 15.02.2026	€ 900	899	0,55
<b>SCHWEDEN</b>				<b>USA</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>			
Dometic Group AB 3,000 % fällig am 08.05.2026	1.500	1.550	0,96	Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % fällig am 31.01.2031	€ 100	103	0,06	Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 3,500 % fällig am 30.06.2025	€ 1.290	1.272	0,78
Intrum AB 3,500 % fällig am 15.07.2026	1.650	1.642	1,01	4,000 % fällig am 31.01.2029	€ 100	115	0,07	Zayo Group Holdings, Inc. 3,250 % fällig am 09.03.2027	997	998	0,62
Summe Schweden		3.192	1,97	4,250 % fällig am 31.01.2031	\$ 200	167	0,10	Summe USA		22.554	13,91
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>USA</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>			
INEOS Finance PLC 2,875 % fällig am 01.05.2026	800	812	0,50	AdaptHealth LLC 4,625 % fällig am 01.08.2029 (a)	100	84	0,05	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	103.300	10.121	6,25
International Game Technology PLC 2,375 % fällig am 15.04.2028	1.850	1.843	1,14	Avantor Funding, Inc. 3,875 % fällig am 15.07.2028	€ 1.000	1.055	0,65	Summe Investmentfonds	€	10.121	6,25
Jaguar Land Rover Automotive PLC 5,000 % fällig am 15.02.2022	€ 1.000	1.129	0,70	Coty, Inc. 4,000 % fällig am 15.04.2023	1.600	1.545	0,95	Summe Übertragbare Wertpapiere	€	133.203	82,18
5,875 % fällig am 15.11.2024	€ 300	307	0,19	Dresdner Funding Trust 8,151 % fällig am 30.06.2031	\$ 350	423	0,26	<b>AKTIEN</b>			
6,875 % fällig am 15.11.2026	800	824	0,51	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 07.12.2022	€ 1.200	1.161	0,72	<b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>			
Lloyds Banking Group PLC 2,707 % fällig am 03.12.2035	€ 830	974	0,60	0,172 % fällig am 01.12.2024	2.600	2.411	1,48	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	200	229	0,14	2,386 % fällig am 17.02.2026	1.500	1.529	0,94	<b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>			
4,250 % fällig am 08.12.2023	1.400	1.643	1,01	3,250 % fällig am 15.09.2025	200	210	0,13	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
4,500 % fällig am 10.07.2027	705	821	0,51	Live Nation Entertainment, Inc. 3,750 % fällig am 15.01.2028 (a)	\$ 100	83	0,05	<b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>			
Miller Homes Group Holdings PLC 5,500 % fällig am 15.10.2024	1.400	1.611	0,99	Mauser Packaging Solutions Holding Co. 4,750 % fällig am 15.04.2024	€ 900	904	0,56	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 2.100	2.279	1,41	MPT Operating Partnership LP 3,692 % fällig am 05.06.2028	€ 800	970	0,60	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Virgin Media Finance PLC 3,750 % fällig am 15.07.2030	200	204	0,13	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2030	€ 1.650	1.882	1,16	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
				4,625 % fällig am 15.05.2029	1.800	2.183	1,35	<b>INVESTMENTFONDS</b>			

## AN EINEM GEREGLTEN 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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2021	101	€ 4	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	20	(4)	0,00
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2021	214	(5)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (5)	0,00

## 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<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 34 5-Year Index	5,000 %	20.12.2025	€ 1.500	€ 8	0,01

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000 %	17.06.2022	\$ 3.700	€ 11	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2025	3.800	3	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2030	2.600	(1)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,250	16.06.2031	£ 1.200	(9)	(0,01)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						€ 4	0,00
						€ 12	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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**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 <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050 %	20.01.2021	2.000	€ (3)	€ 0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	3.000	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	1.500	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	3.000	(2)	(3)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	BRC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	1.000	(1)	(1)
Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Kauf	0,425	17.02.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
GST	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	1.000	(1)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	2.000	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	2.000	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
						€ (21)	€ (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	01.2021	€ 163	£ 150	€ 4	€ 0	€ 4	0,00
	01.2021	€ 333	\$ 407	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01.2021	\$ 158	€ 130	1	0	1	0,00
	01.2021	£ 40	€ 44	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2021	€ 599	£ 543	8	0	8	0,01
GLM	01.2021	£ 14.566	€ 16.307	39	(5)	34	0,02
MYI	01.2021	€ 196	\$ 235	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	\$ 1.877	€ 1.554	21	0	21	0,01
SCX	01.2021	9.447	7.888	166	0	166	0,10
	02.2021	9.658	7.888	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	652	530	0	(2)	(2)	0,00
				€ 239	€ (13)	€ 226	0,14

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ 210 0,13

Summe Anlagen

€ 143.541 88,57

Sonstige Aktiva und Passiva

€ 18.520 11,43

Nettovermögen

€ 162.061 100,00

**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) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
 (e) Mit dem Fonds verbunden.  
 (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von EUR 590 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(5)	222	0	217
<b>Summen</b>	<b>€ (5)</b>	<b>€ 143.546</b>	<b>€ 0</b>	<b>€ 143.541</b>

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

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ 4	€ 0	€ 4
BPS	(10)	0	(10)
BRC	(2)	0	(2)
CBK	8	0	8
GLM	34	(360)	(326)
GST	(5)	0	(5)
MYI	17	0	17
SCX	166	(90)	76
UAG	(2)	0	(2)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%) <sup>(1)</sup>
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	70,26	k. A.
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	6,15	k. A.
Sonstige übertragbare Wertpapiere	5,77	k. A.
Investmentfonds	6,25	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	k. A.
Freiverkehrsfinanzderivate	0,13	k. A.

<sup>(1)</sup> Der PIMCO European High Yield Bond Fund wurde am 31. Januar 2020 aufgelegt.

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	
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>												
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>												
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>												
ABN AMRO Bank NV 4,375 % fällig am 22.09.2025 (e)(g)	€ 1.000	€ 1.065	0,30	Hutchison Whampoa Finance Ltd. 1,375 % fällig am 31.10.2021	€ 700	€ 709	0,20	Dell Bank International DAC 0,625 % fällig am 17.10.2022	€ 200	€ 202	0,06	
Altarea S.C.A. 1,750 % fällig am 16.01.2030 1,875 % fällig am 17.01.2028	900 600	903 623	0,26 0,18	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	DKK179.223 19.500 27.429	24.361 2.638 3.789	6,95 0,75 1,08	Fidelity National Information Services, Inc. 0,125 % fällig am 21.05.2021	100	100	0,03	
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	900	934	0,27	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028 (b)	€ 3.100	3.215	0,92	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 3,600 % fällig am 26.02.2021	3.200	3.216	0,92	
Banca Carige SpA 0,877 % fällig am 25.02.2021 1,189 % fällig am 25.10.2021	1.100 3.400	1.100 3.419	0,31 0,97	LeasePlan Corp. NV 3,500 % fällig am 09.04.2025	700	798	0,23	Indonesias Asahan Aluminium Persero PT 5,230 % fällig am 15.11.2021	\$ 500	425	0,12	
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 8,875 % fällig am 14.04.2021 (e)(g)	600	614	0,18	Logicor Financing SARL 0,500 % fällig am 30.04.2021	100	100	0,03	John Lewis PLC 6,125 % fällig am 21.01.2025	€ 500	632	0,18	
Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % fällig am 10.01.2025	\$ 1.100	962	0,27	Morgan Stanley 0,183 % fällig am 08.11.2022	1.700	1.707	0,49	Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	€ 500	522	0,15	
Bank of America Corp. 0,283 % fällig am 07.02.2022	€ 4.800	4.803	1,37	Natwest Group PLC 0,750 % fällig am 15.11.2025 4,269 % fällig am 22.03.2025	500 \$ 300	511 271	0,15 0,08	ProSiebenSat.1 Media SE 2,625 % fällig am 15.04.2021	2.900	2.903	0,83	
Bank of China Ltd. 0,950 % fällig am 21.09.2023	\$ 1.000	818	0,23	NE Property BV 2,625 % fällig am 22.05.2023 (h)	€ 1.000	1.042	0,30	Syngenta Finance NV 1,875 % fällig am 02.11.2021	5.000	5.056	1,44	
Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025 (e)(g)	€ 600	688	0,20	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050 1,000 % fällig am 01.10.2053 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK170.597 36.099 46.450	23.202 4.886 6.415	6,61 1,39 1,83	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 1,125 % fällig am 21.11.2022	300	307	0,09	
Barclays Bank PLC 10,000 % fällig am 21.05.2021	£ 300	346	0,10	Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 200	182	0,05	Telefonica Emisiones S.A. 1,477 % fällig am 14.09.2021	1.300	1.316	0,37	
Bevco Lux SARL 1,500 % fällig am 16.09.2027	€ 300	317	0,09	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK103.364 51.487	14.046 6.985	4,00 1,99	UCB S.A. 4,125 % fällig am 04.01.2021	100	100	0,03	
Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 0,500 % fällig am 12.09.2023	1.000	1.010	0,29	UBS AG 4,750 % fällig am 12.02.2026 (g) 7,625 % fällig am 17.08.2022 (g)	€ 1.900 \$ 600	1.912 543	0,54 0,15	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 1,414 % fällig am 13.12.2022	1.300	1.336	0,38	
BNP Paribas S.A. 0,313 % fällig am 22.09.2022	1.700	1.721	0,49	UBS Group AG 7,125 % fällig am 10.08.2021 (e)(g)	600	506	0,14					
Caixa Economica Montepio Geral Caixa Economica Bancaria S.A. 0,125 % fällig am 14.11.2024	500	505	0,14	Volkswagen Bank GmbH 1,875 % fällig am 31.01.2024	€ 3.900	4.110	1,17	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				
CaixaBank S.A. 1,750 % fällig am 24.10.2023	1.100	1.154	0,33	Volkswagen Financial Services AG 0,625 % fällig am 01.04.2022	2.200	2.221	0,63	AT&T, Inc. 1,600 % fällig am 19.05.2028 2,650 % fällig am 17.12.2021	600 3.700	656 3.777	0,19 1,08	
Citigroup, Inc. 0,500 % fällig am 29.01.2022	300	303	0,09	Volkswagen Leasing GmbH 0,000 % fällig am 06.07.2021	600	601	0,17	Bharti Airtel International Netherlands BV 3,375 % fällig am 20.05.2021	1.900	1.924	0,55	
Cooperative Rabobank UA 6,625 % fällig am 29.06.2021 (e)(g)	2.400	2.470	0,70	Vonovia Finance BV 3,625 % fällig am 08.10.2021	800	824	0,23	Centrais Eletricas Brasileiras S.A. 3,625 % fällig am 04.02.2025	\$ 200	170	0,05	
Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % fällig am 15.04.2023	500	417	0,12	Wells Fargo & Co. 2,125 % fällig am 22.04.2022	£ 1.445	1.650	0,47	Enel Finance International NV 0,000 % fällig am 17.06.2024 (b)	€ 1.800	1.810	0,51	
Coventry Building Society 1,500 % fällig am 23.01.2023	£ 3.100	3.528	1,01	Yorkshire Building Society 0,625 % fällig am 21.09.2025	€ 500	513	0,15	Sprint Corp. 7,125 % fällig am 15.06.2024 7,875 % fällig am 15.09.2023	\$ 300 1.400	287 1.326	0,08 0,38	
CPI Property Group S.A. 1,450 % fällig am 14.04.2022	€ 1.300	1.321	0,38									
Credit Agricole S.A. 1,907 % fällig am 16.06.2026 6,500 % fällig am 23.06.2021 (e)(g)	\$ 700 € 500	594 512	0,17 0,15	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		196.270	55,96	
CyrusOne LP 1,450 % fällig am 22.01.2027	400	405	0,12	Atlantia SpA 1,625 % fällig am 03.02.2025	400	400	0,11	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				
Deutsche Bank AG 0,375 % fällig am 18.01.2021 1,875 % fällig am 14.02.2022 2,222 % fällig am 18.09.2024 2,625 % fällig am 16.12.2024 4,250 % fällig am 14.10.2021	600 1.800 \$ 200 € 1.200 \$ 2.800	600 1.838 168 1.414 2.347	0,17 0,52 0,05 0,40 0,67	Bayer AG 0,375 % fällig am 06.07.2024 1,875 % fällig am 25.01.2021	900 200	913 200	0,26 0,06	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051 2,500 % fällig am 01.03.2051 3,000 % fällig am 01.02.2051 3,500 % fällig am 01.02.2051 4,000 % fällig am 01.02.2051	21.900 10.400 3.900 17.400 7.700	18.533 8.933 3.343 15.054 6.731	5,28 2,55 0,95 4,29 1,92	
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,875 % fällig am 10.04.2035	€ 400	462	0,13	Bayer Capital Corp. BV 0,009 % fällig am 26.06.2022	3.800	3.814	1,09					
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2035 (b)	700	720	0,21	Becton Dickinson Euro Finance SARL 0,174 % fällig am 04.06.2021	400	400	0,11					
FCE Bank PLC 1,875 % fällig am 24.06.2021	1.000	1.003	0,29	BMW Finance NV 0,125 % fällig am 13.07.2022	1.300	1.308	0,37	<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				
Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 14.05.2021 1,104 % fällig am 12.10.2021 1,744 % fällig am 19.07.2024	900 \$ 400 € 400	897 323 399	0,26 0,09 0,11	Conti-Gummi Finance BV 2,125 % fällig am 27.11.2023	600	635	0,18	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,125 % fällig am 15.01.2030 0,125 % fällig am 15.07.2030	8.805 812	8.034 746	2,29 0,21	
GE Capital UK Funding Unlimited Co. 4,125 % fällig am 13.09.2023	€ 200	244	0,07									
General Motors Financial Co., Inc. 0,167 % fällig am 10.05.2021	€ 1.600	1.601	0,46	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Avon Finance No. 2 PLC 0,954 % fällig am 20.09.2048	£ 1.362	1.520	0,43	
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3,000 % fällig am 29.03.2025	100	106	0,03					Canterbury Finance No. 3 PLC 1,053 % fällig am 16.05.2057	355	396	0,11	
Goldman Sachs Group, Inc. 0,096 % fällig am 09.09.2022 4,750 % fällig am 12.10.2021	600 1.300	602 1.347	0,17 0,38					Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates 0,653 % fällig am 16.01.2057	432	482	0,14	

# Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO European Short-Term Opportunities 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
FT RMBS Prado 0,000 % fällig am 15.03.2056	€ 3.104	€ 3.107	0,89	Cairn CLO BV 0,930 % fällig am 30.04.2031 1,000 % fällig am 15.10.2031	€ 100	€ 100	0,03	Voya Euro CLO DAC 0,750 % fällig am 15.10.2030	€ 300	€ 299	0,09
Gosforth Funding PLC 0,000 % fällig am 15.02.2058	509	509	0,15	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,870 % fällig am 18.01.2030 1,110 % fällig am 15.08.2032	4.450	4.447	1,27	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Jubilee Place BV 0,485 % fällig am 17.10.2057	400	400	0,11	Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC 0,266 % fällig am 15.12.2029	700	701	0,20	Autonomous Community of Catalonia 4,900 % fällig am 15.09.2021	1.300	1.346	0,39
Jupiter Mortgage Ltd. 1,000 % fällig am 01.06.2060 (a)	£ 1.600	1.772	0,51	Contego CLO BV 0,770 % fällig am 15.10.2030	300	300	0,09	Caisse Francaise de Financement Local 0,000 % fällig am 25.02.2025	900	911	0,26
Lanebrook Mortgage Transaction PLC 1,154 % fällig am 12.06.2057	692	774	0,22	Cork Street CLO Designated Activity Co. 0,760 % fällig am 27.11.2028	816	817	0,23	China Construction Bank Corp. 0,375 % fällig am 24.01.2022	1.750	1.757	0,50
Miravet SARL 0,322 % fällig am 26.05.2065	€ 700	687	0,20	CVC Cordatus Loan Fund DAC 0,650 % fällig am 21.07.2030	1.600	1.593	0,45	Development Bank of Japan, Inc. 1,125 % fällig am 28.04.2023	€ 800	910	0,26
Mulcair Securities DAC 0,489 % fällig am 24.04.2071	145	145	0,04	CVC Cordatus Loan Fund Ltd. 0,970 % fällig am 22.04.2030	2.000	2.000	0,57	Export-Import Bank of China 0,300 % fällig am 06.03.2022	€ 2.000	2.011	0,57
Oncilla Mortgage Funding PLC 1,435 % fällig am 12.12.2043	£ 340	381	0,11	Driver Espana Four 0,000 % fällig am 21.04.2028	30	30	0,01	Israel Government International Bond 0,000 % fällig am 22.07.2022 (b)	1.300	1.305	0,37
Polaris PLC 1,301 % fällig am 27.05.2057	687	770	0,22	Dryden Euro CLO BV 0,880 % fällig am 15.01.2030	3.500	3.501	1,00	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,500 % fällig am 01.02.2026	5.000	5.129	1,46
Residential Mortgage Securities PLC 1,304 % fällig am 20.06.2070	662	744	0,21	Elm Park CLO DAC 0,620 % fällig am 16.04.2029	382	383	0,11	1,400 % fällig am 26.05.2025 (d)	17.299	18.317	5,22
Ripon Mortgages PLC 0,851 % fällig am 20.08.2056	716	800	0,23	Fair Oaks Loan Funding DAC 1,900 % fällig am 15.07.2031	900	906	0,26	Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	€ 700	581	0,17
SapphireOne Mortgages FCT 0,002 % fällig am 27.06.2061	€ 2.117	2.120	0,60	GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 1,550 % fällig am 20.07.2031	400	401	0,11	South Korea Government International Bond 0,000 % fällig am 16.09.2025 (b)	€ 500	506	0,15
Storm BV 0,073 % fällig am 22.05.2064	1.700	1.710	0,49	Grosvenor Place CLO BV 0,720 % fällig am 30.10.2029	485	484	0,14	Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	5.900	6.598	1,88
Stratton Mortgage Funding PLC 0,954 % fällig am 12.03.2052	£ 774	858	0,24	Halcyon Loan Advisors European Funding DAC 0,770 % fällig am 18.01.2031	200	199	0,06				
Towd Point Mortgage Funding PLC 0,955 % fällig am 20.05.2045	868	970	0,28	Hayfin Emerald CLO DAC 1,450 % fällig am 15.02.2033	600	603	0,17	<b>AKTIEN</b>			
Tudor Rose Mortgages PLC 1,303 % fällig am 20.06.2048	479	536	0,15	Jubilee CLO BV 0,334 % fällig am 12.07.2028	392	390	0,11	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>			
Twin Bridges PLC 0,000 % fällig am 14.12.2054	596	671	0,19	Mackay Shields Euro CLO DAC 1,550 % fällig am 15.08.2033	500	504	0,14	Nationwide Building Society 10,250 %	4.500	891	0,25
		23.817	6,79	Palmer Square European Loan Funding DAC 1,150 % fällig am 15.01.2030	700	702	0,20				
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>								<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
ALME Loan Funding DAC 0,750 % fällig am 15.01.2031	€ 300	298	0,08	Purple Master Credit Cards 0,127 % fällig am 25.05.2034	600	606	0,17	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
Arbour CLO DAC 0,580 % fällig am 15.03.2029 0,870 % fällig am 15.01.2030	712 3.000	711 3.001	0,20 0,86	Silver Arrow S.A. 0,146 % fällig am 15.02.2027 0,164 % fällig am 20.11.2030	310 638	313 640	0,09 0,18	(0,186) % fällig am 06.01.2021 (b)(c)	¥ 370.000	2.929	0,84
Aurium CLO DAC 0,670 % fällig am 16.04.2030	200	199	0,06	Tikehau CLO BV 0,880 % fällig am 07.12.2029	1.900	1.899	0,54	Summe kurzfristige Instrumente		2.929	0,84
Bavarian Sky S.A. 0,118 % fällig am 20.05.2027	404	407	0,12	Toro European CLO DAC 0,650 % fällig am 15.04.2030 0,900 % fällig am 15.10.2030	2.700 1.400	2.696 1.400	0,77 0,40	Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 359.007	102,36	
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	652	653	0,19	Turbo Finance 9 PLC 0,883 % fällig am 20.08.2028	£ 600	671	0,19	<b>AKTIEN</b>			
BlueMountain Fuji Euro CLO DAC 0,910 % fällig am 15.01.2033	800	799	0,23	Vendome Funding CLO DAC 1,860 % fällig am 20.07.2031	€ 700	702	0,20	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
BNPP AM Euro CLO BV 0,650 % fällig am 15.10.2031	300	299	0,08					<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
								PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	347.300	34.027	9,70
								Summe Investmentfonds	€ 34.027	9,70	

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 327	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	€ (273)	€ 267	€ 267	0,08
RYL	(2,500)	31.12.2020	04.01.2021	€ 6.500	Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2027	(6.496)	6.500	6.500	1,85
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>€ (6.769)</b>	<b>€ 6.767</b>	<b>€ 6.767</b>	<b>1,93</b>

(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 135,750 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond February 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Short	01.2021	54	€ 5	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 136,000 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Short	02.2021	55	5	0,00
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2021	179	(23)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2021	133	(59)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	197	(15)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	38	(17)	(0,01)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2021	913	98	0,03
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2021	324	(61)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	210	41	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	152	(31)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	56	24	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	1	1	0,00
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	36	(61)	(0,02)
				€ (93)	(0,03)
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>€ (93)</b>	<b>(0,03)</b>

<sup>(1)</sup> 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
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,394 %	21.11.2023	\$ 12.500	€ (10)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2051	€ 1.200	26	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,193	23.06.2035	2.900	34	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,490	24.01.2033	4.600	231	0,06
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.03.2023	26.700	(33)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2023	68.200	47	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	12.300	(2)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,590	24.01.2034	4.600	242	0,07
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,610	22.01.2051	1.550	47	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,640	24.01.2052	1.750	298	0,08
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	16.06.2031	£ 2.400	19	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051	300	(6)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,330	15.01.2025	14.600	350	0,10
Zahlung	UKRPI	3,473	15.08.2025	1.600	26	0,01
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	4.800	130	0,04
					€ 1.399	0,40
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>€ 1.399</b>	<b>0,40</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
HUS	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,315	07.01.2021	6.200	€ 65	€ 1	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,100 %	22.11.2021	2.900	€ 133	€ 117	0,03
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,195	02.11.2022	1.150	1	64	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	1.340	86	75	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	1.100	103	99	0,03
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	760	48	42	0,01
GLM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,100	22.11.2021	2.100	99	85	0,03
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	900	82	81	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,344	17.11.2022	29.500	28	40	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,200	15.03.2021	1.100	0	82	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	1.100	69	62	0,02
							€ 649	€ 747	0,21

# Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONEN AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450 %	20.01.2021	3.500	€ (3)	€ (2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	5.400	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	1.300	(2)	(1)	0,00
BPS	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	1.400	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	300	0	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	1.300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	2.200	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	3.500	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	3.500	(3)	(3)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	1.900	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	1.900	(2)	(3)	0,00
	BRC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	2.400	(3)	(1)
Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Kauf	0,375	21.04.2021	4.800	(2)	(2)	0,00
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,750	21.04.2021	4.800	(7)	(7)	(0,01)
DUB	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	400	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	2.100	(3)	0	0,00
FBF	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.200	(2)	(1)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	200	0	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	3.400	(2)	(2)	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	3.400	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	1.500	(2)	0	0,00
MYC	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	1.600	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	1.600	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
						€ (56)	€ (36)	(0,01)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,490 %	20.01.2023	8.400	€ (313)	€ (568)	(0,16)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,590	22.01.2024	4.200	(158)	(313)	(0,09)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,610	20.01.2021	1.500	(80)	(293)	(0,08)
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,640	20.01.2022	1.500	(115)	(318)	(0,09)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	3.500	0	(60)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	4.040	(84)	(70)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	3.300	(101)	(99)	(0,03)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,200	22.11.2021	2.900	(94)	(93)	(0,03)
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,550	22.11.2021	2.900	(36)	(32)	(0,01)
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	2.260	(47)	(39)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,065	19.06.2025	6.600	(249)	(222)	(0,06)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,610	20.01.2021	1.500	(126)	(293)	(0,08)
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,640	20.01.2022	1.500	(161)	(318)	(0,09)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	24.500	(32)	(27)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,590	22.01.2024	4.200	(206)	(312)	(0,09)
JPM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	500	(19)	(3)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,200	22.11.2021	2.100	(66)	(68)	(0,02)
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,550	22.11.2021	2.100	(26)	(23)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	2.700	(80)	(81)	(0,02)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	300	(11)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	3.300	(69)	(57)	(0,02)
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	17.02.2021	500	(14)	(3)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,100	15.03.2021	2.200	0	(32)	(0,01)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,100	15.03.2021	2.200	0	(32)	(0,01)
						€ (2.087)	€ (3.326)	(0,95)	

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 101,563	07.01.2021	1.300	€ (4)	€ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	101,672	07.01.2021	2.200	(6)	0	0,00
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,906	11.03.2021	600	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2050	103,367	14.01.2021	1.400	(5)	0	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	1.700	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	700	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	600	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	600	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,188	04.02.2021	800	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,266	04.02.2021	900	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	700	(2)	(1)	0,00
						€ (28)	€ (15)

<sup>(1)</sup> 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	02.2021	DKK 1.500	€ 202	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
BPS	01.2021	€ 1.713	AUD 2.779	40	0	40	0,01
	01.2021	411	£ 373	6	0	6	0,00
	01.2021	1.732	¥ 219.000	2	0	2	0,00
	01.2021	1.706	NOK 18.205	32	0	32	0,01
	01.2021	3.439	\$ 4.209	1	0	1	0,00
BRC	02.2021	DKK 88.932	€ 11.950	3	0	3	0,00
	01.2021	£ 152	168	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	¥ 370.000	3.006	77	0	77	0,02
	01.2021	\$ 12.826	10.499	17	0	17	0,01
CBK	03.2021	734	MXN 14.998	10	0	10	0,00
DUB	06.2021	MXN 13.750	\$ 651	0	(21)	(21)	(0,01)
GLM	01.2021	£ 18.603	€ 20.838	56	0	56	0,02
	02.2021	DKK 48.562	€ 6.526	3	0	3	0,00
	02.2021	€ 2.271	DKK 16.900	0	(1)	(1)	0,00
HUS	02.2021	DKK 530.405	€ 71.267	13	0	13	0,01
	03.2021	\$ 4.185	CNH 27.565	31	0	31	0,01
MYI	02.2021	DKK 3.010	€ 404	0	0	0	0,00
RBC	01.2021	£ 83	91	0	(2)	(2)	0,00
RYL	01.2021	€ 401	\$ 488	0	(2)	(2)	0,00
	03.2021	MXN 13.750	682	0	(2)	(2)	0,00
	06.2021	\$ 676	MXN 13.750	1	0	1	0,00
SCX	01.2021	24.379	€ 20.357	431	0	431	0,12
	02.2021	24.924	20.357	0	0	0	0,00
				€ 723	€ (30)	€ 693	0,20
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ (1.936)	(0,55)
Summe Anlagen						€ 399.171	113,81
Sonstige Aktiva und Passiva						€ (48.422)	(13,81)
Nettovermögen						€ 350.749	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 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 1.042 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von EUR 2.210 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von EUR 1.152 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(93)	(536)	(1)	(630)
Summen	€ (93)	€ 397.493	€ 1.771	€ 399.171

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	€ 330.193	€ 0	€ 330.193
Investmentfonds	32.873	0	0	32.873
Pensionsgeschäfte	0	219	0	219
Einlagen bei Kreditinstituten	0	892	0	892
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	403	152	0	555
Summen	€ 33.276	€ 331.456	€ 0	€ 364.732

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

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

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

# Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.) 31. Dezember 2020

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
CFR	(0,950) %	04.11.2020	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.022)	€ (1.020)	(0,29)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>€ (1.020)</b>	<b>(0,29)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	€ (1.496)	€ 940	€ (556)
BPS	73	0	73
BRC	(748)	212	(536)
CBK	10	0	10
DUB	(21)	0	(21)
FBF	(1)	0	(1)
GLM	(290)	(114)	(404)
GST	(5)	0	(5)
HUS	45	0	45
JPM	(17)	0	(17)
MYC	88	0	88
RBC	(2)	0	(2)
RYL	(3)	0	(3)
SCX	431	(450)	(19)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	85,37	92,67
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	16,48	0,81
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,51	0,00
Investmentfonds	9,70	9,31
Pensionsgeschäfte	1,93	0,06
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	0,11
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,40	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,55)	0,04
Einlagenzertifikate	k. A.	0,25
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,29)	(4,55)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	55,96	67,14
US-Regierungsbehörden	14,99	k. A.
US-Schatzobligationen	2,50	k. A.
Non-Agency-MBS	6,79	9,22
Forderungsbesicherte Wertpapiere	9,80	7,66
Staatsemissionen	11,23	6,04
Vorzugswertpapiere	0,25	k. A.
Kurzfristige Instrumente	0,84	3,42
Investmentfonds	9,70	9,31
Pensionsgeschäfte	1,93	0,06
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,03)	0,12
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,40	k. A.
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	0,21	k. A.
Verkaufsoptionen		
Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,95)	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,20	0,05
Einlagenzertifikate	k. A.	0,25
Sonstige Aktiva und Passiva	(13,81)	(3,25)
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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>0,40 % fällig am 10.04.2027</b>			
<b>ARGENTINIEN</b>				<b>Real Estate Asset Liquidity Trust</b>				<b>CNY 19.500 \$ 3.079 0,59</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>3,072 % fällig am 12.08.2053</b>				<b>CAD 513 \$ 415 0,08</b>			
<b>Pan American Energy LLC</b>				<b>Summe Kanada</b>				<b>Summe China</b>			
38,606 % fällig am 28.02.2021	ARS	1.621	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>9,511 1,81</b>			
YPF S.A.				<b>Canadian Government Real Return Bond</b>				<b>KOLUMBIEN</b>			
38,259 % fällig am 04.03.2021		2.430	0,01	<b>1,500 % fällig am 01.12.2044 (f)</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				<b>2,260 2,555 0,49</b>				<b>Ecopetrol S.A.</b>			
		28	0,01	<b>Summe Cayman Inseln</b>				<b>5,875 % fällig am 28.05.2045</b>			
				<b>4,093 0,78</b>				<b>\$ 1.100 1,334 0,25</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>CAYMAN INSELN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Angolan Government International Bond</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>Colombian TES</b>			
0,125 % fällig am 09.07.2030	\$	139	0,01	<b>Evans Grove CLO Ltd.</b>				<b>5,750 % fällig am 03.11.2027</b>			
0,125 % fällig am 09.07.2035		91	0,01	<b>1,144 % fällig am 28.05.2028</b>				<b>6,000 % fällig am 28.04.2028</b>			
Argentina Government International Bond				<b>\$ 423 421 0,08</b>				<b>2,280.000 176 0,03</b>			
0,125 % fällig am 09.07.2030				<b>Gallatin CLO Ltd.</b>				<b>0,14</b>			
1,000 % fällig am 09.07.2029				<b>1,259 % fällig am 21.01.2028</b>				<b>889 0,17</b>			
36,174 % fällig am 03.04.2022	ARS	3.880	0,00	<b>947 943 0,18</b>				<b>Summe Kolumbien</b>			
				<b>1,596 % fällig am 22.10.2031</b>				<b>2,223 0,42</b>			
		162	0,03	<b>1,200 1,202 0,23</b>				<b>TSCHHECHISCHE REPUBLIK</b>			
		190	0,04	<b>1,682 1,677 0,32</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Summe Argentinien				<b>Mountain View CLO Ltd.</b>				<b>Czech Republic Government International Bond</b>			
				<b>1,037 % fällig am 15.10.2026</b>				<b>0,950 % fällig am 15.05.2030</b>			
				<b>1,200 1,201 0,23</b>				<b>CZK 12.100 550 0,10</b>			
				<b>1,338 % fällig am 20.07.2029</b>				<b>DÄNEMARK</b>			
				<b>1,200 1,201 0,23</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				<b>OZLM Ltd.</b>				<b>Jyske Realkredit A/S</b>			
				<b>1,264 % fällig am 30.04.2027</b>				<b>1,000 % fällig am 01.10.2050</b>			
				<b>1,528 1,526 0,29</b>				<b>1,500 % fällig am 01.10.2050</b>			
				<b>Venture CLO Ltd.</b>				<b>DKK 21.097 3,516 0,67</b>			
				<b>1,117 % fällig am 15.04.2027</b>				<b>2,496 422 0,08</b>			
				<b>369 367 0,07</b>				<b>Nordea Kredit Realkreditaktieselskab</b>			
				<b>WhiteHorse Ltd.</b>				<b>1,000 % fällig am 01.10.2050</b>			
				<b>1,148 % fällig am 17.04.2027</b>				<b>1,500 % fällig am 01.10.2050</b>			
				<b>123 123 0,02</b>				<b>37,948 6,311 1,20</b>			
				<b>7,591 1,45</b>				<b>9,365 1,582 0,30</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Nykredit Realkredit A/S</b>			
				<b>CIFI Holdings Group Co. Ltd.</b>				<b>1,000 % fällig am 01.10.2050</b>			
				<b>7,625 % fällig am 28.02.2023</b>				<b>1,500 % fällig am 01.10.2050</b>			
				<b>200 210 0,04</b>				<b>44,927 7,460 1,42</b>			
				<b>Country Garden Holdings Co. Ltd.</b>				<b>8,208 1,387 0,27</b>			
				<b>7,125 % fällig am 25.04.2022</b>				<b>Summe Dänemark</b>			
				<b>200 208 0,04</b>				<b>20,678 3,94</b>			
				<b>Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.</b>				<b>FRANKREICH</b>			
				<b>6,720 % fällig am 01.12.2022 ^</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				<b>260 246 0,05</b>				<b>Auchan Holding S.A.</b>			
				<b>Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. (6,720 % bar und 1,000 % PIK)</b>				<b>2,875 % fällig am 29.01.2026</b>			
				<b>1,929 270 0,05</b>				<b>€ 400 543 0,10</b>			
				<b>7,720 % fällig am 01.12.2026 ^c)</b>				<b>BNP Paribas S.A.</b>			
				<b>1,214 % fällig am 02.05.2022</b>				<b>1,904 % fällig am 30.09.2028</b>			
				<b>1,310 % fällig am 12.02.2022</b>				<b>\$ 1.900 1,935 0,37</b>			
				<b>1,800 1,807 0,34</b>				<b>€ 300 462 0,09</b>			
				<b>7,500 7,528 1,44</b>				<b>Credit Agricole S.A.</b>			
				<b>Sands China Ltd.</b>				<b>3,750 % fällig am 24.04.2023</b>			
				<b>3,800 % fällig am 08.01.2026</b>				<b>\$ 500 537 0,10</b>			
				<b>200 214 0,04</b>				<b>Danone S.A.</b>			
				<b>4,600 % fällig am 08.08.2023</b>				<b>2,077 % fällig am 02.11.2021</b>			
				<b>200 213 0,04</b>				<b>1,300 1,316 0,25</b>			
				<b>5,125 % fällig am 08.08.2025</b>				<b>Societe Generale S.A.</b>			
				<b>400 450 0,08</b>				<b>1,488 % fällig am 14.12.2026</b>			
				<b>Summe Cayman Inseln</b>				<b>3,700 3,737 0,71</b>			
				<b>400 411 0,08</b>				<b>Teleperformance</b>			
				<b>11,557 2,20</b>				<b>1,875 % fällig am 02.07.2025</b>			
				<b>19,148 3,65</b>				<b>€ 300 395 0,08</b>			
				<b>CHILE</b>				<b>8,925 1,70</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				<b>Banco Santander Chile</b>				<b>France Government International Bond</b>			
				<b>1,100 1,166 0,22</b>				<b>0,250 % fällig am 25.07.2024 (f)(j)</b>			
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>1,593 2,078 0,40</b>			
				<b>Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos</b>				<b>0,750 % fällig am 25.05.2052</b>			
				<b>4,500 % fällig am 01.03.2026</b>				<b>250 341 0,07</b>			
				<b>1,809 0,35</b>				<b>3,800 6,201 1,18</b>			
				<b>Summe Chile</b>				<b>200 423 0,08</b>			
				<b>2,975 0,57</b>				<b>9,043 1,73</b>			
				<b>CHINA</b>				<b>Summe Frankreich</b>			
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>17,968 3,43</b>			
				<b>CNPC Global Capital Ltd.</b>				<b>DEUTSCHLAND</b>			
				<b>1,350 % fällig am 23.06.2025</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				<b>\$ 500 500 0,09</b>				<b>Deutsche Bank AG</b>			
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>0,050 % fällig am 20.11.2024</b>			
				<b>China Development Bank</b>				<b>3,800 4,705 0,90</b>			
				<b>3,340 % fällig am 14.07.2025</b>				<b>1,000 % fällig am 19.11.2025</b>			
				<b>CNY 19.800 3,044 0,58</b>				<b>400 497 0,09</b>			
				<b>3,450 % fällig am 20.09.2029</b>				<b>1,375 % fällig am 03.09.2026</b>			
				<b>5,500 830 0,16</b>				<b>1,510 % fällig am 04.02.2021</b>			
				<b>6,700 1,016 0,19</b>				<b>\$ 1.750 1,751 0,33</b>			
				<b>6,800 1,042 0,20</b>				<b>€ 500 613 0,12</b>			
				<b>Summe China</b>				<b>1,625 % fällig am 12.02.2021</b>			
				<b>19,800 3,044 0,58</b>				<b>1,625 % fällig am 20.01.2027</b>			
				<b>1,750 % fällig am 19.11.2030</b>				<b>1,700 2,175 0,41</b>			
				<b>2,625 % fällig am 12.02.2026</b>				<b>400 515 0,10</b>			
				<b>3,961 % fällig am 26.11.2025</b>				<b>600 806 0,15</b>			
				<b>\$ 600 656 0,13</b>				<b>Summe Deutschland</b>			

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Advantage 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
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK) 3,625 % fällig am 15.05.2025 (c)	€	700	0,17	3,800 % fällig am 13.05.2060 3,875 % fällig am 03.07.2050 4,125 % fällig am 17.01.2048	\$	1.400	0,32	<b>KUWAIT</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>			
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK) 3,875 % fällig am 15.05.2027 (c)		300	0,07	Summe Israel		4.048	0,77	Kuwait International Government Bond 3,500 % fällig am 20.03.2027	\$	5.700	1,24
Volkswagen Bank GmbH 1,250 % fällig am 01.08.2022 2,500 % fällig am 31.07.2026		200 600	0,05 0,16	<b>ITALIEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>LUXEMBURG</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Volkswagen Financial Services AG 0,625 % fällig am 01.04.2022		900	0,21	AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	€	1.000	0,24	Aroundtown S.A. 2,000 % fällig am 02.11.2026	€	500	0,12
Summe Deutschland		15.665	2,99	Banca Carige SpA 0,877 % fällig am 25.02.2021 0,977 % fällig am 25.05.2022 1,189 % fällig am 25.10.2021		1.600 600 800	0,37 0,14 0,19	CPI Property Group S.A. 1,625 % fällig am 23.04.2027 4,750 % fällig am 08.03.2023		700 200	0,17 0,04
<b>HONGKONG</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 0,875 % fällig am 08.10.2027 4,000 % fällig am 10.07.2022		1.600 400	0,40 0,10	Logicor Financing SARL 0,500 % fällig am 30.04.2021 0,750 % fällig am 15.07.2024	€	1.400 600	0,33 0,14
Horse Gallop Finance Ltd. 1,431 % fällig am 28.06.2021	\$	700	0,14	Intesa Sanpaolo SpA 7,000 % fällig am 19.01.2021 (g)(i)		1.000	0,23	SELP Finance SARL 1,250 % fällig am 25.10.2023		1.400	0,34
Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023		400	0,08	UniCredit SpA 2,200 % fällig am 22.07.2027 7,500 % fällig am 03.06.2026 (g)(i)		300 400	0,07 0,11	Miravet SARL 0,322 % fällig am 26.05.2065		700	0,16
Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd. 3,950 % fällig am 05.02.2023		500	0,10	7,830 % fällig am 04.12.2023	\$	1.100	0,25	Summe Luxemburg		6.840	1,30
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 1,757 % fällig am 25.05.2023		500	0,09	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Summe Hongkong		2.124	0,41	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024 (f)(j)	€	20.063	5,24	Summe SARL		700	0,16
<b>UNGARN</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>				Italy Government International Bond 6,000 % fällig am 04.08.2028	£	1.000	0,34	Summe SARL		841	0,16
Hungary Government International Bond 1,750 % fällig am 05.06.2035	€	400	0,10	Summe Italien		40.288	7,68	Summe Malaysia		3.600	0,19
<b>INDIEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>JAPAN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Muthoot Finance Ltd. 6,125 % fällig am 31.10.2022	\$	900	0,18	Central Nippon Expressway Co. Ltd. 0,681 % fällig am 15.02.2022 2,362 % fällig am 28.05.2021 2,567 % fällig am 02.11.2021	\$	1.000 1.000 3.200	0,19 0,19 0,62	Malaysia Government International Bond 4,232 % fällig am 30.06.2031	MYR	3.600	1,012
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,700 % fällig am 27.02.2022		900	0,17	Japan Tobacco, Inc. 2,000 % fällig am 13.04.2021		300	0,06	Summe Malaysia		1.532	0,29
Summe Indien		1.861	0,35	Meiji Yasuda Life Insurance Co. 5,100 % fällig am 26.04.2048		300	0,07	<b>MEXIKO</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>INDONESIEN</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>				Mizuho Financial Group, Inc. 0,693 % fällig am 07.10.2030	€	1.000	0,24	Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 15.03.2115 5,000 % fällig am 27.04.2051	€ \$	1.300 200	1,841 0,249
Indonesia Government International Bond 1,400 % fällig am 30.10.2031	€	1.100	0,26	NTT Finance Corp. 1,900 % fällig am 21.07.2021	\$	700	0,13	Summe Mexiko		2.090	0,40
2,625 % fällig am 14.06.2023		2.700	0,67	ORIX Corp. 3,250 % fällig am 04.12.2024		300	0,06	<b>MULTINATIONAL</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
4,100 % fällig am 24.04.2028	\$	1.700	0,38	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,409 % fällig am 07.11.2029 2,014 % fällig am 07.11.2022	€ \$	1.300 500	0,32 0,10	NXP BV 3,150 % fällig am 01.05.2027		700	0,15
8,375 % fällig am 15.03.2034	IDR22.982.000	1.917	0,37	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,474 % fällig am 08.07.2025		1.000	0,20	Preferred Term Securities Ltd. 0,629 % fällig am 23.06.2035		1.575	0,27
Summe Indonesien		8.797	1,68	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % fällig am 15.10.2027	€	1.000	0,23	Summe multinational		2.221	0,42
<b>IRLAND</b> <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2,050 % fällig am 31.03.2030	\$	800	0,16	<b>NIEDERLANDE</b> <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Aurium CLO DAC 0,680 % fällig am 13.10.2029	€	943	0,22	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Accunia European CLO BV 0,950 % fällig am 15.07.2030	€	600	0,14
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,870 % fällig am 18.01.2030		1.700	0,40	Japan Finance Organization for Municipalities 3,000 % fällig am 12.03.2024 3,375 % fällig am 27.09.2023		200 1.400	0,04 0,29	Barings Euro CLO BV 0,680 % fällig am 27.07.2030		854	0,20
Dorchester Park CLO DAC 1,118 % fällig am 20.04.2028	\$	1.725	0,33	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 (f)(k) 0,100 % fällig am 10.03.2029 (f)(k) 0,100 % fällig am 20.03.2030	¥	724.291 499.505 70.000	7,036 4,862 0,93	Summe Japan		24.829	4,74
Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029	€	1.595	0,37	0,500 % fällig am 20.03.2049 0,700 % fällig am 20.12.2048 1,200 % fällig am 20.09.2035		348.000 116.000 133.000	3,277 1,152 0,28	Airbus SE 2,375 % fällig am 09.06.2040		1.000	1,463
Toro European CLO DAC 0,900 % fällig am 15.10.2030		1.800	0,42	Tokyo Metropolitan Government 2,000 % fällig am 17.05.2021 2,500 % fällig am 08.06.2022 2,625 % fällig am 29.05.2024	\$	1.100 3.000 400	0,21 0,59 0,08	Cooperatieve Rabobank UA 6,625 % fällig am 29.06.2021 (g)(i)		600	0,756
Summe Irland		9.105	1,74	Summe Japan		38.305	7,31	Enel Finance International NV 2,650 % fällig am 10.09.2024	\$	1.200	1,281
<b>ISRAEL</b> <b>STAATSEMISSIONEN</b>								ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026 (g)(i)		200	0,218
Israel Government International Bond 1,750 % fällig am 31.08.2025	ILS	2.100	0,13					JT International Financial Services BV 2,750 % fällig am 28.09.2033	€	200	0,313
2,000 % fällig am 31.03.2027		2.700	0,18					LeasePlan Corp. NV 0,125 % fällig am 13.09.2023	€	700	0,859

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
<b>RUSSLAND</b>				<b>RUSSLAND</b>				<b>SPANIEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % (g)	€ 210	\$ 341	0,07	Russia Government International Bond 4,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 2.200	\$ 2.571	0,49	BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	€ 797	\$ 977	0,18
Syngenta Finance NV 5,182 % fällig am 24.04.2028	\$ 400	429	0,08	4,750 % fällig am 27.05.2026	RUB 9.600	11.106	2,12	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Volkswagen International Finance NV 1,037 % fällig am 16.11.2024	€ 800	1.015	0,19	7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB 137.400	2.097	0,40	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (g)(l)	400	513	0,10
		6.675	1,27	7,700 % fällig am 23.03.2033	252.100	3.841	0,73	6,000 % fällig am 29.03.2024 (g)(l)	600	789	0,15
				Summe Russland		19.615	3,74	8,875 % fällig am 14.04.2021 (g)(l)	800	1.002	0,19
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>SAUDI-ARABIEN</b>				Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 22.07.2025	100	125	0,02
Jubilee Place BV 0,485 % fällig am 17.10.2057	1.000	1.223	0,24	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				1,750 % fällig am 10.05.2024	100	127	0,02
Summe Niederlande		9.676	1,85	Saudi Arabian Oil Co. 1,625 % fällig am 24.11.2025	\$ 400	410	0,08	Banco Santander S.A. 4,379 % fällig am 12.04.2028	\$ 400	467	0,09
<b>NEUSEELAND</b>				2,750 % fällig am 16.04.2022	400	411	0,08	CaixaBank S.A. 1,750 % fällig am 24.10.2023	€ 600	770	0,15
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Saudi-Arabien		821	0,16	5,875 % fällig am 09.10.2027 (g)(l)	600	812	0,16
New Zealand Government International Bond 1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD 800	605	0,11	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Spanien		14.124	2,69
1,750 % fällig am 15.05.2041	200	142	0,03	Saudi Government International Bond 3,250 % fällig am 26.10.2026	2.200	2.441	0,46	<b>SUPRANATIONAL</b>			
Summe Neuseeland		747	0,14	3,625 % fällig am 04.03.2028	1.900	2.133	0,41	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>NORWEGEN</b>				4,375 % fällig am 16.04.2029	1.900	2.260	0,43	Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035	300	497	0,10
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Saudi-Arabien		7.655	1,46	4,900 % fällig am 15.09.2021	1.500	1.900	0,36
DNB Bank ASA 1,127 % fällig am 16.09.2026	\$ 1.100	1.113	0,21	<b>SERBIEN</b>				Spain Government International Bond 1,000 % fällig am 31.10.2050 (j)	700	888	0,17
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				1,250 % fällig am 31.10.2030	2.000	2.736	0,52
Norway Government International Bond 1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK 6.000	735	0,14	Serbia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.05.2027	€ 3.900	5.380	1,03	1,850 % fällig am 30.07.2035 (j)	1.700	2.521	0,48
Summe Norwegen		1.848	0,35	Summe Serbien		5.380	1,03			8.542	1,63
<b>PERU</b>				<b>SINGAPUR</b>				Summe Spanien		14.124	2,69
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>SUPRANATIONAL</b>			
Banco de Credito del Peru 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 1.700	507	0,10	BOC Aviation Ltd. 2,750 % fällig am 18.09.2022	\$ 200	204	0,04	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2035 (d)	900	1.132	0,22
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				3,500 % fällig am 18.09.2027	400	428	0,08	<b>SCHWEIZ</b>			
Peru Government International Bond 1,862 % fällig am 01.12.2032	\$ 300	303	0,06	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 0,672 % fällig am 17.05.2021	1.000	1.001	0,19	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
5,400 % fällig am 12.08.2034	PEN 1.600	489	0,09	PSA Treasury Pte. Ltd. 2,500 % fällig am 12.04.2026	1.000	1.073	0,21	Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)	\$ 1.400	1.580	0,30
5,940 % fällig am 12.02.2029	9.400	3.243	0,62	Summe Singapur		2.706	0,52	Credit Suisse Group AG 1,420 % fällig am 14.12.2023	900	911	0,18
6,150 % fällig am 12.08.2032	1.200	407	0,08	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				3,800 % fällig am 09.06.2023	1.600	1.724	0,33
6,350 % fällig am 12.08.2028	15.100	5.306	1,01	Singapore Government International Bond 2,125 % fällig am 01.06.2026	SGD 1.800	1.476	0,28	UBS Group AG 4,125 % fällig am 24.09.2025	1.200	1.376	0,26
8,200 % fällig am 12.08.2026	2.100	783	0,15	Summe Singapur		4.182	0,80	Summe Schweiz		5.591	1,07
		10.531	2,01	<b>SLOWENIEN</b>				<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>			
Summe Peru		11.038	2,11	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>PHILIPPINEN</b>				Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 400	444	0,08	First Abu Dhabi Bank PJSC 3,000 % fällig am 30.03.2022	1.900	1.961	0,38
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Slowenien		1.696	0,32	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Philippines Government International Bond 6,250 % fällig am 14.01.2036	PHP 21.000	566	0,11	<b>SÜDAFRIKA</b>				Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,125 % fällig am 11.10.2027	2.200	2.471	0,47
<b>PORTUGAL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				3,125 % fällig am 16.04.2030	300	339	0,06
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Slovenia Government International Bond 5,250 % fällig am 18.02.2024	\$ 1.089	1.252	0,24	3,875 % fällig am 16.04.2050	200	244	0,05
Banco Espirito Santo S.A. 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	€ 1.900	360	0,07	Summe Slowenien		1.696	0,32	Summe Vereinigte Arabische Emirate		5.015	0,96
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	600	114	0,02	<b>SÜDAFRIKA</b>				<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
Summe Portugal		474	0,09	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
<b>KATAR</b>				South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029	600	639	0,12	Bumper UK Finance PLC 0,653 % fällig am 20.12.2028	£ 1.103	1.508	0,29
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				5,375 % fällig am 24.07.2044	500	491	0,10	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Qatar Government International Bond 3,750 % fällig am 16.04.2030	\$ 1.000	1.179	0,22	Summe Südafrika		1.130	0,22	Antofagasta PLC 2,375 % fällig am 14.10.2030	\$ 400	402	0,08
4,400 % fällig am 16.04.2050	200	261	0,05	<b>SÜDKOREA</b>				Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022 (i)	4.600	5.119	0,98
4,500 % fällig am 23.04.2028	1.800	2.184	0,42	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.06.2024 (g)(l)	700	781	0,15
4,817 % fällig am 14.03.2049	500	684	0,13	Korea Government International Bond 2,125 % fällig am 10.06.2027	KRW 680.000	652	0,13	FCE Bank PLC 0,869 % fällig am 13.09.2021	€ 500	611	0,12
Summe Katar		4.308	0,82	2,375 % fällig am 10.12.2028	2.960.000	2.882	0,55	1,660 % fällig am 11.02.2021	500	612	0,12
<b>RUMÄNIEN</b>				5,500 % fällig am 10.03.2028	640.000	749	0,14				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd. 3,750 % fällig am 25.07.2023	\$ 300	324	0,06				
Romania Government International Bond 1,375 % fällig am 02.12.2029	€ 600	748	0,14	Summe Südkorea		4.607	0,88				
1,625 % fällig am 02.12.2040	100	131	0,03								
5,850 % fällig am 26.04.2023	RON 2.900	783	0,15								
Summe Rumänien		1.662	0,32								

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Advantage 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
Frontier Finance PLC 8,000 % fällig am 23.03.2022	£ 1.725	\$ 2.431	0,46	Towd Point Mortgage Funding PLC 0,956 % fällig am 20.07.2045	£ 1.453	\$ 1.986	0,38	0,398 % fällig am 25.03.2037 0,628 % fällig am 25.06.2036	\$ 389	\$ 1.150	0,22
HSBC Holdings PLC 1,220 % fällig am 18.05.2024 4,583 % fällig am 19.06.2029 4,750 % fällig am 04.07.2029 (g)(i)	\$ 800 1.000 € 400	806 1.184 547	0,15 0,22 0,10	Tower Bridge Funding PLC 1,425 % fällig am 20.09.2063	600	824	0,16	New Century Home Equity Loan Trust 0,868 % fällig am 25.03.2035	167	161	0,03
Lloyds Bank PLC 4,875 % fällig am 30.03.2027 5,125 % fällig am 07.03.2025	£ 1.400 300	2.440 493	0,46 0,09	Uropa Securities PLC 0,238 % fällig am 10.06.2059 0,388 % fällig am 10.06.2059 0,588 % fällig am 10.06.2059 0,788 % fällig am 10.06.2059	288 75 58 62	379 95 71 78	0,07 0,02 0,01 0,01	NovaStar Mortgage Funding Trust 0,298 % fällig am 25.09.2036	238	142	0,03
Lloyds Banking Group PLC 3,900 % fällig am 12.03.2024 4,582 % fällig am 10.12.2025 4,650 % fällig am 24.03.2026 7,625 % fällig am 27.06.2023 (g)(i)	\$ 300 1.100 400 € 300	330 1.260 461 452	0,06 0,24 0,09 0,09	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				Option One Mortgage Loan Trust 0,288 % fällig am 25.03.2037	462	428	0,08
Marks & Spencer PLC 4,250 % fällig am 08.12.2023	500	718	0,14	Nationwide Building Society 10,250 %	2.030	491	0,09	RAAC Trust 1,648 % fällig am 25.09.2047	500	524	0,10
Nationwide Building Society 2,000 % fällig am 27.01.2023 3,960 % fällig am 18.07.2030 4,302 % fällig am 08.03.2029	\$ 300 1.400 1.200	310 1.633 1.396	0,06 0,31 0,27	<b>AKTIEN</b>				Residential Asset Mortgage Products Trust 0,788 % fällig am 25.01.2036	519	486	0,09
Natwest Group PLC 3,875 % fällig am 12.09.2023 4,269 % fällig am 22.03.2025 5,076 % fällig am 27.01.2030 5,125 % fällig am 12.05.2027 (g)(i) 6,000 % fällig am 29.12.2025 (g)(i) 8,000 % fällig am 10.08.2025 (g)(i)	400 200 1.100 € 800 \$ 700 300	434 221 1.353 1.146 768 350	0,08 0,04 0,26 0,22 0,15 0,07	<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				Residential Asset Securities Corp. Trust 0,298 % fällig am 25.01.2037 0,398 % fällig am 25.04.2037 0,418 % fällig am 25.05.2037 0,708 % fällig am 25.04.2036	94 229 31 170	93 228 31 168	0,02 0,04 0,01 0,03
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 2,375 % fällig am 24.06.2022	900	926	0,18	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2024 (f)(j)	£ 4.370	6.575	1,25	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 0,648 % fällig am 25.05.2036 0,808 % fällig am 25.08.2035 ^ 1,108 % fällig am 25.01.2036 ^	504 861 58	353 671 51	0,07 0,13 0,01
Santander UK Group Holdings PLC 4,750 % fällig am 15.09.2025 7,375 % fällig am 24.06.2022 (g)(i)	1.100 € 400	1.242 573	0,24 0,11	USA				SMB Private Education Loan Trust 0,000 % fällig am 15.07.2053 1,290 % fällig am 15.07.2053	274 912	276 916	0,05 0,17
Standard Chartered PLC 1,319 % fällig am 14.10.2023	\$ 1.300	1.315	0,25	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Soundview Home Loan Trust 0,428 % fällig am 25.05.2036	996	989	0,19
Tesco PLC 6,125 % fällig am 24.02.2022	€ 50	73	0,01	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,428 % fällig am 25.07.2036 0,748 % fällig am 25.02.2036 0,808 % fällig am 25.11.2035	\$ 123 498 562	107 495 565	0,02 0,09 0,11	Structured Asset Investment Loan Trust 0,298 % fällig am 25.09.2036 0,768 % fällig am 25.01.2036 1,198 % fällig am 25.08.2033	81 2.923 18	79 2.683 17	0,01 0,51 0,00
Tesco Property Finance PLC 5,801 % fällig am 13.10.2040	583	1.102	0,21	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 0,348 % fällig am 25.12.2036 3,208 % fällig am 25.07.2036	322 60	322 60	0,06 0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Carrington Mortgage Loan Trust 0,368 % fällig am 25.01.2037	1.100	829	0,16	AbbVie, Inc. 3,850 % fällig am 15.06.2024 5,000 % fällig am 15.12.2021	1.000 400	1.102 413	0,21 0,08
Alba PLC 0,207 % fällig am 17.03.2039	1.246	1.636	0,31	Citigroup Mortgage Loan Trust 0,668 % fällig am 25.03.2036 4,400 % fällig am 25.10.2037	1.605 781	1.538 826	0,29 0,16	Aetna, Inc. 2,800 % fällig am 15.06.2023	800	842	0,16
Avon Finance No. 2 PLC 0,954 % fällig am 20.09.2048	875	1.195	0,23	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 0,763 % fällig am 25.10.2035	184	190	0,04	American Tower Corp. 3,800 % fällig am 15.08.2029	500	582	0,11
Canada Square Funding PLC 1,156 % fällig am 17.10.2051	723	989	0,19	Countrywide Asset-Backed Certificates 0,288 % fällig am 25.08.2037 ^ 0,288 % fällig am 25.06.2047 ^ 0,308 % fällig am 25.12.2035 ^ 0,318 % fällig am 25.06.2047 ^ 0,348 % fällig am 25.06.2047 ^ 0,468 % fällig am 25.05.2036 0,668 % fällig am 25.12.2036 ^	1.076 326 197 11 1.263 266 4.605	990 303 196 11 1.158 266 4.479	0,19 0,06 0,04 0,00 0,22 0,05 0,85	AT&T, Inc. 1,800 % fällig am 05.09.2026 2,250 % fällig am 01.02.2032 3,100 % fällig am 01.02.2043 3,300 % fällig am 01.02.2052	€ 500 \$ 200 200 200	667 203 204 199	0,13 0,04 0,04 0,04
Eurosaill PLC 0,000 % fällig am 13.03.2045 0,191 % fällig am 13.03.2045	€ 96 £ 545	117 733	0,02 0,14	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 1,243 % fällig am 25.05.2035	316	314	0,06	Bayer U.S. Finance LLC 0,881 % fällig am 25.06.2021 1,227 % fällig am 15.12.2023 4,250 % fällig am 15.12.2025 4,375 % fällig am 15.12.2028	300 900 400 400	301 910 458 471	0,06 0,17 0,09 0,09
Finsbury Square PLC 0,000 % fällig am 16.06.2070	948	1.305	0,25	First Franklin Mortgage Loan Trust 0,868 % fällig am 25.11.2035	150	143	0,03	Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026 3,250 % fällig am 01.02.2028	1.000 200	1.052 215	0,20 0,04
Great Hall Mortgages PLC 0,167 % fällig am 18.03.2039 0,177 % fällig am 18.06.2039 0,366 % fällig am 18.06.2039	63 494 \$ 337	85 661 329	0,02 0,13 0,06	First NLC Trust 0,218 % fällig am 25.08.2037	478	299	0,06	Campbell Soup Co. 3,300 % fällig am 15.03.2021 3,650 % fällig am 15.03.2023	300 172	302 184	0,06 0,03
Hawksmoor Mortgages PLC 1,104 % fällig am 25.05.2053	£ 1.522	2.084	0,40	GSAMP Trust 0,298 % fällig am 25.12.2046 0,378 % fällig am 25.12.2046 0,388 % fällig am 25.09.2036	228 114 3.509	148 75 1.731	0,03 0,01 0,33	CenterPoint Energy Resources Corp. 3,550 % fällig am 01.04.2023	200	213	0,04
Jupiter Mortgage Ltd. 1,000 % fällig am 01.06.2060 (b)	1.900	2.575	0,49	Home Equity Asset Trust 1,243 % fällig am 25.05.2035	1.144	1.143	0,22	Charter Communications Operating LLC 2,300 % fällig am 01.02.2032 5,125 % fällig am 01.07.2049	1.600 500	1.603 611	0,31 0,12
Oncilla Mortgage Funding PLC 1,435 % fällig am 12.12.2043	1.263	1.730	0,33	HSI Asset Securitization Corp. Trust 0,488 % fällig am 25.12.2036 0,763 % fällig am 25.01.2036	224 2.300	91 2.245	0,02 0,43	Citigroup, Inc. 3,142 % fällig am 24.01.2023	200	206	0,04
Paragon Mortgages PLC 1,105 % fällig am 15.05.2045	883	1.212	0,23	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,418 % fällig am 25.04.2036	142	141	0,03	CRH America Finance, Inc. 4,500 % fällig am 04.04.2048	300	379	0,07
Resloc UK PLC 0,203 % fällig am 15.12.2043	678	885	0,17	Lehman XS Trust 0,948 % fällig am 25.10.2035	165	165	0,03	CVS Health Corp. 3,350 % fällig am 09.03.2021 3,700 % fällig am 09.03.2023	107 82	108 88	0,02 0,02
Ripon Mortgages PLC 0,851 % fällig am 20.08.2056	977	1.335	0,25	Long Beach Mortgage Loan Trust 0,793 % fällig am 25.11.2035	208	206	0,04	Daimler Finance North America LLC 3,875 % fällig am 15.09.2021	1.100	1.127	0,21
RMAC PLC 0,741 % fällig am 12.06.2046 1,011 % fällig am 12.06.2046	1.011 1.052	1.374 1.438	0,26 0,27	Massachusetts Educational Financing Authority 1,165 % fällig am 25.04.2038	63	63	0,01	Dell International LLC 5,850 % fällig am 15.07.2025	300	361	0,07
RMAC Securities PLC 0,211 % fällig am 12.06.2044	775	1.024	0,20	MASTR Asset-Backed Securities Trust 0,358 % fällig am 25.05.2037 0,448 % fällig am 25.08.2036 0,628 % fällig am 25.06.2036	545 334 4.444	525 182 2.596	0,10 0,03 0,50	Emera U.S. Finance LP 2,700 % fällig am 15.06.2021	500	504	0,10
Rochester Financing PLC 1,337 % fällig am 18.06.2045	869	1.189	0,23	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,278 % fällig am 25.10.2036 0,278 % fällig am 25.01.2037	907 2.291	849 1.395	0,16 0,27	Energy Transfer Operating LP 5,250 % fällig am 15.04.2029	400	467	0,09
Stratton Mortgage Funding PLC 0,954 % fällig am 12.03.2052	870	1.181	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
<b>Equitable Holdings, Inc.</b>				<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
3,900 % fällig am 20.04.2023	\$ 100	\$ 108	0,02	American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010	\$ 1.300	\$ 1.650	0,31	2.500 % fällig am 01.11.2050	697	742	0,14
4,350 % fällig am 20.04.2028	300	355	0,07	7,334 % fällig am 15.02.2028				3,000 % fällig am 01.10.2042 - 01.03.2060	2.899	3.133	0,60
<b>Fidelity National Information Services, Inc.</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>							
0,750 % fällig am 21.05.2023	€ 500	624	0,12	Banc of America Funding Trust	73	67	0,01	3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.01.2059	5.536	5.999	1,14
<b>Fiserv, Inc.</b>				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>							
2,750 % fällig am 01.07.2024	\$ 1.000	1.074	0,20	Chase Mortgage Finance Trust	64	58	0,01	4,000 % fällig am 01.09.2040 - 01.06.2050	2.494	2.679	0,51
<b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>				<b>U.S. Treasury Bonds</b>							
0,000 % fällig am 01.12.2021	€ 1.100	1.334	0,25	3,276 % fällig am 25.07.2037				1,375 % fällig am 15.11.2040	4.300	4.253	0,81
0,000 % fällig am 07.12.2022	300	355	0,07	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.	48	49	0,01	1,625 % fällig am 15.11.2050	2.700	2.690	0,51
1,744 % fällig am 19.07.2024	100	122	0,02	3,378 % fällig am 25.05.2035				<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)</b>			
2,748 % fällig am 14.06.2024	€ 100	137	0,03	Countrywide Alternative Loan Trust	31	26	0,01	0,125 % fällig am 15.04.2022 (j)	3.962	4.045	0,77
3,021 % fällig am 06.03.2024	€ 400	508	0,10	0,572 % fällig am 20.03.2046	35	29	0,01	0,125 % fällig am 15.07.2022 (j)	4.529	4.670	0,89
3,375 % fällig am 13.11.2025	\$ 500	514	0,10	0,572 % fällig am 20.05.2046 ^	486	340	0,06	0,125 % fällig am 15.07.2030	1.726	1.939	0,37
5,750 % fällig am 01.02.2021	400	402	0,08	6,000 % fällig am 25.03.2036 ^	216	132	0,03	0,250 % fällig am 15.02.2050	1.722	2.057	0,39
<b>GATX Corp.</b>				<b>Residential Asset Securitization Trust</b>							
0,945 % fällig am 05.11.2021	400	401	0,08	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust	359	344	0,07	0,750 % fällig am 15.07.2028	1.763	2.052	0,39
<b>General Motors Financial Co., Inc.</b>				<b>Sequoia Mortgage Trust</b>							
0,009 % fällig am 26.03.2022	€ 100	122	0,02	GSR Mortgage Loan Trust	233	233	0,04	1,000 % fällig am 15.02.2048 (j)	1.901	2.651	0,51
1,080 % fällig am 09.04.2021	\$ 200	200	0,04	5,750 % fällig am 25.02.2036				1,375 % fällig am 15.02.2044	447	645	0,12
3,550 % fällig am 08.07.2022	400	417	0,08	HarborView Mortgage Loan Trust	225	155	0,03	<b>U.S. Treasury Notes</b>			
<b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>				<b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>							
0,041 % fällig am 21.04.2023	€ 700	859	0,16	Lehman XS Trust	283	255	0,05	1,125 % fällig am 30.06.2021	300	301	0,06
2,908 % fällig am 05.06.2023	\$ 500	518	0,10	0,668 % fällig am 25.02.2046 ^				2,625 % fällig am 15.06.2021 (j)	500	506	0,10
4,223 % fällig am 01.05.2029	700	831	0,16	Residential Accredited Loans, Inc. Trust	429	419	0,08	2,875 % fällig am 30.04.2025 (j)	12.700	14.112	2,69
<b>Nissan Motor Acceptance Corp.</b>				<b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>							
0,737 % fällig am 15.03.2021	200	200	0,04	6,000 % fällig am 25.06.2036	389	266	0,05	<b>Summe USA</b>			
<b>ONEOK, Inc.</b>				<b>Residential Asset Securitization Trust</b>							
4,550 % fällig am 15.07.2028	300	344	0,06	6,000 % fällig am 25.09.2036 ^	2	2	0,00	49.742 9,49			
<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>				<b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>							
2,100 % fällig am 01.08.2027	100	102	0,02	0,328 % fällig am 25.07.2046				350.600 66,87			
3,150 % fällig am 01.01.2026	100	107	0,02	0,548 % fällig am 25.05.2036	260	245	0,05	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
3,450 % fällig am 01.07.2025	100	108	0,02	0,568 % fällig am 25.04.2036	26	24	0,00	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
3,950 % fällig am 01.12.2047 ^	100	104	0,02	0,992 % fällig am 19.10.2033	2	2	0,00	(3,480) % fällig am 13.09.2021 (d)(e) ARS 16.592 121 0,02			
4,000 % fällig am 01.12.2046 ^	100	104	0,02	3,134 % fällig am 25.10.2036 ^	83	63	0,01	<b>Summe kurzfristige Instrumente</b>			
4,500 % fällig am 01.07.2040	100	112	0,02	Structured Asset Mortgage Investments Trust	678	585	0,11	121 0,02			
4,550 % fällig am 01.07.2030	100	114	0,02	0,328 % fällig am 25.07.2046	678	585	0,11	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>			
<b>Penske Truck Leasing Co. LP</b>				<b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>							
3,950 % fällig am 10.03.2025	1.400	1.569	0,30	0,438 % fällig am 25.10.2036	632	548	0,10	\$ 766.011 146,11			
<b>RELX Capital, Inc.</b>				<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>							
3,000 % fällig am 22.05.2030	1.000	1.112	0,21	0,708 % fällig am 25.11.2045	187	183	0,03	<b>AKTIEN</b>			
<b>Rio Oil Finance Trust</b>				<b>Structured Asset Securities Corp.</b>							
9,250 % fällig am 06.07.2024	878	975	0,19	2,009 % fällig am 25.06.2042	2	2	0,00	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>Sabine Pass Liquefaction LLC</b>				<b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>							
4,500 % fällig am 15.05.2030	1.100	1.305	0,25	3,153 % fällig am 25.12.2036 ^	94	89	0,02	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
<b>Santander Holdings USA, Inc.</b>				<b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>							
3,400 % fällig am 18.01.2023	800	841	0,16	0,428 % fällig am 25.01.2036	170	154	0,03	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h) 1.424.877 14.195 2,71			
<b>Sempra Energy</b>				<b>Structured Asset Securities Corp.</b>							
0,667 % fällig am 15.03.2021	800	801	0,15	0,438 % fällig am 25.10.2036	632	548	0,10	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h) 446.527 5.800 1,10			
<b>Spirit AeroSystems, Inc.</b>				<b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>							
3,950 % fällig am 15.06.2023	400	393	0,07	0,708 % fällig am 25.11.2045	187	183	0,03	<b>Summe Investmentfonds</b>			
<b>Sprint Spectrum Co. LLC</b>				<b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>							
4,738 % fällig am 20.09.2029	400	434	0,08	2,009 % fällig am 25.06.2042	2	2	0,00	\$ 19.995 3,81			
<b>Wells Fargo &amp; Co.</b>				<b>Structured Asset Securities Corp.</b>							
1,325 % fällig am 24.01.2023	600	605	0,11	3,153 % fällig am 25.12.2036 ^	94	89	0,02	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
1,741 % fällig am 04.05.2030	€ 300	408	0,08	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust	644	667	0,13	CenturyLink, Inc. 2.397 % fällig am 15.03.2027 611 605 0,12			
<b>Zimmer Biomet Holdings, Inc.</b>				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>							
3,150 % fällig am 01.04.2022	\$ 2.100	2.160	0,41	Fannie Mae	31	32	0,01	34.551 6,59			
<b>Summe KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>Fannie Mae</b>							
				0,480 % fällig am 20.12.2062 592 591 0,11							
				3,000 % fällig am 20.07.2046 32 33 0,01							
				3,000 % fällig am 20.05.2047 \$ 29 \$ 29 0,01							
				<b>Ginnie Mae, TBA</b>							
				2,000 % fällig am 01.03.2051 12.100 12.614 2,40							

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 1.298	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (1.324)	\$ 1.298	\$ 1.298	0,25
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (1.324)</b>	<b>\$ 1.298</b>	<b>\$ 1.298</b>	<b>0,25</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Advantage 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
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2021	28	\$ (2)	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	87	55	0,01
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von EUR 113.500 auf Euro-Schatz Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	102	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von EUR 114.400 auf Euro-Schatz Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	300	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 138,750 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	55	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 179,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	56	0	0,00
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	127	(29)	(0,01)
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2021	55	6	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	71	106	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	11	(1)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	6	(3)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	56	(34)	(0,01)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2021	402	42	0,01
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	6	(6)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	181	43	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	1	0	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	26	37	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	9	(37)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	70	(146)	(0,02)
				\$ 31	0,01

<sup>(1)</sup> Future-Style-Option.

### OPTIONSKAUF

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call - CME 90-Day Eurodollar June 2022 Futures	\$ 99,750	13.06.2022	50	\$ 11	\$ 14	0,00
Call - CME 90-Day Eurodollar March 2022 Futures	99,750	14.03.2022	26	6	7	0,00
				\$ 17	\$ 21	0,00
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>					\$ 52	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 – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Kraft Heinz Foods Co.	(1,000) %	20.06.2022	\$ 1.400	\$ 4	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Rolls-Royce PLC	1,000 %	20.12.2024	€ 200	\$ (15)	(0,01)
Shell International Finance BV	1,000	20.12.2026	600	38	0,01
				\$ 23	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	\$ 1.235	\$ (136)	(0,03)
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000)	20.12.2025	1.000	(15)	0,00
CDX.IG-33 10-Year Index	(1,000)	20.12.2029	4.400	(14)	0,00
CDX.IG-34 10-Year Index	(1,000)	20.06.2030	5.600	(11)	0,00
CDX.IG-35 10-Year Index	(1,000)	20.12.2030	19.500	(60)	(0,01)
iTraxx Europe Main 31 10-Year Index	(1,000)	20.06.2029	€ 6.200	(61)	(0,01)
iTraxx Europe Main 32 10-Year Index	(1,000)	20.12.2029	1.600	7	0,00
				\$ (290)	(0,05)

**ZINSSWAPS - BASISSWAPS**

Zahlung variabler Zinssatz- index	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,091 %	18.03.2022	\$ 121.700	\$ (50)	(0,01)
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	12.06.2022	6.600	(2)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,084 %	12.06.2022	9.100	(5)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,085 %	19.06.2022	5.700	(2)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,088 %	06.09.2024	21.300	(3)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,011 %	27.09.2024	10.300	(3)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,010 %	04.10.2024	4.500	(1)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,098 %	02.03.2023	4.600	(4)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	07.03.2024	3.400	0	0,00
				\$ (70)	(0,01)

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,850 %	03.01.2022	BRL 14.700	\$ 0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022	37.500	(3)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	10.700	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,871	03.01.2022	14.600	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,300	03.01.2022	198.500	245	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	12.400	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,280	04.01.2027	1.600	(9)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,880	04.01.2021	13.400	236	0,05
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 6.700	120	0,02
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	2.600	89	0,02
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	7.300	325	0,06
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,750	16.12.2046	1.700	(225)	(0,04)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	6.000	237	0,05
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2029	14.500	972	0,19
Zahlung	3-Month CHF-LIBOR	0,500	16.09.2025	CHF 18.800	84	0,02
Zahlung	3-Month CHF-LIBOR	0,620	18.03.2025	3.750	(34)	(0,01)
Erhalt	3-Month NZD-BBR	0,500	16.12.2025	NZD 450	2	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	2.600	84	0,02
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	3,000	19.09.2028	PLN 2.500	111	0,02
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	56	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,400	30.03.2026	\$ 16.100	3	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,400	15.01.2028	3.500	(27)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022	4.300	3	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,750	30.03.2031	21.100	245	0,05
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	2.900	(4)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	16.100	45	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,249	31.08.2024	9.500	(267)	(0,05)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,250	09.06.2041	4.200	(9)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050	500	(39)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,298	25.08.2024	8.100	(240)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,305	21.08.2023	9.550	(319)	(0,06)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,325	02.12.2050	900	45	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2024	200	(10)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,635	31.08.2051	1.050	56	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,710	17.09.2051	550	38	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,750	18.12.2049	700	75	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,854	15.05.2045	600	64	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.01.2030	12.000	(1.281)	(0,24)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	3.600	(687)	(0,13)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2021	18.700	(174)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	15.03.2022	ZAR 66.400	298	0,06
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,250	15.03.2022	9.600	36	0,01
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 5.700	(57)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2051	€ 1.100	(36)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	16.06.2051	5.800	25	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	200	0	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,060	17.11.2032	1.500	11	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	500	(13)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	17.03.2031	2.800	9	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031	22.200	(32)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035	900	(9)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2023	37.300	32	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2026	10.300	(17)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,310	19.06.2029	4.000	253	0,05
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2023	£ 500	0	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	1.300	(1)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	16.06.2031	9.600	83	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	17.03.2051	200	2	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051	450	(2)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,200	19.06.2029	¥ 790.000	(52)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,400	19.06.2039	280.000	(83)	(0,02)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,500	19.06.2049	60.000	26	0,00

## 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 NOK-NIBOR	1,635 %	18.03.2025	NOK 6.200	\$ (32)	(0,01)
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,993	12.11.2024	4.200	(21)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN 41.500	16	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,070	03.02.2021	5.000	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,715	15.10.2021	20.900	22	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	26.02.2025	10.500	31	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,380	25.02.2025	12.300	43	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,415	25.02.2025	300	1	0,00
Erhalt	UKRPI	3,000	15.11.2050	£ 400	25	0,00
Erhalt	UKRPI	3,051	15.11.2050	400	21	0,00
Erhalt	UKRPI	3,143	15.11.2050	200	(6)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,217	15.11.2040	970	(27)	(0,01)
Erhalt	UKRPI	3,257	15.02.2025	5.300	(137)	(0,03)
Erhalt	UKRPI	3,258	15.02.2025	3.600	(93)	(0,02)
Erhalt	UKRPI	3,262	15.02.2025	2.400	(63)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,272	15.11.2040	400	(7)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,273	15.11.2040	560	(10)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,340	15.11.2040	490	7	0,00
Zahlung	UKRPI	3,386	15.01.2030	700	21	0,00
Erhalt	UKRPI	3,397	15.11.2030	570	(2)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,436	15.02.2030	400	13	0,00
Erhalt	UKRPI	3,445	15.11.2030	560	(3)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,450	15.02.2030	3.300	117	0,02
Zahlung	UKRPI	3,453	15.02.2030	4.700	171	0,03
Erhalt	UKRPI	3,510	15.11.2030	290	(5)	0,00
					\$ 359	0,07
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 26</b>	<b>0,01</b>

- (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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC USD versus CAD	CAD 1,460	03.02.2021	9.300	\$ 1	\$ 0	0,00
HUS	Call - OTC USD versus CHF	CHF 1,030	22.02.2021	5.600	0	0	0,00
					\$ 1	\$ 0	0,00

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,175 %	15.09.2021	2.200	\$ 91	\$ 22	0,01
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,306	29.10.2021	100	7	5	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,306	29.10.2021	100	7	8	0,00
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,370	25.10.2021	300	21	16	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,370	25.10.2021	300	21	22	0,01
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,300	21.12.2021	1.200	48	14	0,00
FBF	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,733	26.08.2021	2.700	200	74	0,01
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,300	13.10.2021	2.800	29	33	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,365	22.10.2021	400	29	21	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,365	22.10.2021	400	29	30	0,01
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,100	29.01.2021	4.500	35	9	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,752	23.08.2021	2.300	170	59	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,300	21.12.2021	1.700	67	19	0,00
						\$ 754	\$ 332	0,06	

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	800	\$ 61	\$ 58	0,01

## VERKAUFSOPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.01.2021	1.200	\$ (2)	\$ 0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	100	0	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450	20.01.2021	2.500	(2)	(2)	0,00
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	4.200	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	1.300	(4)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	600	(1)	0	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	200	0	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	1.100	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	800	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	1.100	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	1.400	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	2.500	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	1.500	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	1.500	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	2.500	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.500	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	BRC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	1.000	(1)	(2)
Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index		Verkauf	1,100	20.01.2021	2.400	(5)	0	0,00
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,700	17.02.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,700	17.03.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
DUB	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	3.800	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	3.800	(7)	(6)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,950	20.01.2021	400	(1)	0	0,00
FBF	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	600	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	1.300	(1)	(1)	0,00
GST	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	1.300	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	700	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	17.02.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.100	(2)	(1)	0,00
JLN	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	1.200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	1.200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	2.000	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
MYC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	2.000	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	1.100	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	1.100	(2)	0	0,00
HUS	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	800	(1)	(1)	0,00
						\$ (85)	\$ (44)	(0,01)

## DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens	
HUS	Put - OTC EUR versus CNH	CNH	7,750	04.02.2021	2.057	\$ (11)	\$ (2)	0,00
	Call - OTC EUR versus CNH		8,050	04.02.2021	2.057	(11)	(12)	0,00
	Put - OTC USD versus CNH		6,550	07.01.2021	2.545	(12)	(21)	(0,01)
	Call - OTC USD versus CNH		6,750	07.01.2021	2.545	(13)	0	0,00
						\$ (47)	\$ (35)	(0,01)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Advantage Fund (Forts.)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	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 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,100	29.01.2021	1.600	(18)	(3)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,460	29.01.2021	1.600	(18)	(25)	(0,01)
BPS	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	800	(61)	(62)	(0,01)
DUB	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,020	21.12.2021	10.200	(47)	0	0,00
FAR	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,223	15.01.2021	1.000	(11)	(2)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,523	15.01.2021	1.000	(11)	(5)	0,00
FBF	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,399	26.08.2021	22.500	(200)	(1)	0,00
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	700	(31)	(6)	0,00
JPM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	400	(17)	(3)	0,00
MYC	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)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	17.02.2021	700	(24)	(5)	0,00
							\$ (765)	\$ (113)	(0,02)

## ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,000 %	07.10.2022	12.500	\$ (13)	\$ (5)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,000	08.10.2022	3.500	(3)	(2)	0,00
						\$ (16)	\$ (7)	0,00

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

<sup>(2)</sup> Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	\$ 102,141	04.03.2021	900	\$ (3)	\$ (1)	0,00
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,906	11.03.2021	400	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2050	103,367	14.01.2021	600	(3)	0	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2051	103,594	14.01.2021	700	(3)	0	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	800	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	600	(1)	(3)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	400	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	99,688	04.02.2021	800	(5)	(4)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,188	04.02.2021	1.200	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,266	04.02.2021	700	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,141	04.03.2021	500	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	104,141	04.03.2021	500	(1)	(1)	0,00
					\$ (27)	\$ (20)	0,00

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Japan Government International Bond	(1,000) %	20.06.2022	\$ 400	\$ (14)	\$ 8	\$ (6)	0,00
BPS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	3.100	(111)	66	(45)	(0,01)
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.100	(52)	6	(46)	(0,01)
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.200	(23)	(4)	(27)	(0,00)
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.500	(39)	6	(33)	(0,01)
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.200	(42)	(8)	(50)	(0,01)
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	2.800	(98)	57	(41)	(0,01)
HUS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.200	(30)	4	(26)	(0,00)
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.700	(40)	2	(38)	(0,01)
					\$ (449)	\$ 137	\$ (312)	(0,06)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 500	\$ (12)	\$ 14	\$ 2	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	(10)	12	2	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	500	(12)	14	2	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	3.400	(54)	77	23	0,01
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	700	(11)	7	(4)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2021	2.400	(164)	178	14	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(9)	9	0	0,00
JPM	AP Moller - Maersk A/S	1,000	20.06.2022	€ 1.700	(9)	23	14	0,00
MYC	Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2021	400	3	1	4	0,00
					\$ (278)	\$ 335	\$ 57	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 700	\$ 527	\$ 4	\$ 9	\$ 13	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)	523	521	0,11
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)	505	494	0,09
						\$ (9)	\$ 1.037	\$ 1.028	0,20

**ZINSSWAPS**

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Zahlung	6-Month THB-THBFX		2,480 %	18.05.2027	THB 4.000	\$ 0	\$ 15	\$ 15	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX		2,810	18.05.2037	32.000	0	233	233	0,05
JPM	Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	5,960	11.02.2029	COP 1.904.600	0	(92)	(92)	(0,02)
							\$ 0	\$ 156	\$ 156	0,03

**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
IND	Zahlung	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	k. A.	(1,000) %	£ 1.100	08.01.2021	\$ 0	\$ (41)	\$ (41)	(0,01)
	Zahlung	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	k. A.	(1,000)	900	11.01.2021	0	(28)	(28)	(0,00)
							\$ 0	\$ (69)	\$ (69)	(0,01)

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	TWD 14.247	\$ 507	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 112	CZK 2.616	10	0	10	0,00
	01.2021	1.076	PLN 4.160	41	0	41	0,01
	01.2021	401	ZAR 6.295	26	0	26	0,01
	02.2021	€ 2.328	\$ 2.818	0	(34)	(34)	(0,01)
	02.2021	\$ 1.851	AUD 2.490	71	0	71	0,01
	02.2021	1.642	CHF 1.452	3	0	3	0,00
	02.2021	3.155	€ 2.627	63	0	63	0,01
	02.2021	687	¥ 71.500	6	0	6	0,00
	02.2021	373	NOK 3.305	13	0	13	0,00
	02.2021	5.046	SEK 43.730	282	0	282	0,05
BPS	01.2021	CAD 489	\$ 384	0	0	0	0,00
	01.2021	£ 1.676	2.236	0	(56)	(56)	(0,01)
	01.2021	TWD 17.070	609	1	0	1	0,00
	01.2021	\$ 2.683	£ 1.988	34	0	34	0,01
	01.2021	364	PLN 1.412	15	0	15	0,00
	01.2021	961	VND 22.242.320	3	0	3	0,00
	02.2021	AUD 9.202	\$ 6.668	0	(435)	(435)	(0,08)
	02.2021	DKK 26.523	4.233	0	(130)	(130)	(0,02)
	03.2021	PEN 662	183	0	0	0	0,00
	03.2021	TWD 38.470	1.377	0	(10)	(10)	0,00
	03.2021	\$ 868	CNH 5.798	20	0	20	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 Nettovermögens
	03.2021	\$	2.001 HKD	15.505	\$ 0	\$ 0	0,00
	03.2021		2.451 IDR	34.968.118	48		0,01
	03.2021		13.821 INR	1.036.848	269		0,05
	03.2021		14 KRW	15.284	0		0,00
	03.2021		1.152 PHP	55.559	1		0,00
	03.2021		1.912 TWD	53.532	18		0,00
BRC	01.2021	BRL	3.876 \$	736	0	(10)	0,00
	01.2021	\$	746 BRL	3.876	0	0	0,00
	01.2021		1.037 £	761	4		0,00
	01.2021		959 RUB	73.961	40		0,01
	02.2021	CHF	1.000 \$	1.123	0	(9)	0,00
	02.2021	CZK	47	2	0	0	0,00
	02.2021	\$	736 BRL	3.876	10		0,00
	02.2021		1.930 CHF	1.712	10		0,00
	02.2021		67 CZK	1.472	2		0,00
CBK	02.2021		4.257 ¥	439.700	9	(5)	0,00
	01.2021		800 CLP	597.201	40		0,01
	01.2021		105 CZK	2.435	8		0,00
	01.2021		18 PLN	69	0		0,00
	01.2021		61 RUB	4.686	2		0,00
	01.2021		1.281 ZAR	20.055	81		0,02
	02.2021	DKK	27.830 \$	4.459	0	(118)	(0,02)
	02.2021	€	10.168	12.127	0	(328)	(0,06)
	02.2021	ILS	8.120	2.496	0	(34)	(0,01)
	02.2021	PEN	27.295	7.575	27		0,01
	02.2021	RUB	10.022	135	0		0,00
	02.2021	\$	2.337 €	1.919	15	(1)	0,00
	02.2021		3.730 NOK	34.225	267		0,05
	02.2021		74 RUB	5.443	0	(1)	0,00
	03.2021	TWD	5.923 \$	215	2		0,00
	03.2021	\$	5.293 CNH	35.329	119		0,02
	04.2021	PEN	1.876 \$	522	3		0,00
FBF	05.2021	\$	775 COP	2.841.241	52		0,01
	01.2021	BRL	1.556 \$	299	0		0,00
	01.2021	\$	306 BRL	1.556	0	(7)	0,00
GLM	03.2021		393 INR	29.162	4		0,00
	01.2021	MXN	22.573 \$	1.106	0	(25)	0,00
	01.2021	PEN	1.150	319	1		0,00
	01.2021	\$	1 CLP	747	0		0,00
	01.2021		3.664 NZD	5.217	92		0,02
	01.2021		76 RUB	5.833	3		0,00
	02.2021	DKK	23.069 \$	3.705	0	(89)	(0,02)
	02.2021	\$	1.709 CAD	2.189	9		0,00
	02.2021		512 DKK	3.100	0	(2)	0,00
	02.2021		508 ILS	1.716	27		0,01
	02.2021		426 KZT	180.570	0		0,00
	02.2021		499 NOK	4.400	15		0,00
	02.2021		209 RON	861	7		0,00
	02.2021		720 RUB	54.863	19		0,00
	03.2021	PEN	3.394 \$	939	1		0,00
	03.2021	\$	812 CNH	5.339	6		0,00
HUS	03.2021		2.883 THB	87.736	46		0,01
	01.2021	BRL	33.370 \$	6.595	170		0,03
	01.2021	£	13.879	18.562	0	(410)	(0,08)
	01.2021	MXN	19.756	926	0	(63)	(0,01)
	01.2021	\$	6.422 BRL	33.370	3		0,00
	01.2021		349 CLP	260.748	18		0,00
	01.2021		2.585 £	1.929	52		0,01
	01.2021		916 PLN	3.496	22		0,01
	01.2021		1.579 ZAR	24.673	97		0,02
	02.2021	€	1.735 \$	2.098	0	(27)	(0,01)
	02.2021	PEN	2.431	667	0	(5)	0,00
	02.2021	\$	6.591 BRL	33.370	0	(169)	(0,03)
	02.2021		29.599 ¥	3.106.615	505		0,10
	02.2021		488 NOK	4.420	28		0,01
	02.2021		647 RUB	48.347	4		0,00
	03.2021	CNH	29.489 \$	4.465	0	(53)	(0,01)
	03.2021	\$	872 CNH	5.767	11		0,00
	03.2021		674 CNY	4.417	2		0,00
	03.2021		621 IDR	8.882.384	14		0,00
	03.2021		1.707 KRW	1.863.286	7	(1)	0,00
IND	03.2021		1.446 SGD	1.940	21		0,00
JPM	02.2021		74 CZK	1.642	2		0,00
	01.2021	BRL	495 \$	95	0		0,00
	01.2021	CLP	50.571	64	0	(7)	0,00
	01.2021	TWD	39.060	1.393	3		0,00
	01.2021	\$	95 BRL	495	0		0,00
	01.2021		55 RUB	4.208	2		0,00
	02.2021	NOK	3.685 \$	386	0	(44)	(0,01)
	03.2021	CNH	19.335	2.957	0	(5)	0,00
	03.2021	\$	2.492 CNH	16.512	37		0,01
	03.2021		1.459 KRW	1.609.513	21		0,00
MYI	01.2021	€	36 \$	44	0		0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	01.2021	NZD	2.457	\$ 1.725	\$ 0	\$ (44)	(0,01)	
	01.2021	\$	18	€ 15	0	0	0,00	
	01.2021		1.389	£ 1.053	50	0	0,01	
	01.2021		68	PLN 260	2	0	0,00	
	02.2021		8.833	CAD 11.611	283	0	0,05	
	02.2021		4.619	CHF 4.214	155	0	0,03	
	03.2021		4.856	CNH 32.117	64	0	0,01	
	03.2021		1	KRW 1.105	0	0	0,00	
	03.2021		1.912	TWD 53.532	18	0	0,00	
	06.2021		52	€ 41	0	(2)	0,00	
RBC	02.2021		2.754	2.246	0	(3)	0,00	
	03.2021	TWD	53.532	\$ 1.906	0	(24)	0,00	
SCX	01.2021	\$	580	HUF 177.313	18	0	0,00	
	02.2021	CHF	2.228	\$ 2.447	0	(77)	(0,01)	
	02.2021	¥	49.400	474	0	(5)	0,00	
	02.2021	\$	2.580	€ 2.167	74	0	0,02	
	02.2021		2.208	ILS 7.584	155	0	0,03	
	02.2021		1.306	SEK 11.075	43	0	0,01	
	03.2021	TWD	29.283	\$ 1.049	0	(6)	0,00	
	03.2021	\$	553	MYR 2.252	8	0	0,00	
SSB	01.2021		5.992	BRL 31.814	132	0	0,03	
	03.2021		6.130	KRW 6.822.653	144	0	0,03	
TOR	01.2021		2	CLP 1.494	0	0	0,00	
	03.2021		8.101	MXN 166.144	161	0	0,03	
UAG	01.2021		36	RUB 2.776	1	0	0,00	
	02.2021	DKK	33.181	\$ 5.313	0	(145)	(0,03)	
	02.2021	\$	118	CZK 2.604	3	0	0,00	
	02.2021		10.817	€ 9.134	370	0	0,07	
	02.2021		2.095	RUB 158.351	41	(3)	0,01	
					\$ 4.586	\$ (2.387)	\$ 2.199	0,42

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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 Nettovermögens	
BOA	01.2021	¥	593.774	\$ 5.709	\$ 0	\$ (42)	(0,01)	
	01.2021	\$	16.422	CHF 14.833	360	0	0,07	
	01.2021		140	€ 114	0	(1)	0,00	
BPS	01.2021	AUD	1.882	\$ 1.384	0	(68)	(0,01)	
	01.2021	CHF	459	521	2	0	0,00	
	02.2021	DKK	5.350	863	0	(17)	0,00	
CBK	01.2021	¥	57.888	556	0	(5)	0,00	
	01.2021	NZD	844	594	0	(14)	0,00	
GLM	01.2021	\$	11.764	¥ 1.217.583	30	0	0,01	
	02.2021	¥	1.217.583	\$ 11.767	0	(30)	(0,01)	
HUS	01.2021	£	4.941	6.608	0	(146)	(0,03)	
	01.2021	¥	106.942	1.026	0	(10)	0,00	
	01.2021	SEK	10.379	1.220	0	(44)	(0,01)	
JPM	01.2021	AUD	892	656	0	(32)	(0,01)	
MYI	01.2021	NOK	7.764	877	0	(30)	(0,01)	
	01.2021	\$	49.992	CHF 45.276	1.234	0	0,23	
SCX	01.2021	AUD	521	\$ 384	0	(18)	0,00	
	01.2021	€	26.237	31.421	0	(681)	(0,13)	
	02.2021		26.237	32.124	0	0	0,00	
SSB	01.2021	\$	50.307	CHF 45.334	984	0	0,19	
TOR	01.2021	CAD	4.863	\$ 3.753	0	(63)	(0,01)	
	01.2021	¥	458.980	4.400	0	(46)	(0,01)	
	01.2021	\$	3.817	CAD 4.863	0	0	0,00	
	02.2021	CAD	4.863	\$ 3.817	0	0	0,00	
UAG	01.2021	AUD	1.051	772	0	(39)	(0,01)	
					\$ 2.610	\$ (1.286)	\$ 1.324	0,25

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen 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 Nettovermögens
BOA	01.2021	¥	992.429	\$ 9.543	\$ 0	\$ (70)	(0,01)
BPS	01.2021	AUD	3.066	2.255	0	(111)	(0,02)
	01.2021	€	62	76	0	(1)	0,00
	01.2021	\$	8.343	€ 6.809	0	(11)	0,00
	02.2021	DKK	10.436	\$ 1.684	0	(32)	(0,01)
BRC	01.2021	£	388	529	0	(2)	0,00
CBK	01.2021	AUD	328	250	0	(3)	0,00
	01.2021	€	48	57	0	(1)	0,00
	01.2021	¥	96.753	929	0	(8)	0,00
	01.2021	NZD	1.483	1.043	0	(24)	(0,01)

## 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 Nettovermögens
GLM	01.2021	\$ 20.744	¥ 2.147.044	\$ 52	\$ 0	\$ 52	0,01
	02.2021	¥ 2.147.044	\$ 20.750	0	(53)	(53)	(0,01)
HUS	01.2021	€ 114	\$ 138	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	£ 8.398	11.232	0	(248)	(248)	(0,05)
	01.2021	¥ 178.741	1.715	0	(16)	(16)	0,00
	01.2021	SEK 20.406	2.399	0	(86)	(86)	(0,02)
	01.2021	\$ 20	€ 16	0	0	0	0,00
JPM	01.2021	AUD 1.454	\$ 1.069	0	(52)	(52)	(0,01)
	01.2021	\$ 4	€ 3	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	CHF 2.440	\$ 2.694	0	(67)	(67)	(0,01)
	01.2021	NOK 15.979	1.805	0	(61)	(61)	(0,01)
SCX	01.2021	AUD 849	625	0	(30)	(30)	(0,01)
	01.2021	\$ 88.904	€ 74.235	1.926	0	1.926	0,37
	02.2021	143.694	117.360	0	(1)	(1)	0,00
SSB	01.2021	CAD 390	\$ 307	1	0	1	0,00
	01.2021	¥ 111.985	1.089	4	0	4	0,00
TOR	01.2021	CAD 8.386	6.473	0	(109)	(109)	(0,02)
	01.2021	¥ 767.136	7.354	0	(77)	(77)	(0,02)
	01.2021	\$ 6.582	CAD 8.386	0	0	0	0,00
	01.2021	€ 58.447	48.803	1.266	0	1.266	0,24
	02.2021	CAD 8.386	\$ 6.583	0	0	0	0,00
	02.2021	\$ 6.952	€ 5.678	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	AUD 1.713	\$ 1.258	0	(64)	(64)	(0,01)
				\$ 3.249	\$ (1.128)	\$ 2.121	0,40

Zum 31. Dezember 2020 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
BOA	01.2021	¥ 825	\$ 8	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2021	AUD 3	\$ 2	0	0	0	0,00
	02.2021	DKK 7	1	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	¥ 80	1	0	0	0	0,00
	01.2021	NZD 1	1	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 14	£ 10	0	0	0	0,00
GLM	01.2021	¥ 16	¥ 1.692	0	0	0	0,00
	02.2021	¥ 1.692	\$ 16	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	€ 1	1	0	0	0	0,00
	01.2021	¥ 149	1	0	0	0	0,00
	01.2021	SEK 15	2	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 71	£ 53	1	0	1	0,00
JPM	01.2021	AUD 1	\$ 1	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	CHF 2	2	0	0	0	0,00
	01.2021	NOK 12	1	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	AUD 1	1	0	0	0	0,00
	01.2021	€ 37	44	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	37	45	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	\$ 75	£ 56	2	0	2	0,00
TOR	01.2021	CAD 7	\$ 6	0	0	0	0,00
	01.2021	¥ 638	6	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 6	CAD 7	0	0	0	0,00
	02.2021	CAD 7	\$ 6	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	AUD 1	1	0	0	0	0,00
				\$ 3	\$ (1)	\$ 2	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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 Nettovermögens
BOA	01.2021	¥ 220.861	\$ 2.124	\$ 0	\$ (16)	\$ (16)	0,00
	01.2021	\$ 19.769	NOK 174.741	640	0	640	0,12
BPS	01.2021	AUD 744	\$ 547	0	(27)	(27)	(0,01)
	02.2021	DKK 1.882	304	0	(6)	(6)	0,00
BRC	01.2021	\$ 7.111	NOK 62.444	182	0	182	0,03
CBK	01.2021	¥ 21.532	\$ 207	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	NZD 308	217	0	(5)	(5)	0,00
GLM	01.2021	¥ 21.529	207	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 4.584	¥ 474.424	12	0	12	0,00
	02.2021	¥ 474.424	\$ 4.585	0	(12)	(12)	0,00
HUS	01.2021	£ 1.890	2.527	0	(56)	(56)	(0,01)
	01.2021	¥ 39.778	382	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	SEK 4.139	487	0	(17)	(17)	(0,01)
JPM	01.2021	AUD 353	260	0	(13)	(13)	0,00
MYI	01.2021	CHF 591	653	0	(16)	(16)	0,00
	01.2021	NOK 4.142	468	0	(16)	(16)	0,00
	01.2021	\$ 19.670	NOK 174.140	669	0	669	0,13
SCX	01.2021	AUD 206	\$ 152	0	(7)	(7)	0,00
	01.2021	€ 10.329	12.370	0	(268)	(268)	(0,05)
	02.2021	10.329	12.647	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
TOR	01.2021	CAD	1.948	\$ 1.504	\$ 0	\$ (25)	(0,01)		
	01.2021	¥	170.723	1.637	0	(17)	0,00		
	01.2021	\$	1.529	CAD 1.948	0	0	0,00		
	02.2021	CAD	1.948	\$ 1.529	0	0	0,00		
UAG	01.2021	AUD	416	305	0	(15)	0,00		
						\$ 1.503	\$ (524)	\$ 979	0,19
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>								\$ 7.656	1,46

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2051 (l)	\$ 500	\$ (517)	(0,10)
2,500 % fällig am 01.02.2051	14.700	(15.471)	(2,95)
3,000 % fällig am 01.01.2051	27.100	(28.396)	(5,42)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		\$ (44.384)	(8,47)
<b>Summe Anlagen</b>		\$ 750.654	143,18
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		\$ (226.370)	(43,18)
<b>Nettovermögen</b>		\$ 524.284	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 und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 47.633 als Sicherheiten verpfändet.
- (k) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 12.503 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.
- (l) Zum 31. Dezember 2020 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren abgedeckt.
- Barmittel in Höhe von USD 6.789 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.
- Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 1.170 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	52	7.683	(1)	7.734
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(44.384)	0	(44.384)
<b>Summen</b>	<b>\$ 20.047</b>	<b>\$ 728.033</b>	<b>\$ 2.574</b>	<b>\$ 750.654</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Advantage Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 690.740	\$ 33	\$ 690.773
Investmentfonds	21.516	0	0	21.516
Pensionsgeschäfte	0	2.818	0	2.818
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	296	5.298	0	5.594
<b>Summen</b>	<b>\$ 21.812</b>	<b>\$ 698.856</b>	<b>\$ 33</b>	<b>\$ 720.701</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	(0,480) %	18.11.2020	17.02.2021	€ (4.368)	\$ (5.341)	(1,02)
CEW	0,190	12.11.2020	11.02.2021	£ (1.341)	(1.833)	(0,35)
GRE	0,160	15.12.2020	15.01.2021	\$ (14.129)	(14.130)	(2,69)
	0,180	28.10.2020	27.01.2021	(5.074)	(5.076)	(0,97)
	0,180	05.11.2020	05.01.2021	(4.620)	(4.621)	(0,88)
IND	0,150	16.12.2020	11.02.2021	(7.775)	(7.776)	(1,48)
JML	(0,530)	18.11.2020	17.02.2021	€ (7.109)	(8.692)	(1,66)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (47.469)</b>	<b>(9,05)</b>

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	% des Nettovermögens
BPS	(0,050) %	16.12.2020	06.01.2021	¥ (907.780)	\$ (8.792)	(1,68)
TDM	0,160	04.12.2020	07.01.2021	\$ (3.702)	(3.703)	(0,70)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (12.495)</b>	<b>(2,38)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 13	\$ 0	\$ 13
BOA	1.339	(1.210)	129
BPS	(591)	460	(131)
BRC	162	0	162
CBK	881	(550)	331
DUB	12	(20)	(8)
FAR	(8)	0	(8)
FBF	69	(260)	(191)
GLM	679	(110)	569
GST	(79)	260	181
HUS	(448)	330	(118)
IND	(67)	0	(67)
JPM	(228)	0	(228)
MYC	74	(440)	(366)
MYI	2.239	(2.310)	(71)
RBC	(27)	0	(27)
SCX	1.130	(1.360)	(230)
SSB	1.267	(1.250)	17
TOR	1.090	(1.260)	(170)
UAG	149	0	149

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	79,21	81,53
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	65,92	66,24
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,98	k. A.
Investmentfonds	3,81	4,60
Pensionsgeschäfte	0,25	0,60
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,06
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	(0,79)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,46	1,92
Leerverkaufte Wertpapiere	(8,47)	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(9,05)	(17,45)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(2,38)	(3,77)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Argentinien	0,04	0,05
Australien	3,73	0,70
Brasilien	2,03	2,54
Kanada	0,78	0,93
Cayman-Inseln	3,65	3,94
Chile	0,57	1,29
China	1,81	2,43
Kolumbien	0,42	0,43
Tschechische Republik	0,10	0,11
Dänemark	3,94	5,50
Frankreich	3,43	2,24
Deutschland	2,99	1,91
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,36
Hongkong	0,41	0,73
Ungarn	0,10	k. A.
Indien	0,35	0,79
Indonesien	1,68	3,35
Irland	1,90	2,26
Israel	0,77	0,50
Italien	7,68	3,70
Japan	7,31	7,88
Kuwait	1,24	0,92
Luxemburg	1,30	1,37
Malaysia	0,29	0,20
Mexiko	0,40	0,38
Multinational	0,42	0,32
Niederlande	1,85	1,86
Neuseeland	0,14	k. A.
Norwegen	0,35	0,15
Peru	2,11	1,74
Philippinen	0,11	0,11
Portugal	0,09	0,12
Katar	0,82	0,35
Rumänien	0,32	0,15
Russland	3,74	4,48
Saudi-Arabien	1,46	1,32
Serbien	1,03	k. A.
Singapur	0,80	0,86
Slowenien	0,32	0,45
Südafrika	0,22	0,23
Südkorea	0,88	0,93
Spanien	2,69	3,47
Supranational	0,22	k. A.
Schweden	k. A.	0,07
Schweiz	1,07	0,42
Türkei	k. A.	0,32
Vereinigte Arabische Emirate	0,96	1,04
Großbritannien	12,70	13,86
USA	66,87	69,64
Jungferinseln (Britisch)	k. A.	0,24
Kurzfristige Instrumente	0,02	1,13
Investmentfonds	3,81	4,60
Pensionsgeschäfte	0,25	0,60
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,06
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	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	0,01
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,05)	(0,09)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,01

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Zinsswaps — Basisswaps	(0,01)	0,01
Zinsswaps	0,07	(0,74)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	0,02
Zinsswapoptionen	0,06	0,22
Optionen auf Wertpapiere	0,01	0,00
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Devisenoptionen	(0,01)	(0,01)
Inflation-Capped Options	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,23)
Zinsscaps	0,00	0,00
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,06)	(0,09)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,07
Cross-Currency Swaps	0,20	0,05
Zinsswaps	0,03	0,12
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	(0,08)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	(0,01)	0,01
Devisenterminkontrakte	0,42	0,63
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,84	1,22
Leerverkaufte Wertpapiere	(8,47)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(43,18)	(54,16)
Nettovermögen	100,00	100,00

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		
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>ARGENTINIEN</b>				<b>ARGENTINIEN</b>				<b>ARGENTINIEN</b>					
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					
Pan American Energy LLC				2,150 % fällig am 22.06.2066	€	500	\$ 1.035	0,01	1,388 % fällig am 20.10.2028	\$	7.889	\$ 7.867	0,05
38,606 % fällig am 26.02.2021	ARS	51.875	\$ 353	0,00									
YPF S.A.				Summe Belgien				2,179	0,02	Dryden Senior Loan Fund	18.764	18.716	0,11
38,259 % fällig am 04.03.2021		32.150	221	0,00				16.817	0,10	1,137 % fällig am 15.10.2027			
Summe Argentinien			574	0,00						Evans Grove CLO Ltd.	5.495	5.471	0,03
				1,144 % fällig am 28.05.2028						1,542 % fällig am 15.01.2027	1.542	1.544	0,01
				Summe Belgien						Galaxy CLO Ltd.	19.200	19.200	0,12
										1,437 % fällig am 15.10.2030			
										Gallatin CLO Ltd.	13.535	13.482	0,08
										1,259 % fällig am 21.01.2028			
										ICG U.S. CLO Ltd.	24.000	24.037	0,15
										1,596 % fällig am 22.10.2031			
										Summe Cayman Inseln	316	317	0,00
										0,927 % fällig am 15.07.2026			
										JMP Credit Advisors CLO Ltd.	13.378	13.321	0,08
										1,068 % fällig am 17.01.2028			
										KKR Financial CLO Ltd.	3.300	3.305	0,02
										1,488 % fällig am 18.07.2030			
										Mountain Hawk CLO Ltd.	3.049	3.052	0,02
										1,418 % fällig am 18.04.2025			
										Mountain View CLO Ltd.	917	917	0,01
										1,037 % fällig am 15.10.2026			
										OCP CLO Ltd.	1.054	1.052	0,01
										1,037 % fällig am 15.07.2027			
										Octagon Investment Partners 31 LLC	7.200	7.200	0,04
										1,428 % fällig am 20.07.2030			
										OZLM Funding Ltd.	10.878	10.867	0,07
										1,446 % fällig am 22.07.2029			
										Seneca Park CLO Ltd.	202	203	0,00
										1,338 % fällig am 17.07.2026			
										Symphony CLO Ltd.	6.479	6.481	0,04
										1,267 % fällig am 15.10.2025			
										Telos CLO Ltd.	1.505	1.506	0,01
										1,488 % fällig am 17.01.2027			
										Trestles CLO Ltd.	35.400	35.445	0,22
										1,505 % fällig am 25.07.2029			
										Venture CLO Ltd.	12.018	11.977	0,07
										1,087 % fällig am 15.01.2028			
										1,117 % fällig am 15.04.2027	2.767	2.753	0,02
										WhiteHorse Ltd.	1.720	1.720	0,01
										1,148 % fällig am 17.04.2027			
										Zais CLO Ltd.	15.780	15.730	0,10
										1,387 % fällig am 15.04.2028			
											306.516	1,88	
										<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
										Ambac LSNI LLC	535	533	0,00
										6,000 % fällig am 12.02.2023			
										Baidu, Inc.	300	324	0,00
										3,875 % fällig am 29.09.2023			
										China Mengniu Dairy Co. Ltd.	7.700	8.052	0,05
										3,000 % fällig am 18.07.2024	8.900	9.552	0,06
										4,250 % fällig am 07.08.2023			
										CIFI Holdings Group Co. Ltd.	8.600	9.013	0,05
										7,625 % fällig am 28.02.2023			
										Country Garden Holdings Co. Ltd.	2.700	2.812	0,02
										7,125 % fällig am 25.04.2022			
										KSA Sukuk Ltd.	7.700	7.941	0,05
										2,894 % fällig am 20.04.2022			
										QNB Finance Ltd.	15.100	15.157	0,09
										1,214 % fällig am 02.05.2022	275.850	276.900	1,70
										1,310 % fällig am 12.02.2022			
										1,574 % fällig am 31.05.2021	7.050	7.073	0,04
										Sands China Ltd.	5.000	5.322	0,03
										4,600 % fällig am 08.08.2023	3.900	4.384	0,03
										5,125 % fällig am 08.08.2025	9.100	10.683	0,07
										5,400 % fällig am 08.08.2028			
										Sunac China Holdings Ltd.	5.600	5.749	0,04
										7,875 % fällig am 15.02.2022			
										Tencent Holdings Ltd.	10.900	11.154	0,07
										1,810 % fällig am 26.01.2026	3.240	3.582	0,02
										3,595 % fällig am 19.01.2028	1.100	1.266	0,01
										3,925 % fällig am 19.01.2038			
											379.497	2,33	
											686.013	4,21	

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global 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	
<b>CHILE</b>				<b>CHILE</b>				<b>DEUTSCHLAND</b>				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Chile Government International Bond				1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK	114.288	\$ 19.309	Aareal Bank AG				
2,450 % fällig am 31.01.2031	\$ 12.900	13.835	0,08	2,000 % fällig am 01.10.2050		19.180	3.253	2,625 % fällig am 15.07.2021	\$ 12.700	\$ 12.850	0,08	
<b>CHINA</b>				<b>CHINA</b>				<b>CHINA</b>				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd.				Nykredit Realkredit A/S				Deutsche Bank AG				
2,400 % fällig am 10.12.2022	35.700	36.594	0,22	0,000 % fällig am 01.10.2022	€	200	247	0,050 % fällig am 20.11.2024	€	18.600	23,030	
<b>CNCP Global Capital Ltd.</b>				<b>CNCP Global Capital Ltd.</b>				<b>CNCP Global Capital Ltd.</b>				
1,125 % fällig am 23.06.2023	15.600	15.627	0,10	1,000 % fällig am 01.07.2021	DKK	1.500	248	1,000 % fällig am 19.11.2025		12.800	15,920	
1,350 % fällig am 23.06.2025	7.200	7.200	0,04	1,000 % fällig am 01.10.2050		2.310.780	384.179	1,031 % fällig am 22.01.2021		9.500	9,501	
<b>Sinopec Group Overseas Development Ltd.</b>				<b>Sinopec Group Overseas Development Ltd.</b>				<b>Sinopec Group Overseas Development Ltd.</b>				
3,900 % fällig am 17.05.2022	1.100	1.143	0,01	1,500 % fällig am 01.10.2050		53.700	8.955	1,375 % fällig am 03.09.2026	€	12.900	16,306	
4,375 % fällig am 10.04.2024	400	439	0,00	2,000 % fällig am 01.10.2050		2.919	495	1,510 % fällig am 04.02.2021	€	9.400	9,405	
		61.003	0,37	Realkredit Danmark A/S				1,625 % fällig am 12.02.2021	€	19.600	24,028	
				2,000 % fällig am 01.10.2050	1.781	303	0,00	1,625 % fällig am 20.01.2027		41.100	52,591	
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				1,750 % fällig am 19.11.2030		21.600	27,802	
				<b>Denmark Government International Bond</b>				3,150 % fällig am 22.01.2021	\$	8.200	8,209	
				<b>3,000 % fällig am 15.11.2021</b>				3,547 % fällig am 18.09.2031		12.700	13,792	
				<b>4,500 % fällig am 15.11.2039</b>				3,961 % fällig am 26.11.2025		29.150	31,885	
				<b>Summe Dänemark</b>				4,250 % fällig am 14.10.2021		47.900	49,129	
				<b>FINNLAND</b>				Deutsche Hypothekbank AG				
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,297 % fällig am 22.03.2021	£	800	1,094	
				<b>Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj</b>				Deutsche Pfandbriefbank AG				
				<b>0,625 % fällig am 23.05.2025</b>				1,048 % fällig am 29.09.2023		18.300	25,508	
				<b>FRANKREICH</b>				2,500 % fällig am 15.03.2022	\$	62.200	63,976	
				<b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				3,375 % fällig am 22.11.2021		39.800	40,799	
				<b>FCT Ginkgo Compartment Sales Finance</b>				Hamburg Commercial Bank AG				
				<b>0,000 % fällig am 25.11.2044</b>				0,250 % fällig am 25.04.2022	€	200	247	
				<b>FCT Titrisocram</b>				IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				
				<b>0,000 % fällig am 25.07.2036</b>				3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)		11.800	14,880	
				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)		3.000	3,823	
				<b>Altice France S.A.</b>				IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar oder 6,750 % PIK)				
				<b>7,375 % fällig am 01.05.2026</b>				6,000 % fällig am 15.05.2027 (c)	\$	600	638	
				<b>BNP Paribas S.A.</b>				Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
				<b>1,904 % fällig am 30.09.2028</b>				3,500 % fällig am 22.01.2021	SEK	4.000	488	
				<b>2,219 % fällig am 09.06.2026</b>				5,000 % fällig am 15.09.2026	AUD	1.500	1,331	
				<b>3,375 % fällig am 23.01.2026</b>				Volkswagen Bank GmbH				
				<b>4,400 % fällig am 14.08.2028</b>				0,000 % fällig am 15.06.2021	€	800	980	
				<b>BPCE S.A.</b>				0,168 % fällig am 08.12.2021		6.900	8,472	
				<b>5,150 % fällig am 21.07.2024</b>				Volkswagen Financial Services AG				
				<b>Dexia Credit Local S.A.</b>				0,287 % fällig am 15.02.2021		100	122	
				<b>0,200 % fällig am 16.03.2021</b>				0,625 % fällig am 01.04.2022		11.900	14,697	
				<b>0,500 % fällig am 17.01.2025</b>				0,750 % fällig am 14.10.2021		100	123	
				<b>0,750 % fällig am 25.01.2023</b>				Volkswagen Leasing GmbH				
				<b>3,250 % fällig am 26.09.2023</b>				0,000 % fällig am 06.07.2021		1.100	1,348	
				<b>Electricite de France S.A.</b>				0,250 % fällig am 16.02.2021		11.800	14,447	
				<b>6,000 % fällig am 22.01.2114</b>				0,500 % fällig am 20.06.2022		9.000	11,110	
				<b>Holding d'Infrastructures de Transport SASU</b>				2,375 % fällig am 06.09.2022		300	382	
				<b>1,625 % fällig am 18.09.2029</b>							498,913	3,06
				<b>HSBC Continental Europe S.A.</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
				<b>0,200 % fällig am 04.09.2021</b>				<b>Land Berlin</b>				
				<b>Societe Generale S.A.</b>				<b>4,250 % fällig am 25.04.2022</b>				
				<b>1,488 % fällig am 14.12.2026</b>				<b>Land Nordrhein-Westfalen</b>				
				<b>7,375 % fällig am 13.09.2021 (g)(i)</b>				<b>0,250 % fällig am 13.03.2026</b>				
				<b>Teleperformance</b>				<b>Summe Deutschland</b>				
				<b>1,875 % fällig am 02.07.2025</b>				<b>HONGKONG</b>				
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
				<b>France Government International Bond</b>				<b>CNOOC Finance Ltd.</b>				
				<b>0,500 % fällig am 25.05.2040</b>				<b>3,875 % fällig am 02.05.2022</b>				
				<b>0,750 % fällig am 25.05.2052 (I)</b>				<b>Eastern Creation Investment Holdings Ltd.</b>				
				<b>1,500 % fällig am 25.05.2050 (I)</b>				<b>2,800 % fällig am 15.07.2022</b>				
				<b>2,000 % fällig am 25.05.2048 (I)</b>				<b>Horse Gallop Finance Ltd.</b>				
				<b>3,250 % fällig am 25.05.2045 (I)</b>				<b>1,431 % fällig am 28.06.2021</b>				
				<b>Summe Frankreich</b>				<b>3,250 % fällig am 30.05.2022</b>				
				<b>500.177</b>				<b>Huarong Finance Co. Ltd.</b>				
				<b>3,07</b>				<b>2,125 % fällig am 30.09.2023</b>				
				<b>346.391</b>				<b>Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd.</b>				
				<b>2,13</b>				<b>3,950 % fällig am 05.02.2023</b>				
				<b>500.177</b>				<b>Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.</b>				
				<b>3,07</b>				<b>1,757 % fällig am 25.05.2023</b>				
				<b>346.391</b>				<b>3,150 % fällig am 12.05.2025</b>				
				<b>2,13</b>				<b>Summe Hongkong</b>				
				<b>500.177</b>				<b>72.406</b>				
				<b>3,07</b>				<b>0,45</b>				



# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS
1,400 % fällig am 20.09.2034	¥15.880.000	\$ 179.034	1,10	Malaysia Government Investment Issue	26.000	\$ 6.830	0,04	JT International Financial Services BV	£ 7.400	\$ 11.581	0,07
Tokyo Metropolitan Government				3,422 % fällig am 30.09.2027 MYR	1.784	480	0,00	LeasePlan Corp. NV			
0,750 % fällig am 16.07.2025	\$ 18.600	18.643	0,11	4,130 % fällig am 09.07.2029	29.200	8.035	0,05	0,125 % fällig am 13.09.2023	€ 13.200	16.198	0,10
2,000 % fällig am 17.05.2021	14.100	14.187	0,09	4,258 % fällig am 26.07.2027	42.084	11.551	0,07	MDGH - GMTN BV			
2,625 % fällig am 29.05.2024	3.900	4.172	0,02	4,369 % fällig am 31.10.2028	21.800	6.065	0,04	2,875 % fällig am 21.05.2030	\$ 6.200	6.710	0,04
		900.869	5,52			54.249	0,33	Mondelez International Holdings Netherlands BV			
Summe Japan		1.626.003	9,97	Summe Malaysia		79.352	0,49	2,000 % fällig am 28.10.2021	2.300	2.329	0,01
<b>JERSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>MAURITIUS UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>NXP BV</b>			
Atrium European Real Estate Ltd.				Greenko Solar Mauritius Ltd.				4,625 % fällig am 01.06.2023	1.800	1.968	0,01
3,000 % fällig am 11.09.2025	€ 9.800	12.277	0,08	5,550 % fällig am 29.01.2025	\$ 5.500	5.720	0,04	Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % (g)	€ 3.324	5.403	0,03
<b>KASACHSTAN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>MEXIKO STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Syngenta Finance NV</b>			
Kazakhstan Government International Bond				Mexico Government International Bond				3,933 % fällig am 23.04.2021	\$ 500	503	0,00
5,125 % fällig am 21.07.2025	\$ 600	711	0,00	4,000 % fällig am 15.03.2115	€ 400	567	0,00	Volkswagen Financial Services NV			
<b>KUWAIT STAATSEMISSIONEN</b>				<b>MULTINATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Kuwait International Government Bond				5,000 % fällig am 27.04.2051	\$ 7.800	9.738	0,06	Dutch Property Finance BV			
3,500 % fällig am 20.03.2027	57.200	65.136	0,40	10,000 % fällig am 05.12.2024	MXN 130.573	7.840	0,05	0,121 % fällig am 28.04.2051	553	676	0,00
				Summe Mexiko		18.145	0,11	Eurosail PLC			
<b>LITAUEN STAATSEMISSIONEN</b>				<b>NEIDERLANDE FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>Summe Niederlande</b>			
Lithuania Government International Bond				Preferred Term Securities Ltd.				0,993 % fällig am 17.10.2040	172	212	0,00
6,125 % fällig am 09.03.2021	7.466	7.554	0,04	0,527 % fällig am 22.12.2036	\$ 12.759	11.929	0,07	Jubilee Place BV			
6,625 % fällig am 01.02.2022	8.800	9.397	0,06	0,617 % fällig am 22.03.2038	4.432	4.078	0,02	0,485 % fällig am 17.10.2057	12.660	15.477	0,10
Summe Litauen		16.951	0,10	0,717 % fällig am 23.03.2035	4.403	4.094	0,03	Summe Neuseeland		51.376	0,32
<b>LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>NEIDELANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>NORWEGEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Aroundtown S.A.				Accunia European CLO BV				DNB Boligkredit A/S			
0,000 % fällig am 16.07.2026 (d)	€ 12.700	15.242	0,09	0,950 % fällig am 15.07.2030	€ 7.050	8.631	0,05	3,250 % fällig am 28.06.2023	\$ 4.600	4.926	0,03
0,375 % fällig am 23.09.2022	11.200	13.794	0,08	Barings Euro CLO BV				Sparebanken Soer Boligkredit A/S	€ 2.600	3.187	0,02
2,000 % fällig am 02.11.2026	7.000	9.342	0,06	0,680 % fällig am 27.07.2030	1.423	1.740	0,01	0,250 % fällig am 22.03.2021		8.113	0,05
3,000 % fällig am 16.10.2029	€ 100	152	0,00	1,050 % fällig am 27.07.2030	474	581	0,01	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 2.100	2.509	0,02	Cairn CLO BV				Auckland Council			
Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL				0,930 % fällig am 30.04.2031	5.500	6.734	0,04	1,000 % fällig am 19.01.2027	5.800	7.623	0,05
2,000 % fällig am 15.02.2024	€ 500	642	0,00	Jubilee CLO BV				New Zealand Government International Bond			
2,200 % fällig am 24.07.2025	5.700	7.484	0,05	0,257 % fällig am 15.12.2029	4.300	5.237	0,03	1,500 % fällig am 15.05.2031 NZD	28.900	21.859	0,13
CPI Property Group S.A.				0,334 % fällig am 12.07.2028	4.243	5.156	0,03	1,750 % fällig am 15.05.2041	3.755	2.671	0,02
1,625 % fällig am 23.04.2027	14.500	18.256	0,11	OZLME BV				2,000 % fällig am 20.09.2025	1.109	895	0,01
2,750 % fällig am 12.05.2026	900	1.197	0,01	0,820 % fällig am 18.01.2030	7.800	9.541	0,06	5,500 % fällig am 15.04.2023	9.063	7.301	0,04
Logicoor Financing SARL				Penta CLO BV				6,000 % fällig am 15.05.2021	15.005	11.027	0,07
0,750 % fällig am 15.07.2024	10.700	13.366	0,08	0,790 % fällig am 04.08.2028	2.881	3.525	0,02	Summe Norwegen		35.094	0,22
1,500 % fällig am 14.11.2022	15.000	18.811	0,12	Tikehau CLO BV				<b>PANAMA STAATSEMISSIONEN</b>			
2,250 % fällig am 13.05.2025	7.300	9.674	0,06	0,880 % fällig am 07.12.2029	9.400	11.497	0,07	Panama Government International Bond			
Medtronic Global Holdings S.C.A.				Summe multinational		20.101	0,12	4,300 % fällig am 29.04.2053	\$ 1.300	1.658	0,01
0,000 % fällig am 02.12.2022 (d)	8.900	10.942	0,07	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,500 % fällig am 01.04.2056	5.000	6.462	0,04
NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank				ABN AMRO Bank NV				Summe Panama		8.120	0,05
2,875 % fällig am 16.02.2021	\$ 19.800	19.857	0,12	1,125 % fällig am 12.01.2032	300	422	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
		141.268	0,87	Aegon Bank NV				Kommunalbanken A/S			
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Cooperative Rabobank UA				0,625 % fällig am 20.04.2026	600	774	0,00
Miravet SARL				1,111 % fällig am 26.09.2023	\$ 2.000	2.026	0,01	5,250 % fällig am 15.07.2024 AUD	3.300	2.976	0,02
0,322 % fällig am 26.05.2065	€ 19.000	22.812	0,14	3,875 % fällig am 26.09.2023	2.600	2.838	0,02	Norway Government International Bond			
Summe Luxemburg		164.080	1,01	4,375 % fällig am 29.06.2027 (g)(i)	€ 11.800	16.006	0,10	1,750 % fällig am 13.03.2025 NOK	86.700	10.626	0,07
<b>MALAYSIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				6,625 % fällig am 29.06.2021 (g)(i)	7.200	9.068	0,05	1,750 % fällig am 17.02.2027	1.100	136	0,00
Petronas Capital Ltd.				Enel Finance International NV				2,000 % fällig am 26.04.2028	7.300	923	0,01
3,500 % fällig am 21.04.2030	\$ 8.400	9.672	0,06	2,650 % fällig am 10.09.2024	\$ 25.800	27.538	0,17	3,750 % fällig am 25.05.2021	97.500	11.546	0,07
4,550 % fällig am 21.04.2050	6.100	8.180	0,05	4,625 % fällig am 14.09.2025	1.300	1.515	0,01	Summe Norwegen		35.094	0,22
4,800 % fällig am 21.04.2060	5.000	7.251	0,05	ING Bank NV				<b>PANAMA STAATSEMISSIONEN</b>			
		25.103	0,16	2,625 % fällig am 05.12.2022	30.950	32.323	0,20	Panama Government International Bond			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				ING Groep NV				4,300 % fällig am 29.04.2053	\$ 1.300	1.658	0,01
Malaysia Government International Bond				1,238 % fällig am 02.10.2023	2.400	2.438	0,01	4,500 % fällig am 01.04.2056	5.000	6.462	0,04
3,900 % fällig am 30.11.2026 MYR	30.000	8.128	0,05	2,500 % fällig am 15.02.2029	€ 300	390	0,00	Summe Panama		8.120	0,05
3,906 % fällig am 15.07.2026	48.847	13.160	0,08	4,100 % fällig am 02.10.2023	\$ 2.600	2.858	0,02	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				4,700 % fällig am 22.03.2028	800	858	0,01				
				4,875 % fällig am 16.05.2029 (g)(i)	35.900	36.845	0,23				
				5,750 % fällig am 16.11.2026 (g)(i)	20.400	22.189	0,14				



# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global 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
<b>SCHWEIZ</b>				<b>BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC</b>				<b>SCHWEIZ</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>1,125 % fällig am 10.03.2023</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Credit Suisse AG				€ 9.800	\$ 12.329	0,08		3,571 % fällig am 10.01.2023	\$ 4.405	\$ 4.540	0,03
0,750 % fällig am 17.09.2021	€ 4.600	\$ 5.678	0,03	\$ 708	1.176	0,01		4,750 % fällig am 15.09.2025	600	677	0,00
1,750 % fällig am 15.01.2021	4.000	4.898	0,03					4,796 % fällig am 15.11.2024	20.100	22.364	0,14
2,100 % fällig am 12.11.2021	\$ 10.950	11.120	0,07					7,375 % fällig am 24.06.2022 (g)(i)	£ 3.900	5.585	0,03
6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)	23.106	26.078	0,16					Santander UK PLC			
<b>Credit Suisse Group AG</b>				<b>FCE Bank PLC</b>				<b>Santander UK PLC</b>			
3,800 % fällig am 09.06.2023	13.250	14.279	0,09	€ 500	613	0,00		0,600 % fällig am 12.02.2027	16.900	23.353	0,14
3,869 % fällig am 12.01.2029	12.050	13.665	0,08		500	614	0,00	0,881 % fällig am 15.11.2021	\$ 10.700	10.753	0,07
4,194 % fällig am 01.04.2031	1.600	1.885	0,01					3,750 % fällig am 15.11.2021	11.200	11.529	0,07
7,500 % fällig am 17.07.2023 (g)(i)	2.400	2.622	0,02	£ 11.025	15.541	0,10		5,000 % fällig am 07.11.2023	1.338	1.478	0,01
<b>UBS AG</b>				<b>Grainger PLC</b>				<b>Society of Lloyd's</b>			
5,125 % fällig am 15.05.2024 (i)	11.450	12.649	0,08					4,750 % fällig am 30.10.2024	750	1.159	0,01
7,625 % fällig am 17.08.2022 (i)	3.025	3.349	0,02					Standard Chartered PLC			
<b>UBS Group AG</b>				<b>HSBC Holdings PLC</b>				<b>Standard Chartered PLC</b>			
0,159 % fällig am 20.09.2022	€ 800	983	0,01					1,368 % fällig am 20.01.2023	\$ 300	302	0,00
5,125 % fällig am 29.07.2026 (g)(i)	\$ 8.200	8.795	0,05					1,430 % fällig am 10.09.2022	500	502	0,00
6,875 % fällig am 22.03.2021 (g)(i)	3.515	3.557	0,02					Tesco Corporate Treasury Services PLC	€ 8.900	11.295	0,07
Summe Schweiz		109.558	0,67					1,375 % fällig am 24.10.2023			
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				<b>Imperial Brands Finance PLC</b>				<b>Tesco Property Finance PLC</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>3,750 % fällig am 21.07.2022</b>				<b>5,411 % fällig am 13.07.2044</b>			
First Abu Dhabi Bank PJSC				\$ 700	730	0,00		5,661 % fällig am 13.10.2041	£ 1.130	2.093	0,01
1,180 % fällig am 16.04.2022	16.500	16.599	0,10					5,744 % fällig am 13.04.2040	587	1.109	0,01
3,000 % fällig am 30.03.2022	2.500	2.580	0,02					5,801 % fällig am 13.10.2040	575	1.081	0,01
		19.179	0,12					Virgin Media Secured Finance PLC			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Lloyds Bank PLC</b>				<b>Virgin Media Secured Finance PLC</b>			
<b>Emirate of Abu Dhabi Government International Bond</b>				<b>2,125 % fällig am 24.07.2022</b>				<b>5,000 % fällig am 15.04.2027</b>			
2,500 % fällig am 11.10.2022	1.600	1.659	0,01	£ 43.800	45.054	0,28		Yorkshire Building Society	€ 200	247	0,00
3,125 % fällig am 11.10.2027	24.100	27.064	0,17	£ 18.000	31.371	0,19		1,250 % fällig am 11.06.2021			
3,125 % fällig am 16.04.2030	10.100	11.426	0,07						945.319	5,80	
3,125 % fällig am 30.09.2049	12.900	13.853	0,08								
3,875 % fällig am 16.04.2050	10.300	12.586	0,08								
Summe Vereinigte Arabische Emirate		85.767	0,53								
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>Lloyds Banking Group PLC</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>0,500 % fällig am 12.11.2025</b>				<b>Alba PLC</b>			
Bumper UK Finance PLC				€ 4.100	5.080	0,03		0,000 % fällig am 15.12.2038	136	162	0,00
0,637 % fällig am 20.12.2028	£ 17.790	24.325	0,15					0,213 % fällig am 15.12.2038	£ 6.231	8.258	0,05
PCL Funding PLC								Albion PLC			
1,104 % fällig am 15.09.2024	22.600	30.921	0,19					0,735 % fällig am 17.08.2062	7.923	10.899	0,07
		55.246	0,34					Avon Finance No. 2 PLC	32.684	44.631	0,27
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Nationwide Building Society</b>				<b>Brass PLC</b>			
Annington Funding PLC				\$ 11.700	12.025	0,07		0,775 % fällig am 16.11.2066	8.514	11.723	0,07
1,650 % fällig am 12.07.2024	€ 100	129	0,00					Business Mortgage Finance PLC			
AstraZeneca PLC								2,048 % fällig am 15.02.2041	62	83	0,00
0,887 % fällig am 17.08.2023	\$ 400	404	0,00					Canada Square Funding PLC			
Barclays Bank PLC								0,000 % fällig am 17.12.2057	6.794	9.300	0,06
7,625 % fällig am 21.11.2022 (i)	58.579	65.187	0,40					1,156 % fällig am 17.10.2051	21.206	29.020	0,18
Barclays PLC								Eurohome UK Mortgages PLC			
1,601 % fällig am 16.05.2024	6.800	6.893	0,04					0,193 % fällig am 15.06.2044	23	31	0,00
1,651 % fällig am 15.02.2023	19.400	19.542	0,12					Eurosail PLC			
3,125 % fällig am 17.01.2024	£ 800	1.165	0,01					0,000 % fällig am 10.12.2044	€ 150	182	0,00
3,250 % fällig am 12.02.2027	1.900	2.897	0,02					0,000 % fällig am 15.12.2044	200	238	0,00
3,250 % fällig am 17.01.2033	6.400	10.327	0,06					0,000 % fällig am 13.03.2045	496	587	0,00
3,375 % fällig am 02.04.2025	€ 9.800	13.240	0,08					0,198 % fällig am 10.06.2044	£ 412	563	0,00
3,650 % fällig am 16.03.2025	\$ 7.500	8.273	0,05					0,198 % fällig am 10.12.2044	299	406	0,00
3,684 % fällig am 10.01.2023	2.000	2.062	0,01					0,741 % fällig am 13.09.2045	1.386	1.835	0,01
3,750 % fällig am 22.11.2030	£ 700	1.047	0,01					0,991 % fällig am 13.06.2045	70	95	0,00
4,338 % fällig am 16.05.2024	\$ 1.200	1.299	0,01					Feldspar PLC			
4,375 % fällig am 12.01.2026	2.400	2.769	0,02					0,743 % fällig am 15.09.2045	1.296	1.773	0,01
4,610 % fällig am 15.02.2023	18.000	18.794	0,12					Finsbury Square PLC			
4,836 % fällig am 09.05.2028	6.800	7.842	0,05					0,000 % fällig am 16.06.2070	9.856	13.571	0,08
4,950 % fällig am 10.01.2047	4.000	5.471	0,03					0,991 % fällig am 12.09.2068	18.657	25.546	0,16
4,972 % fällig am 16.05.2029	19.100	22.927	0,14					1,016 % fällig am 16.06.2069	317	435	0,00
6,375 % fällig am 15.12.2025 (g)(i)	£ 4.300	6.366	0,04					1,064 % fällig am 16.12.2069	9.079	12.441	0,08
7,125 % fällig am 15.06.2025 (g)(i)	3.900	5.960	0,04					1,084 % fällig am 16.09.2069	23.769	32.583	0,20
7,250 % fällig am 15.03.2023 (g)(i)	600	872	0,01					Friary No. 6 PLC			
7,750 % fällig am 15.09.2023 (g)(i)	\$ 1.000	1.078	0,01					0,775 % fällig am 21.11.2067	9.944	13.701	0,08
8,000 % fällig am 15.06.2024 (g)(i)	8.200	9.147	0,06					Gosforth Funding PLC			
<b>BG Energy Capital PLC</b>				<b>NatWest Markets PLC</b>				<b>Great Hall Mortgages PLC</b>			
4,000 % fällig am 15.10.2021	200	205	0,00					0,000 % fällig am 18.06.2038	630	765	0,00
								0,000 % fällig am 18.03.2039	527	640	0,00
								0,277 % fällig am 18.03.2039	£ 4.670	5.998	0,04
								Hawksmoor Mortgages PLC			
								1,104 % fällig am 25.05.2053	55.469	75.944	0,47
								Jupiter Mortgage Ltd.			
								1,000 % fällig am 01.06.2060 (b)	64.100	86.859	0,53
								Lanark Master Issuer PLC			
								0,000 % fällig am 22.12.2054	€ 260	318	0,00
								Ludgate Funding PLC			
								0,000 % fällig am 01.01.2061	653	773	0,00

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMO- GENS	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMO- GENS	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMO- GENS
Mansard Mortgages PLC 0,693 % fällig am 15.12.2049	£	10.059	\$ 13.582	0,08	1,750 % fällig am 07.09.2022		25	35	0,00	CSAB Mortgage-Backed Trust 6,672 % fällig am 25.06.2036 ^	\$	251	\$ 98	0,00
Newgate Funding PLC 0,000 % fällig am 01.12.2050 0,057 % fällig am 15.12.2050 0,214 % fällig am 01.12.2050 0,242 % fällig am 01.12.2050 0,707 % fällig am 15.12.2050 0,957 % fällig am 15.12.2050 1,043 % fällig am 15.12.2050 1,293 % fällig am 15.12.2050	€	2.824 926 695 502 2.758 4.813 3.461 3.083	3.251 1.111 916 655 3.292 5.677 4.547 4.114	0,02 0,01 0,01 0,01 0,02 0,03	1,750 % fällig am 22.01.2049 4,250 % fällig am 07.06.2032	£	9.300 200	15.994 395	0,10 0,00	Delta Funding Home Equity Loan Trust 0,799 % fällig am 15.08.2030		18	16	0,00
Oncilla Mortgage Funding PLC 1,435 % fällig am 12.12.2043		8.255	11.310	0,07	Summe Großbritannien			42.486	0,26	EMC Mortgage Loan Trust 0,888 % fällig am 25.05.2040		16	16	0,00
Paragon Mortgages PLC 0,286 % fällig am 15.01.2039 0,441 % fällig am 15.11.2038 1,105 % fällig am 15.05.2045	£	12.208 35 18.359	16.402 34 25.219	0,10 0,00 0,15	<b>USA</b>			1.985.508	12,18	Encore Credit Receivables Trust 1,048 % fällig am 25.01.2036		8.000	7.797	0,05
Residential Mortgage Securities PLC 0,837 % fällig am 20.03.2050 0,984 % fällig am 20.12.2046 1,304 % fällig am 20.06.2070		3.112 9.542 25.813	4.254 13.054 35.503	0,03 0,08 0,22	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>					Fieldstone Mortgage Investment Trust 0,390 % fällig am 25.11.2036		2.396	1.744	0,01
Resloc UK PLC 0,203 % fällig am 15.12.2043 0,263 % fällig am 15.12.2043 0,377 % fällig am 15.12.2043	£	75 3.573 188	98 4.588 180	0,00 0,03 0,03	Accredited Mortgage Loan Trust 0,408 % fällig am 25.09.2036	\$	4.031	3.948	0,02	First Franklin Mortgage Loan Trust 0,258 % fällig am 25.12.2037 0,868 % fällig am 25.10.2035		4.409 863	4.250 862	0,03 0,01
Ripon Mortgages PLC 0,851 % fällig am 20.08.2056	£	36.597	50.003	0,31	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,208 % fällig am 25.10.2036 0,278 % fällig am 25.12.2036 0,298 % fällig am 25.07.2036 0,943 % fällig am 25.01.2035 1,048 % fällig am 25.12.2034 1,048 % fällig am 25.08.2035		5 7.512 2.334 857 1.220 5.600	3 5.063 1.138 849 1.184 5.575	0,00 0,03 0,01 0,01 0,01 0,03	Fremont Home Loan Trust 0,283 % fällig am 25.10.2036 0,288 % fällig am 25.01.2037 1,213 % fällig am 25.06.2035		3.018 2.962 7.800	2.754 1.950 7.744	0,02 0,01 0,05
RMAC PLC 0,741 % fällig am 12.06.2046 1,011 % fällig am 12.06.2046		28.156 15.108	38.286 20.647	0,24 0,13	Ameritrust Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 0,898 % fällig am 25.09.2035 1,198 % fällig am 25.11.2034		965 771	966 765	0,01 0,00	GSA Home Equity Trust 0,378 % fällig am 25.04.2047 0,448 % fällig am 25.03.2037 0,628 % fällig am 25.06.2036 0,748 % fällig am 25.05.2047		418 357 3.473 174	251 202 1.535 136	0,00 0,00 0,01 0,00
RMAC Securities PLC 0,000 % fällig am 12.06.2044 0,191 % fällig am 12.06.2044	€	1.153 489	1.345 639	0,01 0,00	Amortizing Residential Collateral Trust 0,848 % fällig am 25.10.2031		41	40	0,00	GSAMP Trust 0,278 % fällig am 25.12.2046 0,288 % fällig am 25.12.2036 0,378 % fällig am 25.12.2046 0,823 % fällig am 25.11.2035		3.465 6.942 8.709 5.480	2.224 4.375 5.737 5.382	0,01 0,03 0,04 0,03
Rochester Financing PLC 1,337 % fällig am 18.06.2045		2.652	3.628	0,02	ARMESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust 1,088 % fällig am 25.06.2029		47	44	0,00	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 0,428 % fällig am 25.08.2036 0,848 % fällig am 25.12.2033 1,068 % fällig am 25.02.2033		713 18 2	706 18 2	0,00 0,00 0,00
Silverstone Master Issuer PLC 0,000 % fällig am 21.01.2070 0,779 % fällig am 21.01.2070	€	418 144	511 144	0,00 0,00	Argent Securities Trust 0,298 % fällig am 25.07.2036		4.258	3.774	0,02	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 0,308 % fällig am 25.11.2036 0,468 % fällig am 25.04.2037		9.638 4.424	9.096 4.021	0,06 0,03
Southern Pacific Financing PLC 0,291 % fällig am 10.03.2044	£	587	764	0,00	Asset-Backed Funding Certificates Trust 0,848 % fällig am 25.06.2034		308	302	0,00	Home Equity Mortgage Trust 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^		506	277	0,00
Stratton Mortgage Funding PLC 0,954 % fällig am 12.03.2052		24.172	32.797	0,20	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 0,763 % fällig am 25.02.2036 0,788 % fällig am 25.12.2034 0,808 % fällig am 25.10.2032 1,148 % fällig am 25.10.2037 1,148 % fällig am 25.11.2042 1,153 % fällig am 25.06.2035 1,198 % fällig am 25.08.2037		4.347 22 12 1.316 26 1.551 3.018	4.667 22 22 1.316 25 1.534 2.763	0,03 0,00 0,00 0,01 0,00 0,01 0,02	HSI Asset Securitization Corp. Trust 0,418 % fällig am 25.02.2036		3.700	3.610	0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC 0,956 % fällig am 20.07.2045 1,073 % fällig am 20.10.2051		32.321 26.099	44.189 35.818	0,27 0,22	CIT Mortgage Loan Trust 1,498 % fällig am 25.10.2037 1,598 % fällig am 25.10.2037 ^		5.752 1.880	5.788 1.893	0,04 0,01	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,258 % fällig am 25.08.2036 0,278 % fällig am 25.08.2036 0,418 % fällig am 25.08.2036		3.680 2.614 8.000	2.963 2.575 7.295	0,02 0,02 0,05
Tower Bridge Funding PLC 1,425 % fällig am 20.09.2063		31.694	43.544	0,27	Citigroup Mortgage Loan Trust 0,208 % fällig am 25.07.2045 5,764 % fällig am 25.01.2037 ^ 6,750 % fällig am 25.05.2036		80 161 1.730	68 102 1.241	0,00 0,00 0,01	Lehman ABS Mortgage Loan Trust 0,238 % fällig am 25.06.2037		122	94	0,00
Twin Bridges PLC 0,991 % fällig am 12.12.2052		10.541	14.422	0,09	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 0,408 % fällig am 25.06.2037		7.300	7.077	0,04	Long Beach Mortgage Loan Trust 0,448 % fällig am 25.05.2036 0,708 % fällig am 25.10.2034 1,423 % fällig am 25.02.2035		4.762 538 10.400	3.286 519 10.392	0,02 0,00 0,06
Uropa Securities PLC 0,238 % fällig am 10.06.2059 0,246 % fällig am 10.10.2040 0,388 % fällig am 10.06.2059 0,588 % fällig am 10.06.2059 0,788 % fällig am 10.06.2059		3.375 82 868 678 725	4.436 107 1.111 832 918	0,03 0,00 0,01 0,01 0,01	Countrywide Asset-Backed Certificates 0,288 % fällig am 25.06.2037 0,288 % fällig am 25.07.2037 0,288 % fällig am 25.08.2037 0,348 % fällig am 25.09.2047 ^ 0,368 % fällig am 25.08.2037 0,368 % fällig am 25.09.2037 ^ 0,368 % fällig am 25.06.2047 0,468 % fällig am 25.05.2047 ^ 0,488 % fällig am 25.12.2036 ^ 1,123 % fällig am 25.01.2036 1,198 % fällig am 25.11.2034		2.011 1.097 6.887 3.159 15.000 838 20.300 10.100 154 7.000 182	1.874 1.004 6.799 2.983 13.241 803 19.455 7.374 109 7.040 182	0,01 0,01 0,04 0,02 0,08 0,01 0,12 0,05 0,00 0,04 0,00	MASTR Asset-Backed Securities Trust 0,248 % fällig am 25.08.2036		5.417	2.566	0,02
Warwick Finance Residential Mortgages PLC 0,000 % fällig am 21.12.2049 (d) 1,003 % fällig am 21.12.2049 1,703 % fällig am 21.12.2049 2,203 % fällig am 21.12.2049 2,703 % fällig am 21.12.2049 3,203 % fällig am 21.12.2049		1 57.590 7.280 3.640 2.080 2.080	2.635 78.694 9.931 4.960 2.823 2.789	0,02 0,48 0,06 0,03 0,02 0,02	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 0,408 % fällig am 25.09.2046 0,608 % fällig am 25.05.2036 0,808 % fällig am 25.08.2035 0,988 % fällig am 25.10.2047 5,270 % fällig am 25.02.2035		3.570 4.290 4.064 4.874 252	3.309 4.250 4.002 4.790 261	0,02 0,03 0,02 0,03 0,00	MASTR Specialized Loan Trust 1,798 % fällig am 25.06.2043		41	41	0,00
			934.159	5,73	Credencia Americas LLC 0,000 % fällig am 31.07.2022 7,078 % fällig am 30.11.2021	COP 20.000.000 CLP 4.120.528	5.485 5.440		0,03 0,03	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 0,308 % fällig am 25.09.2037 0,868 % fällig am 25.05.2036		22 608	13 601	0,00 0,00
	<b>AKTIEN</b>				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,208 % fällig am 25.05.2037 0,278 % fällig am 25.01.2037 0,288 % fällig am 25.10.2036 0,308 % fällig am 25.09.2036 0,378 % fällig am 25.10.2036 0,398 % fällig am 25.07.2036 0,648 % fällig am 25.04.2036 2,048 % fällig am 25.02.2047 2,398 % fällig am 25.03.2033		322 3.173 3.679 5.125 11.770 713 6.579 1.949 87	281 1.931 2.258 2.991 7.807 638 6.037 1.827 85	0,00 0,01 0,01 0,02 0,05 0,00 0,04 0,01 0,00	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 0,318 % fällig am 25.04.2037 0,378 % fällig am 25.04.2037		4.544 13.891	3.059 9.422	0,02 0,06
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>					Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 0,768 % fällig am 25.01.2032	\$ 26	25		0,00	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust 0,198 % fällig am 25.11.2036		2	1	0,00
Nationwide Building Society 10,250 %		34.271	8.298	0,05	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 0,208 % fällig am 25.11.2036		20	12	0,00	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 0,508 % fällig am 25.04.2037 0,608 % fällig am 25.02.2037 5,750 % fällig am 25.04.2037 ^ 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^		365 227 131 213	176 94 86 168	0,00 0,00 0,00 0,00
<b>STAATSEMISSIONEN</b>										Morgan Stanley Structured Trust 0,378 % fällig am 25.06.2037		3.841	3.798	0,02
United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.10.2050 0,750 % fällig am 22.07.2023	£	19.560 105	25.915 147	0,16 0,00										









# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global 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
1,625 % fällig am 15.11.2050 (l)(m)	\$ 181.110	\$ 180.459	1,11	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - UK Corporate Bond Fund (h)	7.715.431	\$ 113.060	0,69
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)	6.442	6.558	0,04	JAPAN TREASURY BILLS (0,090) % fällig am 15.03.2021 (d)(e)	¥ 27.400.000	\$ 265.440	1,63	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (h)	320.842	3.272	0,02
0,125 % fällig am 15.04.2022 (l)	52.035	53.133	0,32	(0,089) % fällig am 18.01.2021 (d)(e)	10.910.000	105.675	0,65	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	11.267.895	112.251	0,69
0,125 % fällig am 15.07.2030 (l)	14.015	15.735	0,10	(0,089) % fällig am 15.03.2021 (d)(e)	18.580.000	179.996	1,10	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h)	345.274	4.485	0,03
0,250 % fällig am 15.02.2050 (l)	810	968	0,01	(0,088) % fällig am 15.03.2021 (d)(e)	8.220.000	79.632	0,49				
0,375 % fällig am 15.01.2027 (l)	37.728	42.123	0,26	(0,087) % fällig am 15.03.2021 (d)(e)	6.140.000	59.482	0,37				
0,375 % fällig am 15.07.2027 (l)	138	156	0,00	Summe kurzfristige Instrumente		690.225	4,24				
0,500 % fällig am 15.01.2028 (l)	174.177	197.620	1,21	Summe Übertragbare Wertpapiere		23.548.213	144,45				
0,750 % fällig am 15.07.2028 (l)	7.987	9.296	0,06					<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
0,750 % fällig am 15.02.2045 (l)	1.106	1.429	0,01					PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (h)	3.455.880	421.728	2,58
0,875 % fällig am 15.01.2029 (l)	2.248	2.644	0,02	<b>INVESTMENTFONDS</b>				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)	5.291.340	538.060	3,30
1,000 % fällig am 15.02.2048 (l)	17.317	24.156	0,15	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>						959.788	5,88
1,375 % fällig am 15.02.2044 (l)	1.117	1.612	0,01	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Bond Ex-US Fund (h)	13.048.894	138.971	0,85	Summe Investmentfonds		\$ 1.349.256	8,27
1,750 % fällig am 15.01.2028 (l)	22.000	27.001	0,16	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (h)	1.355.380	17.429	0,11				
2,375 % fällig am 15.01.2027 (l)	1.291	1.606	0,01								
2,500 % fällig am 15.01.2029 (l)(m)	48.875	64.245	0,39								
3,875 % fällig am 15.04.2029 (l)	31.361	45.217	0,28								
U.S. Treasury Notes											
2,000 % fällig am 30.11.2022 (l)	5.228	5.416	0,03								
2,000 % fällig am 30.04.2024 (l)	2.650	2.809	0,01								
2,000 % fällig am 15.08.2025 (l)	1.100	1.185	0,01								
2,250 % fällig am 15.11.2027 (l)	1.165	1.294	0,01								
2,375 % fällig am 15.05.2029 (l)	350	395	0,00								
2,625 % fällig am 15.06.2021 (m)	6.300	6.371	0,04								
2,625 % fällig am 31.12.2025 (l)	150	167	0,00								
2,625 % fällig am 15.02.2029 (l)	1.055	1.211	0,01								
2,875 % fällig am 31.10.2023 (l)	990	1.066	0,01								
2,875 % fällig am 30.04.2025 (l)	209.500	232.799	1,43								
3,125 % fällig am 15.11.2028 (l)	1.340	1.587	0,01								
		1.019.895	6,26								
Summe USA		11.139.141	68,33								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 19.238	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (19.623)	\$ 19.238	\$ 19.238	0,12
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (19.623)</b>	<b>\$ 19.238</b>	<b>\$ 19.238</b>	<b>0,12</b>

<sup>(1)</sup> 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 March Futures	Short	03.2021	1.037	\$ (64)	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	2.807	439	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von EUR 114.400 auf Euro-Schatz Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	8.950	(5)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 180.000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	1.000	(1)	0,00
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	3.523	(801)	(0,01)
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2021	1.427	(34)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	5.616	6.395	0,04
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	1.343	31	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	356	270	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	1.047	(642)	0,00
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2021	15.886	844	0,01
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	378	(379)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2021	1.896	398	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	2.727	785	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	419	2	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	8	11	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	785	(1.915)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	166	(313)	0,00
				\$ 5.021	0,03

<sup>(1)</sup> Future-Style-Option.

## OPTIONSKAUF

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call - CME 90-Day Eurodollar June 2022 Futures	\$ 99,750	13.06.2022	1.025	\$ 232	\$ 288	0,00
Call - CME 90-Day Eurodollar March 2022 Futures	99,750	14.03.2022	470	101	124	0,00
				\$ 333	\$ 412	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 5.433	0,03

### 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Rolls-Royce PLC	1,000 %	20.12.2024	€ 7.400	\$ (565)	0,00
Ryder System, Inc.	1,000	20.06.2022	\$ 1.800	(22)	0,00
Shell International Finance BV	1,000	20.12.2026	€ 8.900	36	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2022	6.750	96	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2025	2.900	152	0,00
				\$ (303)	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-34 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2025	\$ 2.484	\$ (125)	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000)	20.12.2025	244.700	(11.634)	(0,08)
CDX.IG-34 10-Year Index	(1,000)	20.06.2030	9.200	(5)	0,00
CDX.IG-35 10-Year Index	(1,000)	20.12.2030	118.300	(430)	0,00
iTraxx Europe Main 32 10-Year Index	(1,000)	20.12.2029	€ 33.900	148	0,00
iTraxx Europe Main 33 10-Year Index	(1,000)	20.06.2030	21.200	(84)	0,00
				\$ (12.130)	(0,08)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-34 5-Year Index	1,000 %	20.06.2025	\$ 4.500	\$ 39	0,00
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	9.300	25	0,00
				\$ 64	0,00

### ZINSSWAPS - BASISWAPS

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,091 %	18.03.2022	\$ 3.216.900	\$ (1.362)	(0,01)
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	12.06.2022	87.800	(25)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,084 %	12.06.2022	80.500	(39)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,085 %	19.06.2022	405.400	(160)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,086 %	12.04.2023	400	0	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,073 %	27.04.2023	339.800	(61)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,088 %	06.09.2024	611.900	(147)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,011 %	27.09.2024	350.000	(113)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,010 %	04.10.2024	300.600	(75)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,084 %	26.04.2022	538.800	(223)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	07.03.2024	110.900	(6)	0,00
				\$ (2.211)	(0,01)

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000 %	02.11.2025	¥ 100.000	\$ 0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,840	03.01.2022	BRL 506.700	(17)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,848	03.01.2022	417.000	(20)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,850	03.01.2022	382.300	(8)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022	77.300	(5)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,865	03.01.2022	90.000	(7)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	381.800	(28)	0,00

## 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	2,871 %	03.01.2022	BRL	486.100	\$ (38)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,880	03.01.2022		132.800	(15)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,884	03.01.2022		108.200	(13)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,300	03.01.2022		6.349.900	7.853	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022		359.700	(9)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,880	04.01.2021		17.000	290	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	CAD	57.400	985	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025		84.100	2.886	0,02
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030		277.300	10.086	0,06
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029		81.400	3.417	0,02
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029		299.100	11.379	0,07
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,200	18.12.2049		125.100	10.705	0,07
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2029		269.450	18.303	0,11
Zahlung	3-Month CHF-LIBOR	0,500	16.09.2025	CHF	459.450	1.857	0,01
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,110	16.12.2023	NZD	600	(2)	0,00
Erhalt	3-Month NZD-BBR	0,500	16.12.2025		14.255	61	0,00
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	2,405	30.01.2029	PLN	24.200	891	0,01
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK	260.100	(19)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029		56.700	227	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,200	15.01.2022	\$	883.400	(261)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,400	15.01.2028		582.150	(4.919)	(0,03)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,550	15.01.2031		851.000	19.838	0,12
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022		64.300	40	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031		55.550	(94)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025		202.500	242	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030		696.520	3.191	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,249	31.08.2024		179.400	(5.040)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025		69.530	(331)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,250	09.06.2041		30.150	(4)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050		24.000	828	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050		3.600	138	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,298	25.08.2024		155.100	(4.587)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,305	21.08.2023		180.550	(6.026)	(0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,306	21.08.2023		3.950	(9)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,325	02.12.2050		30.200	1.496	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,360	17.09.2024		53.950	(1.673)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,540	26.02.2022		221.600	(4.086)	(0,03)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,635	31.08.2051		21.450	1.145	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	20.06.2023	ZAR	263.900	1.429	0,01
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD	131.600	(286)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK	158.300	521	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2051	€	30.750	(899)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	16.06.2051		173.010	637	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050		7.450	15	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,060	17.11.2032		52.300	370	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052		17.650	(454)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	17.03.2031		71.800	576	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031		558.740	(747)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035		26.900	(265)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2023		1.020.700	845	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.03.2026		54.500	181	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2026		400.100	(836)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	15.12.2040		800	16	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,310	19.06.2029		95.400	6.023	0,04
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2023	£	70.600	26	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026		94.300	(57)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	17.03.2031		18.400	(75)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	16.06.2031		57.300	338	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	17.03.2051		20.600	199	0,00
Zahlung	6-Month GBP-LIBOR	0,500	17.06.2050		1.800	107	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,035	29.11.2029	¥	6.938.000	420	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,200	19.06.2029		6.440.000	(109)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,400	19.06.2039		13.160.000	(3.916)	(0,02)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,500	19.06.2049		2.790.000	(60)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	4,870	07.07.2025	MXN	393.200	150	0,00
Erhalt	UKRPI	3,000	15.11.2050	£	14.100	843	0,01
Erhalt	UKRPI	3,051	15.11.2050		12.900	681	0,00
Erhalt	UKRPI	3,143	15.11.2050		6.000	(186)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,217	15.11.2040		34.200	(884)	(0,01)
Erhalt	UKRPI	3,241	15.02.2025		123.700	(3.041)	(0,02)
Erhalt	UKRPI	3,257	15.02.2025		94.600	(2.440)	(0,02)
Erhalt	UKRPI	3,262	15.02.2025		99.000	(2.595)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	3,272	15.11.2040		12.900	(228)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,273	15.11.2040		18.260	(322)	0,00
Erhalt	UKRPI	3,334	15.08.2025		67.100	(447)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,340	15.11.2040		14.740	215	0,00
Zahlung	UKRPI	3,386	15.01.2030		21.800	639	0,00
Erhalt	UKRPI	3,397	15.11.2030		20.100	(102)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,436	15.02.2030		60.750	2.017	0,01
Erhalt	UKRPI	3,445	15.11.2030		18.260	(109)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,450	15.02.2030		74.500	2.619	0,02
Zahlung	UKRPI	3,453	15.02.2030		115.300	4.187	0,03

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	UKRPI		3,475 %	15.08.2030	£ 67.100	\$ 1.030	0,01
Erhalt	UKRPI		3,510	15.11.2030	8.740	(156)	0,00
						\$ 74.517	0,46
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 59.937</b>	<b>0,37</b>

(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 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 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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,175 %	15.09.2021	45.200	\$ 1.867	\$ 452	0,00
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,306	29.10.2021	6.500	476	307	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,306	29.10.2021	6.500	477	543	0,00
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,370	25.10.2021	9.000	645	482	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,370	25.10.2021	9.000	645	659	0,01
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,300	21.12.2021	22.200	888	252	0,00
FBF	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,733	26.08.2021	50.900	3.762	1.388	0,01
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,300	13.10.2021	97.300	1.021	1.145	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,365	22.10.2021	13.600	970	720	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,365	22.10.2021	13.600	970	1.004	0,01
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,100	29.01.2021	151.000	1.163	313	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,752	23.08.2021	44.500	3.298	1.141	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,300	21.12.2021	34.100	1.337	387	0,00
						\$ 17.519	\$ 8.793	0,06	

##### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2025	€ 97.000	23.05.2025	26.800	\$ 2.027	\$ 1.947	0,01

##### VERKAUFSoPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.01.2021	37.200	\$ (63)	\$ (5)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	10.400	(19)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	15.300	(23)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450	20.01.2021	76.200	(68)	(52)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	132.400	(216)	(20)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	20.000	(29)	(27)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	6.400	(46)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	45.400	(128)	(8)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	12.100	(16)	(1)	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	30.700	(15)	(12)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	25.000	(33)	(21)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	30.700	(31)	(24)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	6.800	(8)	(6)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	45.900	(52)	(63)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	28.150	(52)	(5)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	45.900	(81)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	49.900	(95)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	30.800	(37)	(24)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	125.200	(99)	(72)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	55.000	(73)	(73)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750 %	17.03.2021	125.200	\$ (123)	\$ (140)	(0,01)
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	34.000	(21)	(17)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	34.000	(50)	(58)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	70.500	(149)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	29.000	(38)	(23)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	36.500	(51)	(48)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	74.400	(38)	(36)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	74.400	(129)	(127)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	12.000	(19)	(18)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,950	20.01.2021	28.700	(44)	(3)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	17.100	(21)	(6)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	8.100	(9)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	43.500	(69)	(6)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	42.600	(28)	(29)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	42.600	(50)	(23)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	11.800	(16)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	17.02.2021	13.700	(33)	(3)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	30.600	(47)	(24)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	10.600	(12)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	12.400	(16)	(10)	0,00
FBF	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	39.500	(28)	(27)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	39.500	(42)	(21)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	66.300	(44)	(38)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	36.600	(25)	(37)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	66.300	(73)	(74)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	36.600	(45)	(31)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	38.150	(69)	(5)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	41.750	(85)	(5)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	8.900	(17)	(1)	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	32.400	(17)	(16)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	32.400	(32)	(16)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	8.400	(11)	(7)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	31.400	(39)	(22)	0,00
						\$ (2.674)	\$ (1.321)	(0,01)

### DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens	
HUS	Put - OTC EUR versus CNH	CNH	7,750	04.02.2021	67.490	\$ (361)	\$ (69)	0,00
	Call - OTC EUR versus CNH		8,050	04.02.2021	67.490	(361)	(389)	0,00
	Put - OTC USD versus CNH		6,550	07.01.2021	88.019	(433)	(729)	(0,01)
	Call - OTC USD versus CNH		6,750	07.01.2021	88.019	(433)	(2)	0,00
					\$ (1.588)	\$ (1.189)	(0,01)	

### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,880 %	15.09.2021	376.100	\$ (1.867)	\$ (5)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,100	29.01.2021	49.700	(573)	(93)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,460	29.01.2021	49.700	(573)	(775)	(0,01)
BPS	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	26.800	(2.027)	(2.074)	(0,01)
DUB	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,020	21.12.2021	181.500	(828)	(5)	0,00
FBF	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,399	26.08.2021	423.900	(3.765)	(10)	0,00
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	23.700	(1.059)	(197)	0,00
JPM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	14.500	(626)	(121)	0,00
MYC	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,448	23.08.2021	370.100	(3.296)	(8)	0,00
	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,020	21.12.2021	284.100	(1.306)	(9)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,210	19.01.2021	30.800	(289)	(59)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,550	19.01.2021	30.800	(289)	(121)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	17.02.2021	24.150	(813)	(182)	0,00
						\$ (17.311)	\$ (3.659)	(0,02)	

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

### ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,000 %	07.10.2022	256.250	\$ (265)	\$ (107)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,000	08.10.2022	117.500	(116)	(50)	0,01
						\$ (381)	\$ (157)	0,01

<sup>(1)</sup> Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 101,563	07.01.2021	13.600	\$ (46)	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	101,672	07.01.2021	22.100	(74)	0	0,00
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,906	11.03.2021	11.400	(39)	(79)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2050	103,367	14.01.2021	21.900	(96)	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2051	103,594	14.01.2021	20.600	(80)	(2)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	22.000	(36)	(20)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	20.300	(48)	(92)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	11.400	(21)	(55)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	11.000	(28)	(28)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	99,688	04.02.2021	16.100	(96)	(81)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,188	04.02.2021	21.100	(53)	(47)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,266	04.02.2021	24.900	(60)	(57)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	17.700	(55)	(18)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,141	04.03.2021	6.500	(17)	(7)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	104,141	04.03.2021	6.500	(7)	(8)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,367	04.02.2021	14.000	(40)	(56)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,406	04.02.2021	72.500	(227)	(290)	(0,01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,703	04.02.2021	21.700	(54)	(91)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,750	04.02.2021	7.900	(25)	(22)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	103,750	04.02.2021	7.900	(19)	(35)	0,00
					\$ (1.121)	\$ (989)	(0,01)

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Japan Government International Bond	(1,000) %	20.06.2022	\$ 5.400	\$ (187)	\$ 108	\$ (79)	0,00
BPS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	31.100	(1.113)	659	(454)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	22.300	(544)	53	(491)	0,00
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	37.000	(706)	(129)	(835)	(0,01)
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	14.100	(487)	281	(206)	0,00
CBK	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	48.550	(1.225)	156	(1.069)	(0,01)
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	21.200	(751)	442	(309)	0,00
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	10.700	(207)	(35)	(242)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	28.800	(1.019)	599	(420)	0,00
HUS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	31.800	(1.077)	613	(464)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	34.100	(851)	100	(751)	(0,01)
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	11.200	(268)	21	(247)	0,00
					\$ (8.435)	\$ 2.868	\$ (5.567)	(0,03)

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 11.810	\$ (285)	\$ 339	\$ 54	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	17.350	(421)	501	80	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	4.020	(98)	116	18	0,00
FBF	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	8.200	(200)	238	38	0,00
MYC	Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2021	€ 8.500	60	22	82	0,00
					\$ (944)	\$ 1.216	\$ 272	0,00

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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 Global Bond Fund (Forts.)

### 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 106.300	\$ 80.086	\$ 526	\$ 1.395	\$ 1.921	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	105.500	72.795	(26)	9.329	9.303	0,06
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)	9.139	8.934	0,05
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	3.247	3.534	0,02
						\$ 582	\$ 23.110	\$ 23.692	0,14

### 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.	0,080 %	CAD 125.200	05.02.2021	\$ 0	\$ 8.147	\$ 8.147	0,05
IND	Zahlung	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	k. A.	(0,100)	£ 17.000	08.01.2021	0	(635)	(635)	0,00
							\$ 0	\$ 7.512	\$ 7.512	0,05

### DEISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2021	AUD 112.874	\$ 83.345	\$ 0	\$ (3.758)	\$ (3.758)	(0,02)	
	01.2021	¥ 45.845.598	440.673	0	(3.400)	(3.400)	(0,02)	
	01.2021	PLN 15.574	4.027	0	(153)	(153)	0,00	
	01.2021	TWD 282.630	10.058	0	(2)	(2)	0,00	
	01.2021	\$ 2.396	CAD 3.101	38	0	38	0,00	
	01.2021	31.436	NOK 277.862	1.018	0	1.018	0,01	
	01.2021	ZAR 3.377	\$ 215	0	(14)	(14)	0,00	
	02.2021	ILS 540	160	0	(9)	(9)	0,00	
	03.2021	HKD 81.064	10.457	0	0	0	0,00	
	03.2021	¥ 18.580.000	179.259	0	(839)	(839)	(0,01)	
	03.2021	\$ 14.889	KRW 16.246.877	50	0	50	0,00	
	03.2021	375	THB 11.354	4	0	4	0,00	
	04.2021	ILS 71.987	\$ 20.756	0	(1.710)	(1.710)	(0,01)	
	BPS	01.2021	BRL 21.044	4.050	0	(2)	(2)	0,00
		01.2021	CHF 565	636	0	(3)	(3)	0,00
		01.2021	€ 234.880	282.989	0	(4.407)	(4.407)	(0,03)
		01.2021	PEN 25.534	7.078	18	0	18	0,00
		01.2021	PLN 5.284	1.363	0	(55)	(55)	0,00
		01.2021	TWD 450.251	16.059	33	0	33	0,00
01.2021		\$ 4.052	BRL 21.044	0	(1)	(1)	0,00	
01.2021		58.061	CHF 51.577	294	0	294	0,00	
01.2021		66.182	£ 49.029	841	0	841	0,01	
01.2021		170.525	¥ 17.831.600	2.190	0	2.190	0,01	
01.2021		13.407	RUB 1.035.514	578	0	578	0,00	
01.2021		18.307	SEK 154.565	514	0	514	0,00	
02.2021		DKK 976.889	\$ 155.905	0	(4.771)	(4.771)	(0,03)	
02.2021		€ 1.412.792	1.729.785	0	(15)	(15)	0,00	
02.2021		\$ 2.690	ILS 9.089	143	0	143	0,00	
03.2021		MYR 21.209	\$ 5.194	0	(87)	(87)	0,00	
03.2021		SGD 1.080	800	0	(17)	(17)	0,00	
03.2021		TWD 1.216.609	43.717	0	(132)	(132)	0,00	
03.2021		\$ 31.087	CNH 207.537	707	0	707	0,01	
03.2021	201	KRW 218.220	0	0	0	0,00		
BRC	01.2021	BRL 89.781	\$ 17.042	0	(243)	(243)	0,00	
	01.2021	¥ 18.910.000	178.879	0	(4.310)	(4.310)	(0,03)	
	01.2021	TWD 134.545	4.799	10	0	10	0,00	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2021	\$ 17.280	BRL 89.781	\$ 6	\$ (1)	\$ 5	0,00
	01.2021	2.354	£ 1.748	35	0	35	0,00
	01.2021	1.408	¥ 145.500	1	0	1	0,00
	01.2021	18.902	RUB 1.457.223	778	0	778	0,01
	02.2021	DKK 709.666	\$ 114.071	0	(2.653)	(2.653)	(0,02)
	02.2021	\$ 16.463	BRL 86.749	233	0	233	0,00
	03.2021	¥ 11.043.520	\$ 106.212	0	(834)	(834)	(0,01)
	03.2021	TWD 18.260	654	0	(4)	(4)	0,00
	03.2021	\$ 2.444	KRW 2.700.033	39	0	39	0,00
BSS	08.2021	CLP 4.120.528	\$ 6.084	281	0	281	0,00
CBK	01.2021	BRL 3.032	583	0	0	0	0,00
	01.2021	CAD 18.357	14.111	0	(298)	(298)	0,00
	01.2021	€ 62.252	74.936	0	(1.239)	(1.239)	(0,01)
	01.2021	¥ 3.571.385	34.287	0	(306)	(306)	0,00
	01.2021	PEN 188.290	52.267	206	0	206	0,00
	01.2021	\$ 599	BRL 3.032	0	(15)	(15)	0,00
	01.2021	67.194	CHF 59.469	89	0	89	0,00
	01.2021	15.413	CLP 11.511.352	787	0	787	0,01
	01.2021	1.032	€ 851	9	0	9	0,00
	01.2021	5.253	£ 3.933	123	0	123	0,00
	01.2021	13.005	NOK 114.755	398	0	398	0,00
	01.2021	2.977	RUB 229.083	117	0	117	0,00
	01.2021	17.270	SEK 147.280	665	0	665	0,00
	01.2021	20.698	ZAR 323.790	1.290	0	1.290	0,01
	01.2021	ZAR 2.877	\$ 184	0	(12)	(12)	0,00
	02.2021	BRL 3.032	599	15	0	15	0,00
	02.2021	DKK 1.043.223	167.165	0	(4.422)	(4.422)	(0,03)
	02.2021	ILS 106.903	32.866	0	(450)	(450)	0,00
	02.2021	PEN 114.253	31.551	63	(106)	(43)	0,00
	02.2021	\$ 527	ILS 1.775	27	0	27	0,00
	02.2021	3.614	RUB 266.128	0	(31)	(31)	0,00
	03.2021	PEN 49.688	\$ 14.034	296	0	296	0,00
	03.2021	TWD 449.426	16.109	0	(90)	(90)	0,00
	03.2021	\$ 17.437	CNH 115.737	293	0	293	0,00
	03.2021	34.448	MXN 703.716	548	0	548	0,00
	04.2021	PEN 166.572	\$ 46.330	284	0	284	0,00
DUB	05.2021	COP 16.998.155	4.634	0	(310)	(310)	0,00
FBF	02.2021	PEN 72.912	20.261	99	0	99	0,00
GLM	01.2021	\$ 1.302	AUD 1.712	19	0	19	0,00
	01.2021	¥ 9.398.000	\$ 89.216	0	(1.812)	(1.812)	(0,01)
	01.2021	MXN 860.071	42.141	0	(942)	(942)	(0,01)
	01.2021	PEN 24.050	6.673	23	0	23	0,00
	01.2021	TWD 28	1	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 26	CLP 19.419	1	0	1	0,00
	01.2021	578.221	¥ 59.846.296	1.456	0	1.456	0,01
	01.2021	347	MXN 6.868	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	56.277	NZD 80.127	1.416	0	1.416	0,01
	01.2021	3.722	RUB 285.178	129	0	129	0,00
	02.2021	DKK 53.835	\$ 8.785	0	(70)	(70)	0,00
	02.2021	¥ 59.846.296	578.383	0	(1.469)	(1.469)	(0,01)
	02.2021	RON 1.309	318	0	(11)	(11)	0,00
	02.2021	\$ 14.554	DKK 88.125	0	(60)	(60)	0,00
	02.2021	112	ILS 377	6	0	6	0,00
	02.2021	117	RUB 8.915	3	0	3	0,00
	03.2021	CNH 6.964.760	\$ 1.051.284	0	(15.662)	(15.662)	(0,10)
	03.2021	PEN 2.288	633	1	0	1	0,00
	03.2021	\$ 9.309	CNH 61.227	70	0	70	0,00
	03.2021	41	THB 1.248	1	0	1	0,00
	04.2021	COP 4.858.626	\$ 1.326	0	(89)	(89)	0,00
HUS	04.2021	ILS 28.147	8.205	0	(579)	(579)	0,00
	01.2021	AUD 25.133	18.997	0	(397)	(397)	0,00
	01.2021	BRL 28.445	5.474	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	€ 12.950	15.516	0	(330)	(330)	0,00
	01.2021	¥ 6.597.781	63.310	0	(597)	(597)	0,00
	01.2021	PEN 29.832	8.262	14	0	14	0,00
	01.2021	PLN 13.089	3.430	0	(83)	(83)	0,00
	01.2021	TWD 282.391	10.071	19	0	19	0,00
	01.2021	\$ 1.364	AUD 1.812	34	0	34	0,00
	01.2021	5.477	BRL 28.445	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	42.025	CAD 53.824	224	0	224	0,00
	01.2021	23.273	CLP 17.375.177	1.178	0	1.178	0,01
	01.2021	22.660	€ 18.620	127	(3)	124	0,00
	01.2021	74.973	£ 56.062	1.662	0	1.662	0,01
	01.2021	42.441	SEK 361.067	1.527	0	1.527	0,01
	01.2021	20.151	ZAR 311.788	1.022	0	1.022	0,01
	01.2021	ZAR 2.027	\$ 129	0	(9)	(9)	0,00
	02.2021	\$ 7.840	RUB 583.202	34	(23)	11	0,00
	03.2021	CNH 459.989	\$ 69.992	0	(475)	(475)	0,00
	03.2021	CNY 37.020	5.582	0	(79)	(79)	0,00
	03.2021	¥ 14.026.480	135.082	0	(879)	(879)	(0,01)
	03.2021	PEN 11.832	3.296	25	0	25	0,00
	03.2021	TWD 747.842	26.935	0	(20)	(20)	0,00
	03.2021	\$ 87.684	CNH 581.114	1.338	0	1.338	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	03.2021	\$	635	IDR	9.085.287	\$	15	0,00
	03.2021		44.551	KRW	49.130.017		627	0,00
	04.2021	ILS	153.305	\$	44.564		0	(0,02)
IND	02.2021	CZK	306		14		0	0,00
	07.2021	DKK	1.500		240		0	(0,00)
JPM	01.2021	AUD	85.323		62.779		0	(3,063)
	01.2021	BRL	11.295		2.174		0	(1)
	01.2021	CAD	16.967		13.034		0	(284)
	01.2021	TWD	220.058		7.848		15	0,00
	01.2021	\$	2.169	BRL	11.295		6	0,00
	01.2021		782	CLP	615.305		84	0,00
	01.2021		38.344	€	31.402		81	0,00
	01.2021		5.487	RUB	419.736		182	0,00
	02.2021		6.476	ILS	22.325		482	0,00
	03.2021	TWD	734.340	\$	26.348		23	(142)
	03.2021	\$	84.878	CNH	562.529		1.297	0
	03.2021		13.957	KRW	15.277.874		92	(1)
MYI	01.2021	CAD	12.044	\$	9.315		0	(139)
	01.2021	CHF	111.336		123.570		0	(2.395)
	01.2021	€	8.950		10.972		23	(1)
	01.2021	£	304		413		0	(2)
	01.2021	¥	462.700		4.440		0	(41)
	01.2021	NZD	90.363		63.481		0	(1.582)
	01.2021	PLN	974		256		0	(6)
	01.2021	SGD	799		603		0	(1)
	01.2021	\$	2.060	CAD	2.635		8	0,00
	01.2021		514	€	419		0	(2)
	01.2021		3.314	£	2.433		13	0,00
	01.2021		76.635	¥	7.983.700		706	0,00
	01.2021		11.267	NOK	99.740		382	0,00
	03.2021		1.177	KRW	1.300.304		19	0,00
RBC	06.2021		919	€	719		0	(36)
	01.2021		2.351	CAD	3.000		4	0,00
	01.2021		5.455	£	4.080		122	0,00
SCX	01.2021	AUD	49.821	\$	36.701		0	(1.745)
	01.2021	£	103.703		138.622		0	(3.139)
	01.2021	\$	6.040	AUD	8.076		192	0,00
	01.2021		1.994	€	1.627		0	(3)
	02.2021	€	120.404	\$	147.420		0	(1)
	02.2021	ILS	13.325		3.880		0	(273)
	03.2021	CNY	208.240		31.487		0	(357)
	03.2021	MYR	196.726		48.325		0	(659)
	03.2021	TWD	1.455.729		52.291		0	(177)
	04.2021	ILS	60.593		17.460		0	(1.450)
SSB	01.2021	£	933.312		1.245.808		0	(30.022)
	01.2021	PEN	804		223		1	0,00
	01.2021	TWD	616.198		21.960		27	0,00
	01.2021	\$	1.924	£	1.431		32	0,00
	03.2021	KRW	71.797.377	\$	64.506		0	(1.513)
	03.2021	\$	1.960	KRW	2.166.192		32	0,00
TOR	01.2021	CAD	208.653	\$	161.057		0	(2.722)
	01.2021	€	2.115.666		2.533.708		0	(54.913)
	01.2021	¥	28.637.933		274.514		0	(2.876)
	01.2021	\$	163.778	CAD	208.653		1	0,00
	01.2021		19	CLP	14.193		1	0,00
	02.2021	CAD	208.653	\$	163.793		0	(3)
	02.2021	€	837.043		1.024.853		0	(9)
UAG	01.2021	AUD	167.660		123.270		0	(6.110)
	01.2021	CHF	599		678		1	0,00
	01.2021	\$	3.626	RUB	276.947		114	0,00
	02.2021	CZK	9.658	\$	443		0	(7)
	02.2021	DKK	1.178.846		188.745		0	(5.148)
	02.2021	\$	10.418	RUB	774.277		36	(30)
	04.2021	ILS	248.202	\$	72.255		0	(5.204)
								(0,03)
						\$	28.067	(185.641)
						\$	(157.574)	(0,97)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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 Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2021	\$	11.028	CAD	14.309	\$	203	0,00
BPS	01.2021		1.002		1.289		10	0,00
CBK	01.2021		22.345		29.039		449	0,01
JPM	01.2021		3.789		4.933		83	0,00
SSB	01.2021		3.786		4.923		78	0,00
UAG	01.2021		22.355		29.036		438	0,00
						\$	1.261	\$ 0
						\$	1.261	0,01

Zum 31. Dezember 2020 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 Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	CHF 52	\$ 59	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 355.022	CHF 320.667	7.781	0	7.781	0,05
BPS	01.2021	CHF 789	\$ 896	4	0	4	0,00
	01.2021	\$ 2.062	CHF 1.831	10	0	10	0,00
BRC	01.2021	CHF 110	\$ 122	0	(2)	(2)	0,00
CBK	01.2021	\$ 67	CHF 76	0	0	0	0,00
GLM	01.2021	\$ 214	CHF 190	2	0	2	0,00
MYI	01.2021	CHF 420	\$ 469	0	(6)	(6)	0,00
	01.2021	\$ 364.435	CHF 330.052	8.987	0	8.987	0,06
SCX	01.2021	CHF 130	\$ 147	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 9.747	CHF 8.816	227	0	227	0,00
SSB	01.2021	CHF 976	\$ 1.099	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	\$ 367.032	CHF 330.746	7.175	0	7.175	0,04
UAG	01.2021	CHF 1.003	\$ 1.127	0	(8)	(8)	0,00
	01.2021	\$ 2.964	CHF 2.621	1	0	1	0,00
				\$ 24.187	\$ (21)	\$ 24.166	0,15

Zum 31. Dezember 2020 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 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 Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	IDR 8.673.035	\$ 615	\$ 0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	¥ 349.367	\$ 3.365	0	(19)	(19)	0,00
	01.2021	MXN 37.365	1.861	0	(14)	(14)	0,00
	01.2021	\$ 363	CAD 469	6	0	6	0,00
	01.2021	5.258	€ 4.281	0	(20)	(20)	0,00
	01.2021	317	HUF 96.176	8	0	8	0,00
	01.2021	611	IDR 8.673.035	6	0	6	0,00
	01.2021	53.213	¥ 5.534.086	391	0	391	0,00
	01.2021	430	NOK 3.800	14	0	14	0,00
	02.2021	1.855	MXN 37.365	14	0	14	0,00
BPS	01.2021	CAD 671	\$ 524	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	COP 2.356.717	686	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	€ 460	562	1	(2)	(1)	0,00
	01.2021	SGD 1.807	1.362	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	\$ 2.901	AUD 3.944	142	0	142	0,00
	01.2021	615	CAD 785	1	0	1	0,00
	01.2021	687	COP 2.356.717	2	0	2	0,00
	01.2021	781	€ 641	3	0	3	0,00
	02.2021	685	COP 2.356.717	4	0	4	0,00
	02.2021	1.665	DKK 10.315	32	0	32	0,00
	02.2021	1.362	SGD 1.807	5	0	5	0,00
BRC	01.2021	CNY 2.208	\$ 338	1	0	1	0,00
	01.2021	COP 2.356.717	687	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	€ 429	524	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	£ 288	385	0	(9)	(9)	0,00
	01.2021	\$ 336	2.208	2	0	2	0,00
	01.2021	645	COP 2.356.717	44	0	44	0,00
	02.2021	SGD 1.986	\$ 1.494	0	(8)	(8)	0,00
CBK	01.2021	€ 3.944	4.734	0	(92)	(92)	0,00
	01.2021	£ 736	983	0	(23)	(23)	0,00
	01.2021	\$ 1.126	€ 933	16	0	16	0,00
	01.2021	1.564	£ 1.152	11	0	11	0,00
	01.2021	5.703	¥ 593.740	48	0	48	0,00
	01.2021	1.020	NZD 1.450	24	0	24	0,00
	01.2021	846	RUB 64.745	29	0	29	0,00
	02.2021	¥ 54.217	\$ 523	0	(2)	(2)	0,00
GLM	01.2021	10.832.653	104.663	0	(264)	(264)	0,00
	01.2021	MYR 7.629	1.882	0	(15)	(15)	0,00
	01.2021	\$ 616	CAD 785	0	0	0	0,00
	01.2021	1.854	MXN 37.365	21	0	21	0,00
	01.2021	1.859	MYR 7.629	38	0	38	0,00
	02.2021	104.692	¥ 10.832.653	266	0	266	0,00
	02.2021	1.886	MYR 7.651	19	0	19	0,00
HUS	01.2021	CAD 692	\$ 534	0	(9)	(9)	0,00
	01.2021	CNY 317.859	48.614	11	(1)	10	0,00
	01.2021	€ 3.289	4.002	0	(23)	(23)	0,00
	01.2021	£ 19	25	0	0	0	0,00
	01.2021	IDR 34.692.139	2.447	0	(23)	(23)	0,00
	01.2021	KRW 9.628.144	8.810	0	(53)	(53)	0,00
	01.2021	\$ 48.715	CNY 317.859	0	(111)	(111)	0,00
	01.2021	469	CZK 10.277	10	0	10	0,00
	01.2021	317	€ 258	0	(1)	(1)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond 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
	01.2021	\$ 37.977	£ 28.394	\$ 838	\$ 0	\$ 838	0,01
	01.2021	2.452	IDR 34.692.139	18	0	18	0,00
	01.2021	9.564	¥ 996.716	90	0	90	0,00
	01.2021	8.849	KRW 9.628.144	14	0	14	0,00
	01.2021	3.150	SEK 26.797	113	0	113	0,00
	02.2021	TWD 41.696	\$ 1.494	4	0	4	0,00
	02.2021	\$ 49.198	CNY 322.367	229	0	229	0,00
	02.2021	2.441	IDR 34.704.629	48	0	48	0,00
	02.2021	8.821	KRW 9.638.735	44	0	44	0,00
JPM	01.2021	€ 525	\$ 641	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	IDR 8.756.258	621	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 2.194	AUD 2.981	107	0	107	0,00
	01.2021	617	IDR 8.756.258	6	0	6	0,00
	01.2021	325	ILS 1.067	7	0	7	0,00
MYI	01.2021	AUD 688	\$ 523	0	(8)	(8)	0,00
	01.2021	¥ 287.831	2.767	0	(21)	(21)	0,00
	01.2021	\$ 3.900	CHF 3.532	96	0	96	0,00
	01.2021	1.314	PLN 4.946	13	0	13	0,00
	02.2021	70	IDR 988.233	1	0	1	0,00
NGF	01.2021	1.348	SGD 1.807	19	0	19	0,00
SCX	01.2021	CNY 319.800	\$ 49.000	109	(10)	99	0,00
	01.2021	£ 461	620	0	(10)	(10)	0,00
	01.2021	PEN 1.123	311	1	0	1	0,00
	01.2021	\$ 1.282	AUD 1.741	61	0	61	0,00
	01.2021	48.710	CNY 319.800	191	0	191	0,00
	01.2021	183.942	€ 153.591	3.984	0	3.984	0,03
	01.2021	312	PEN 1.123	0	(2)	(2)	0,00
	02.2021	188.055	€ 153.591	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	312	PEN 1.123	0	(1)	(1)	0,00
SSB	01.2021	IDR 34.692.139	\$ 2.429	0	(40)	(40)	0,00
	01.2021	\$ 639	CNY 4.222	6	0	6	0,00
	01.2021	2.454	IDR 34.692.139	15	0	15	0,00
TOR	01.2021	CAD 26.614	\$ 20.890	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 20.543	CAD 26.614	347	0	347	0,00
	01.2021	41.652	¥ 4.345.309	438	0	438	0,01
	02.2021	20.892	CAD 26.614	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	KRW 9.628.144	\$ 8.849	0	(14)	(14)	0,00
	01.2021	\$ 4.307	AUD 5.858	214	0	214	0,00
	01.2021	593	ILS 1.967	20	0	20	0,00
	01.2021	8.711	KRW 9.628.144	152	0	152	0,00
	02.2021	HKD 11.584	\$ 1.494	0	0	0	0,00
				\$ 8.354	\$ (815)	\$ 7.539	0,05

Zum 31. Dezember 2020 standen fur die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschuttend, G Retail EUR (Hedged) ausschuttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W 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	01.2021	€ 393	\$ 483	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BPS	01.2021	11.175	£ 13.596	0	(78)	(78)	0,00
	01.2021	\$ 1.085.130	€ 905.649	23.006	(27)	22.979	0,14
	02.2021	858.285	700.991	0	(4)	(4)	0,00
BRC	01.2021	678.446	566.448	14.632	0	14.632	0,09
CBK	01.2021	€ 392	\$ 476	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	\$ 24.627	€ 20.482	436	0	436	0,00
HUS	01.2021	€ 5.742	\$ 6.978	0	(48)	(48)	0,00
	01.2021	\$ 52.557	€ 43.604	804	(5)	799	0,00
JPM	01.2021	1.194	978	2	0	2	0,00
MYI	01.2021	3.407	2.794	11	0	11	0,00
SCX	01.2021	1.971.054	1.645.825	42.695	0	42.695	0,26
	02.2021	1.802.119	1.471.852	0	(7)	(7)	0,00
TOR	01.2021	1.858.423	1.551.778	40.255	0	40.255	0,25
	02.2021	3.028.369	2.473.373	0	(12)	(12)	0,00
				\$ 121.843	\$ (185)	\$ 121.658	0,74

Zum 31. Dezember 2020 standen fur die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschuttend, Investor GBP (Hedged) thesaurierend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W 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	01.2021	\$ 6.963	£ 5.208	\$ 156	\$ 0	\$ 156	0,00
BRC	01.2021	£ 2.066	\$ 2.805	0	(19)	(19)	0,00
CBK	01.2021	41.125	56.151	0	(66)	(66)	0,00
	01.2021	\$ 204.541	£ 153.016	4.631	0	4.631	0,03
HUS	01.2021	£ 1.229	\$ 1.634	0	(47)	(47)	0,00
	01.2021	\$ 218.492	£ 163.355	4.813	0	4.813	0,03
MYI	01.2021	814	603	11	0	11	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SCX	01.2021	£ 23.699	\$ 31.915	\$ 0	\$ (481)	\$ (481)	0,00
	01.2021	\$ 259	£ 192	4	0	4	0,00
SSB	01.2021	228.988	171.549	5.518	0	5.518	0,03
				\$ 15.133	\$ (613)	\$ 14.520	0,09

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 32	ILS 107	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
HUS	01.2021	33	109	1	0	1	0,00
UAG	01.2021	34	112	1	0	1	0,00
				\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional NOK (Hedged) thesaurierend und 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	01.2021	NOK 2.536	\$ 290	\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	0,00
	01.2021	\$ 10.748	NOK 94.993	347	0	347	0,00
BRC	01.2021	33.858	297.311	867	0	867	0,01
CBK	01.2021	NOK 18.639	\$ 2.112	0	(65)	(65)	0,00
GLM	01.2021	61	7	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 132.232	NOK 1.166.656	4.029	0	4.029	0,02
JPM	01.2021	83.941	738.452	2.307	0	2.307	0,01
MYI	01.2021	NOK 9	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 57.163	NOK 505.816	1.914	0	1.914	0,01
RYL	01.2021	338	2.938	5	0	5	0,00
SCX	01.2021	2.245	19.804	68	0	68	0,00
SSB	01.2021	83.949	738.478	2.302	0	2.302	0,01
				\$ 11.839	\$ (72)	\$ 11.767	0,06

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	NZD 1.491	\$ 1.051	\$ 0	\$ (23)	\$ (23)	0,00
	01.2021	\$ 967	NZD 1.372	21	0	21	0,00
CBK	01.2021	732	1.040	17	0	17	0,00
GLM	01.2021	57.896	82.433	1.456	0	1.456	0,01
MYI	01.2021	NZD 567	\$ 410	2	0	2	0,00
	01.2021	\$ 58.637	NZD 83.163	1.242	0	1.242	0,01
SCX	01.2021	55.963	79.551	1.315	0	1.315	0,01
SSB	01.2021	219	308	3	0	3	0,00
UAG	01.2021	1.572	2.204	15	0	15	0,00
				\$ 4.071	\$ (23)	\$ 4.048	0,03

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional 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 Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	\$ 9	SEK 80	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2021	1	5	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	44.880	378.615	1.224	0	1.224	0,01
CBK	01.2021	1.181	10.069	45	0	45	0,00
HUS	01.2021	45.634	388.231	1.642	0	1.642	0,01
MYI	01.2021	45.975	389.651	1.474	0	1.474	0,01
SCX	01.2021	SEK 1	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 1	SEK 12	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	5	45	0	0	0	0,00
				\$ 4.385	\$ 0	\$ 4.385	0,03

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2020 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
BPS	01.2021	SGD 69.579	\$ 52.449	\$ 0	\$ (196)	\$ (196)	0,00
	02.2021	\$ 52.451	SGD 69.579	195	0	195	0,00
BRC	01.2021	334	447	4	0	4	0,00
	02.2021	78	104	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	47.461	63.905	891	0	891	0,01
GLM	02.2021	186	245	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	742	993	9	0	9	0,00
	02.2021	1.129	1.500	6	0	6	0,00
MYI	01.2021	SGD 32.669	\$ 24.550	0	(168)	(168)	0,00
	02.2021	\$ 24.551	SGD 32.669	168	0	168	0,00
NGF	01.2021	SGD 69.750	\$ 52.345	0	(430)	(430)	0,00
	01.2021	\$ 47.336	SGD 63.453	674	0	674	0,00
	02.2021	52.347	69.750	429	0	429	0,00
SCX	01.2021	22.271	29.885	341	0	341	0,00
SSB	01.2021	9.159	12.262	119	0	119	0,00
	02.2021	175	232	1	0	1	0,00
UAG	01.2021	787	1.053	10	0	10	0,00
	02.2021	168	225	2	0	2	0,00
				\$ 2.849	\$ (794)	\$ 2.055	0,01
Summe Freiverkehrsfinaanzderivate						\$ 63.162	0,39

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Ginnie Mae, TBA			
3,500 % fällig am 01.01.2051	\$ 1.500	(1.573)	(0,01)
4,000 % fällig am 01.02.2051	80.300	(85.664)	(0,52)
4,000 % fällig am 01.03.2051	15.000	(16.002)	(0,10)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2051 (j)	93.700	(97.342)	(0,60)
2,500 % fällig am 01.01.2051 (j)	162.564	(171.378)	(1,05)
2,500 % fällig am 01.02.2051 (j)	160.650	(169.079)	(1,04)
3,000 % fällig am 01.01.2051 (j)	773.300	(810.273)	(4,97)
3,000 % fällig am 01.02.2051	395.000	(414.241)	(2,54)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (1.765.552)	(10,83)
Summe Anlagen		\$ 23.279.687	142,80
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (6.977.378)	(42,80)
Nettovermögen		\$ 16.302.309	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 31. Dezember 2020 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.  
 (k) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Morgan Stanley	0,790 %	03.02.2023	30.01.2020	\$ 53.692	\$ 55.831	0,34

(l) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.633.076 als Sicherheiten verpfändet.

(m) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 89.630 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 969 als Sicherheiten erhalten.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 31.527 und Barmittel in Höhe von USD 3.666 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 164.977 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 57.990 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	5.433	123.127	(28)	128.532
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(1.765.552)	0	(1.765.552)
<b>Summen</b>	<b>\$ 816.629</b>	<b>\$ 22.365.302</b>	<b>\$ 97.756</b>	<b>\$ 23.279.687</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 19.166.988	\$ 11.577	\$ 19.178.565
Investmentfonds	1.448.325	0	0	1.448.325
Pensionsgeschäfte	0	147.907	0	147.907
Einlagen bei Kreditinstituten	0	28.364	0	28.364
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(5.178)	32.220	0	27.042
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(68.108)	0	(68.108)
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.443.147</b>	<b>\$ 19.307.371</b>	<b>\$ 11.577</b>	<b>\$ 20.762.095</b>

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

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOM	0,170 %	18.11.2020	19.01.2021	\$ (178.058)	\$ (178.095)	(1,09)
BOS	0,190	16.12.2020	14.01.2021	(75.273)	(75.279)	(0,46)
BPS	(0,480)	20.11.2020	17.02.2021	€ (47.411)	(57.978)	(0,35)
BSN	0,180	09.10.2020	11.01.2021	\$ (28.997)	(29.009)	(0,18)
	0,180	13.10.2020	13.01.2021	(44.958)	(44.976)	(0,28)
	0,180	13.11.2020	11.01.2021	(40.035)	(40.045)	(0,24)
CIB	0,160	17.12.2020	19.01.2021	(264.474)	(264.492)	(1,62)
GRE	0,160	15.12.2020	15.01.2021	(4.107)	(4.107)	(0,02)
	0,180	05.11.2020	05.01.2021	(1.352)	(1.353)	(0,01)
	0,180	13.11.2020	13.01.2021	(23.851)	(23.857)	(0,15)
IND	0,150	16.12.2020	11.02.2021	(1.192)	(1.192)	(0,01)
	0,150	18.12.2020	11.02.2021	(9.504)	(9.505)	(0,06)
JML	(0,530)	18.11.2020	17.02.2021	€ (187.696)	(229.508)	(1,41)
	(0,500)	12.11.2020	17.02.2021	(68.985)	(84.348)	(0,52)
RCY	0,160	02.12.2020	02.02.2021	\$ (56.610)	(56.618)	(0,35)
SCX	0,160	10.12.2020	11.01.2021	(57.435)	(57.441)	(0,35)
SGY	0,110	23.12.2020	20.01.2021	(5.863)	(5.863)	(0,04)
	0,190	11.12.2020	14.01.2021	(423.399)	(423.446)	(2,60)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (1.587.112)</b>	<b>(9,74)</b>

#### Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BCY	0,060 %	07.12.2020	15.01.2021	\$ (62.601)	\$ (62.603)	(0,38)
	0,100	18.12.2020	26.01.2021	(1.543)	(1.543)	(0,01)
	0,100	22.12.2020	26.01.2021	(1.181)	(1.181)	(0,01)
BPG	0,160	14.12.2020	12.01.2021	(709)	(709)	0,00
	0,180	12.11.2020	11.01.2021	(5.178)	(5.179)	(0,03)
	0,180	12.11.2020	27.01.2021	(5.336)	(5.338)	(0,03)
	0,180	14.12.2020	29.01.2021	(5.673)	(5.674)	(0,04)
MSC	0,180	12.11.2020	14.01.2021	(5.882)	(5.884)	(0,04)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (88.111)</b>	<b>(0,54)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 4 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 1.921	\$ 0	\$ 1.921
BOA	(618)	(630)	(1.248)
BPS	18.320	(21.260)	(2.940)
BRC	7.501	(10.290)	(2.789)
BSS	281	(320)	(39)
CBK	14.429	(3.920)	10.509
CIB	8.147	(9.310)	(1.163)
DUB	272	(620)	(348)
FAR	0	80	80
FBF	1.404	(1.310)	94
GLM	(433)	6.340	5.907
GST	(902)	1.030	128
HUS	7.634	(6.390)	1.244
IND	(642)	520	(122)
JLN	(11)	0	(11)
JPM	417	(750)	(333)
MYC	4.860	(2.020)	2.840
MYI	10.662	(11.150)	(488)
NGF	692	(590)	102
RBC	126	0	126
RYL	5	0	5
SAL	(494)	360	(134)
SCX	40.872	(52.790)	(11.918)
SSB	(16.271)	11.120	(5.151)
TOR	(19.493)	22.700	3.207
UAG	(15.517)	15.840	323

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	70,48	72,34
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	71,99	55,50
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,98	k. A.
Investmentfonds	8,27	9,66
Pensionsgeschäfte	0,12	0,99
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,03	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,37	(0,16)
Freiverkehrsfinauzderivate	0,39	0,37
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,83)	(0,45)
Einlagenzertifikate	k. A.	0,19
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(9,74)	(5,12)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,54)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Argentinien	0,00	k. A.
Australien	2,57	0,46
Österreich	0,08	k. A.
Belgien	0,10	0,10
Brasilien	0,39	0,32
Kanada	2,09	2,89
Cayman-Inseln	4,21	2,48
Chile	0,08	k. A.
China	6,98	4,42
Dänemark	4,05	4,95
Finnland	0,01	0,05
Frankreich	3,07	2,27
Deutschland	3,13	3,22
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,09
Hongkong	0,51	0,60
Ungarn	0,02	0,00
Indien	0,09	0,16
Indonesien	0,07	0,06
Irland	1,90	1,65
Israel	1,83	0,12
Italien	2,71	4,36
Japan	9,97	10,42
Jersey, Kanalinseln	0,08	0,08
Kasachstan	0,00	0,00
Kuwait	0,40	0,43
Litauen	0,10	0,28
Luxemburg	1,01	1,00

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Malaysia	0,49	k. A.
Mauritius	0,04	0,04
Mexiko	0,11	0,05
Marokko	k. A.	0,07
Multinational	0,12	0,15
Niederlande	2,19	2,25
Neuseeland	0,32	0,18
Norwegen	0,22	0,41
Panama	0,05	k. A.
Peru	1,20	0,66
Polen	0,06	0,09
Portugal	0,01	0,01
Katar	1,02	1,08
Rumänien	0,11	0,00
Russland	0,10	0,11
Saudi-Arabien	0,81	1,51
Singapur	0,36	0,25
Slowenien	0,43	0,46
Südafrika	0,07	0,06
Südkorea	0,94	0,98
Spanien	4,01	4,78
Supranational	0,31	0,16
Schweden	0,08	0,33
Schweiz	0,67	0,73
Vereinigte Arabische Emirate	0,53	0,48
Großbritannien	12,18	11,84
USA	68,33	56,67
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	0,13
Kurzfristige Instrumente	4,24	3,95
Investmentfonds	8,27	9,66
Pensionsgeschäfte	0,12	0,99
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,03	(0,03)
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,08)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,06
Zinsswaps — Basisswaps	(0,01)	0,01
Zinsswaps	0,46	(0,21)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,01
Zinsswapoptionen	0,06	0,15
Optionen auf Wertpapiere	0,01	0,00
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Devisenoptionen	(0,01)	(0,01)
Inflation-Capped Options	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,15)
Zinsscaps	0,01	0,00
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,03)	(0,05)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,00
Cross-Currency Swaps	0,14	0,03
Zinsswaps	k. A.	0,05
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	(0,05)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	0,05	0,02
Devisenterminkontrakte	(0,97)	(0,77)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,17	1,15
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,83)	(0,45)
Einlagenzertifikate	k. A.	0,19
Sonstige Aktiva und Passiva	(42,80)	(38,41)
Nettovermögen	100,00	100,00





## Aufstellung der Wertpapieranlagen

## Global 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
<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
Chicago Transit Authority, Illinois Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				Canterbury Finance No. 1 PLC				Miravet SARL			
6,200 % fällig am 01.12.2040	\$ 100	\$ 139	0,01	1,405 % fällig am 16.05.2056	£ 2.100	\$ 2.872	0,19	0,322 % fällig am 26.05.2065	€ 1.900	\$ 2.281	0,15
Los Angeles Community College District, California General Obligation Bonds, Series 2020				Chase Mortgage Finance Trust				Mulcair Securities DAC			
2,106 % fällig am 01.08.2032	1.900	1.982	0,13	3,276 % fällig am 25.07.2037	\$ 12		0,00	0,489 % fällig am 24.04.2071	1.304	1.596	0,11
State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020				Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				New Residential Mortgage Loan Trust			
1,705 % fällig am 01.07.2027	3.000	3.116	0,21	0,653 % fällig am 16.01.2057	£ 1.384	1.888	0,12	3,500 % fällig am 25.12.2057	\$ 2.162	2.293	0,15
		5.237	0,35	Citigroup Commercial Mortgage Trust				Paragon Mortgages PLC			
				3,209 % fällig am 10.05.2049	\$ 2.100	2.333	0,15	0,286 % fällig am 15.01.2039	£ 569	764	0,05
				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				1,105 % fällig am 15.05.2045	706	970	0,06
				2,805 % fällig am 25.12.2035 ^	547	436	0,03	Pepper Residential Securities Trust			
				Commercial Mortgage Trust				1,219 % fällig am 16.09.2059	AUD 205	158	0,01
				3,590 % fällig am 10.11.2047	2.000	2.185	0,14	Real Estate Asset Liquidity Trust			
				4,228 % fällig am 10.05.2051	1.700	2.027	0,13	3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD 293	237	0,02
				Countrywide Alternative Loan Trust				Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
				0,388 % fällig am 25.06.2036	116	112	0,01	0,298 % fällig am 25.06.2037 ^	\$ 463	397	0,03
				0,388 % fällig am 25.11.2036	112	125	0,01	1,812 % fällig am 25.11.2037	356	327	0,02
				0,388 % fällig am 25.08.2047	1.425	1.319	0,09	6,000 % fällig am 25.06.2036	578	564	0,04
				0,568 % fällig am 25.07.2046 ^	643	587	0,04	Residential Mortgage Securities PLC			
				5,500 % fällig am 25.11.2034	294	311	0,02	0,837 % fällig am 20.03.2050	£ 692	945	0,06
				6,250 % fällig am 25.12.2036	1.168	761	0,05	0,984 % fällig am 20.12.2046	660	903	0,06
				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				1,304 % fällig am 20.06.2070	1.891	2.601	0,17
				0,688 % fällig am 25.04.2046	2.077	792	0,05	RESIMAC Bastille Trust			
				0,728 % fällig am 25.03.2035 ^	478	411	0,03	1,083 % fällig am 05.09.2057	\$ 407	408	0,03
				0,828 % fällig am 25.03.2035 ^	104	95	0,01	RESIMAC Premier Series			
				6,000 % fällig am 25.07.2036	364	288	0,02	1,203 % fällig am 07.02.2052	2.927	2.929	0,19
				3,000 % fällig am 25.12.2036 ^	807	542	0,04	Ripon Mortgages PLC			
				6,000 % fällig am 25.03.2037	868	694	0,05	0,851 % fällig am 20.08.2056	£ 2.344	3.203	0,21
				6,500 % fällig am 25.11.2047	106	79	0,01	RMAC PLC			
				Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				0,741 % fällig am 12.06.2046	1.083	1.472	0,10
				0,448 % fällig am 25.09.2047 ^	1.055	945	0,06	1,011 % fällig am 12.06.2046	601	822	0,05
				Durham Mortgages B PLC				RMAC Securities PLC			
				0,651 % fällig am 31.03.2054	£ 1.218	1.661	0,11	0,211 % fällig am 12.06.2044	48	64	0,00
				EMF-UK PLC				Sequoia Mortgage Trust			
				1,021 % fällig am 13.03.2046	311	424	0,03	3,225 % fällig am 20.07.2037	\$ 343	314	0,02
				Eurohome UK Mortgages PLC				Stratton Mortgage Funding PLC			
				0,193 % fällig am 15.06.2044	46	61	0,00	0,954 % fällig am 12.03.2052	£ 3.094	4.198	0,28
				EuroMASTR PLC				Structured Asset Securities Corp.			
				0,243 % fällig am 15.06.2040	60	79	0,01	0,428 % fällig am 25.01.2036	\$ 170	154	0,01
				European Residential Loan Securitisation DAC				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
				0,276 % fällig am 24.03.2063	£ 785	961	0,06	0,438 % fällig am 25.10.2036	365	316	0,02
				Eurosail PLC				TBW Mortgage-Backed Trust			
				0,000 % fällig am 13.03.2045	289	351	0,02	5,965 % fällig am 25.07.2037	2.863	1.450	0,10
				0,203 % fällig am 15.12.2044	£ 52	71	0,00	Towd Point Mortgage Funding PLC			
				Finsbury Square PLC				0,956 % fällig am 20.07.2045	£ 1.634	2.234	0,15
				0,000 % fällig am 16.06.2070	3.791	5.220	0,35	1,073 % fällig am 20.10.2051	1.381	1.896	0,13
				0,691 % fällig am 12.09.2065	192	262	0,02	Tower Bridge Funding PLC			
				0,991 % fällig am 12.09.2068	1.083	1.483	0,10	1,425 % fällig am 20.09.2063	3.299	4.533	0,30
				1,084 % fällig am 16.09.2069	2.440	3.345	0,22	Trinidad Mortgage Securities PLC			
				First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				0,846 % fällig am 24.01.2059	480	655	0,04
				6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	\$ 42	25	0,00	Twin Bridges PLC			
				Friary No. 6 PLC				0,991 % fällig am 12.12.2052	1.202	1.645	0,11
				0,775 % fällig am 21.11.2067	£ 1.170	1.612	0,11	Uropa Securities PLC			
				GSR Mortgage Loan Trust				0,396 % fällig am 10.10.2040	343	428	0,03
				3,453 % fällig am 25.10.2035 ^	\$ 47	46	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
				3,835 % fällig am 25.11.2035	140	140	0,01	1,609 % fällig am 25.02.2046	\$ 417	412	0,03
				Harben Finance PLC				2,782 % fällig am 25.09.2033	70	70	0,00
				0,851 % fällig am 20.08.2056	£ 326	446	0,03	2,917 % fällig am 25.10.2035	139	141	0,01
				Hawksmoor Mortgages PLC				3,046 % fällig am 25.09.2036	91	85	0,01
				1,104 % fällig am 25.05.2053	4.101	5.615	0,37	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
				Impac Secured Assets Trust				0,598 % fällig am 25.04.2035	473	370	0,02
				0,408 % fällig am 25.01.2037	\$ 772	712	0,05			104.319	6,91
				IndyMac Mortgage Loan Trust				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
				2,900 % fällig am 25.12.2034	185	188	0,01	Accunia European CLO BV			
				JPMorgan Alternative Loan Trust				0,950 % fällig am 15.07.2030	€ 500	612	0,04
				0,628 % fällig am 25.10.2036	357	346	0,02	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
				JPMorgan Mortgage Trust				1,048 % fällig am 25.12.2034	\$ 136	132	0,01
				3,001 % fällig am 25.08.2035	179	184	0,01	1,048 % fällig am 25.08.2035	1.600	1.593	0,11
				6,000 % fällig am 25.06.2037	935	594	0,04	AlbaCore EURO CLO DAC			
				Jupiter Mortgage Ltd.				1,530 % fällig am 18.07.2031	€ 900	1.108	0,07
				1,000 % fällig am 01.06.2060 (a)	£ 4.700	6.369	0,42	ALME Loan Funding DAC			
				Lanark Master Issuer PLC				0,750 % fällig am 15.01.2031	500	609	0,04
				0,866 % fällig am 22.12.2069	633	868	0,06	Arbour CLO DAC			
				Lehman XS Trust				0,580 % fällig am 15.03.2029	801	978	0,07
				1,359 % fällig am 25.03.2047	\$ 636	605	0,04				
				Ludgate Funding PLC							
				0,221 % fällig am 01.01.2061	£ 54	71	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			
Argent Securities Trust 0,508 % fällig am 25.04.2036	\$	5.462	2.616	0,17	Marathon CLO Ltd. 1,083 % fällig am 21.11.2027	\$	446	443	0,03	Venture CLO Ltd. 1,117 % fällig am 15.04.2027	\$	184	183	0,01
Babson Euro CLO BV 0,309 % fällig am 25.10.2029	€	487	592	0,04	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 0,268 % fällig am 25.02.2037	718	294	0,02	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 0,378 % fällig am 25.01.2037	\$	3.300	\$	3.088	0,20
Bayview Financial Asset Trust 3,161 % fällig am 25.03.2037	\$	137	134	0,01	0,868 % fällig am 25.05.2036	107	106	0,01						
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 1,123 % fällig am 25.03.2035	731	732	0,05	Monarch Grove CLO Ltd. 1,095 % fällig am 25.01.2028	690	685	0,05							
BlueMountain Fuji Eur CLO DAC 0,910 % fällig am 15.01.2033	€	2.850	3.484	0,23	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,218 % fällig am 25.10.2036	978	594	0,04	<b>STAATSEMISSIONEN</b>					
Bumper UK Finance PLC 0,653 % fällig am 20.12.2028	£	809	1.106	0,07	0,398 % fällig am 25.07.2036	89	80	0,01	Action Logement Services 0,500 % fällig am 30.10.2034	€	2.100	2.701	0,18	
Cairn CLO BV 0,650 % fällig am 20.10.2028	€	421	515	0,03	0,748 % fällig am 25.12.2034	478	448	0,03	Adif Alta Velocidad 0,550 % fällig am 30.04.2030	1.400	1.775	0,12		
CIT Mortgage Loan Trust 1,498 % fällig am 25.10.2037	\$	75	75	0,01	0,823 % fällig am 25.09.2035	3.300	3.205	0,21	Agence Francaise de Developpement 0,000 % fällig am 28.10.2027 (b)	1.600	2.001	0,13		
Countrywide Asset-Backed Certificates 0,288 % fällig am 25.07.2037	244	223	0,01	1,108 % fällig am 25.09.2034	1.060	1.032	0,07	Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD	12.700	9.827	0,65		
0,368 % fällig am 25.09.2037 ^	349	334	0,02	Morgan Stanley Structured Trust 0,448 % fällig am 25.06.2037	2.900	2.655	0,18	1,750 % fällig am 21.06.2051	7.600	5.580	0,37			
0,398 % fällig am 25.02.2036	810	760	0,05	Mountain Hawk CLO Ltd. 1,418 % fällig am 18.04.2025	38	38	0,00	Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035	€	200	331	0,02		
1,123 % fällig am 25.01.2036	3.100	3.118	0,21	Mountain View CLO Ltd. 1,037 % fällig am 15.10.2026	1.573	1.572	0,10	4,900 % fällig am 15.09.2021	8.800	11.147	0,74			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 0,608 % fällig am 25.05.2036	180	179	0,01	New Century Home Equity Loan Trust 0,883 % fällig am 25.06.2035	1.280	1.278	0,08	Autonomous Community of Madrid 0,419 % fällig am 30.04.2030	900	1.132	0,07			
Crown Point CLO Ltd. 1,158 % fällig am 17.07.2028	1.512	1.510	0,10	NovoStar Mortgage Funding Trust 0,248 % fällig am 25.01.2037	2.817	1.246	0,08	0,747 % fällig am 30.04.2022	900	1.119	0,07			
CVC Cordatus Loan Fund Ltd. 0,970 % fällig am 22.04.2030	€	250	306	0,02	0,688 % fällig am 25.05.2036	1.700	1.589	0,11	1,773 % fällig am 30.04.2028	1.500	2.080	0,14		
Dartry Park CLO DAC 0,830 % fällig am 28.04.2029	70	86	0,01	Ocean Trails CLO LLC 1,387 % fällig am 15.07.2028	1.176	1.176	0,08	BNG Bank NV 3,300 % fällig am 17.07.2028	AUD	3.000	2.693	0,18		
Driver Espana Four 0,000 % fällig am 21.04.2028	30	37	0,00	OCF CLO Ltd. 1,068 % fällig am 17.04.2027	102	102	0,01	Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.12.2044 (d)	CAD	476	538	0,04		
Dryden Euro CLO BV 0,880 % fällig am 15.01.2030	1.300	1.591	0,11	1,338 % fällig am 20.07.2029	3.100	3.103	0,21	Chile Government International Bond 1,250 % fällig am 29.01.2040	€	3.500	4.517	0,30		
Dryden Senior Loan Fund 1,137 % fällig am 15.10.2027	\$	505	504	0,03	Option One Mortgage Loan Trust 0,288 % fällig am 25.01.2037	326	244	0,02	China Development Bank 3,050 % fällig am 25.08.2026	CNY	34.700	5.218	0,35	
Encore Credit Receivables Trust 0,838 % fällig am 25.07.2035	527	514	0,03	0,288 % fällig am 25.03.2037	1.520	1.205	0,08	3,180 % fällig am 05.04.2026	20.600	3.134	0,21			
Euro-Galaxy CLO BV 0,820 % fällig am 10.11.2030	€	1.600	1.958	0,13	0,328 % fällig am 25.04.2037	3.525	2.268	0,15	3,340 % fällig am 14.07.2025	43.600	6.704	0,44		
Evans Grove CLO Ltd. 1,144 % fällig am 28.05.2028	\$	254	253	0,02	OZLM Funding Ltd. 1,446 % fällig am 22.07.2029	2.769	2.766	0,18	3,430 % fällig am 08.01.2027	35.000	5.357	0,35		
Fair Oaks Loan Funding DAC 1,900 % fällig am 15.07.2031	€	800	985	0,07	Palmer Square European Loan Funding DAC 0,870 % fällig am 15.02.2030	€	2.600	3.180	0,21	3,450 % fällig am 20.09.2029	13.700	2.069	0,14	
Fieldstone Mortgage Investment Trust 0,828 % fällig am 25.02.2036	\$	2.000	1.983	0,13	1,150 % fällig am 15.01.2030	2.500	3.065	0,20	3,480 % fällig am 10.09.2029	16.600	2.517	0,17		
Fremont Home Loan Trust 1,213 % fällig am 25.06.2035	200	199	0,01	Palmer Square Loan Funding Ltd. 1,121 % fällig am 15.11.2026	\$	590	589	0,04	3,500 % fällig am 13.08.2026	29.000	4.461	0,30		
Gallatin CLO Ltd. 1,259 % fällig am 21.01.2028	568	566	0,04	PCL Funding PLC 1,104 % fällig am 15.09.2024	€	1.900	2.600	0,17	3,650 % fällig am 21.05.2029	16.500	2.528	0,17		
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 1,550 % fällig am 20.07.2031	€	2.100	2.577	0,17	Penta CLO BV 0,790 % fällig am 04.08.2028	€	164	200	0,01	3,680 % fällig am 26.02.2026	67.600	10.529	0,70	
Grosvenor Place CLO BV 0,720 % fällig am 30.10.2029	679	830	0,06	Pepper SPARKZ Trust No.3 1,067 % fällig am 17.08.2028	AUD	3.200	2.469	0,16	3,740 % fällig am 10.09.2025	10.200	1.593	0,11		
GSAMP Trust 0,648 % fällig am 25.05.2046	\$	1.400	1.340	0,09	Renaissance Home Equity Loan Trust 5,762 % fällig am 25.08.2036	\$	728	419	0,03	3,800 % fällig am 25.01.2036	4.000	609	0,04	
1,198 % fällig am 25.10.2034	49	49	0,00	SLM Student Loan Trust 0,000 % fällig am 25.01.2024	€	20	24	0,00	4,040 % fällig am 10.04.2027	32.100	5.068	0,34		
Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029	€	399	487	0,03	SoFi Consumer Loan Program LLC 2,500 % fällig am 26.05.2026	\$	15	15	0,00	4,040 % fällig am 06.07.2028	19.200	3.035	0,20	
Home Equity Asset Trust 0,598 % fällig am 25.02.2036	\$	1.000	963	0,06	Sorrento Park CLO DAC 0,437 % fällig am 16.11.2027	€	75	91	0,01	4,150 % fällig am 26.10.2025	2.400	381	0,02	
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 0,368 % fällig am 25.04.2037	343	294	0,02	Soundview Home Loan Trust 0,468 % fällig am 25.11.2036	\$	3.069	3.057	0,20	4,240 % fällig am 24.08.2027	174.800	27.963	1,85		
2,098 % fällig am 25.03.2035	1.295	1.252	0,08	0,553 % fällig am 25.12.2036	1.500	1.458	0,10	4,880 % fällig am 09.02.2028	26.400	4.400	0,29			
ICG U.S. CLO Ltd. 1,596 % fällig am 22.10.2031	3.100	3.105	0,21	0,648 % fällig am 25.11.2036	1.200	1.137	0,08	China Government Bond 2,740 % fällig am 04.08.2026	43.100	6.503	0,43			
Jamestown CLO Ltd. 0,927 % fällig am 15.07.2026	28	28	0,00	Telos CLO Ltd. 1,488 % fällig am 17.01.2027	71	71	0,00	2,850 % fällig am 04.06.2027	19.100	2.869	0,19			
JMP Credit Advisors CLO Ltd. 1,068 % fällig am 17.01.2028	665	662	0,04	Terwin Mortgage Trust 1,088 % fällig am 25.11.2033	6	6	0,00	2,950 % fällig am 16.06.2023	1.500	230	0,02			
Jubilee CLO BV 0,257 % fällig am 15.12.2029	€	1.000	1.218	0,08	TICP CLO Ltd. 1,058 % fällig am 20.04.2028	996	991	0,07	3,220 % fällig am 06.12.2025	1.500	232	0,02		
Long Beach Mortgage Loan Trust 0,748 % fällig am 25.01.2036	\$	955	856	0,06	Toro European CLO DAC 0,920 % fällig am 15.07.2030	€	700	857	0,06	3,290 % fällig am 18.10.2023	4.500	697	0,05	
Loomis Sayles CLO Ltd. 1,137 % fällig am 15.04.2028	925	922	0,06	Trestles CLO Ltd. 1,505 % fällig am 25.07.2029	\$	2.900	2.904	0,19	3,820 % fällig am 02.11.2027	18.800	3.016	0,20		
Mackay Shields Euro CLO DAC 1,550 % fällig am 15.08.2033	€	1.100	1.356	0,09	Utah State Board of Regents 0,900 % fällig am 25.01.2057	49	49	0,00	Croatia Government International Bond 1,500 % fällig am 17.06.2031	€	2.100	2.817	0,19	

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond 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
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.500	\$ 1.883	0,12	Peru Government International Bond	1.500	\$ 1.516	0,10	1,450 % fällig am 30.04.2029	1.400	1.936	0,13
0,500 % fällig am 01.02.2026	250	326	0,02	2,780 % fällig am 01.12.2060	1.100	317	0,02	1,850 % fällig am 30.07.2035	3.800	5.635	0,37
1,700 % fällig am 01.09.2051	6.400	8.522	0,56	5,350 % fällig am 12.08.2040	1.900	580	0,04	Tokyo Metropolitan Government			
1,850 % fällig am 01.07.2025				5,400 % fällig am 12.08.2034	14.200	4.900	0,32	2,000 % fällig am 17.05.2021	\$ 300	\$ 302	0,02
Italy Government International Bond				5,940 % fällig am 12.02.2029	2.100	713	0,05	2,500 % fällig am 08.06.2022	900	926	0,06
6,875 % fällig am 27.09.2023	\$ 2.100	2.441	0,16	6,150 % fällig am 12.08.2032	21.400	7.521	0,50	2,625 % fällig am 29.05.2024	400	428	0,03
Japan Bank for International Cooperation				6,350 % fällig am 12.08.2028				Treasury Corp. of Victoria			
1,750 % fällig am 17.10.2024	200	210	0,01	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia	\$ 1.700	2.012	0,13	4,250 % fällig am 20.12.2032	AUD 1.700	1.712	0,11
Japan Finance Organization for Municipalities				4,450 % fällig am 20.02.2029				United Kingdom Gilt			
2,125 % fällig am 13.04.2021	600	603	0,04	Poland Government International Bond				0,625 % fällig am 22.10.2050	£ 1.500	1.987	0,13
2,625 % fällig am 20.04.2022	1.900	1.955	0,13	3,250 % fällig am 25.07.2025	1.000	303	0,02			366.923	24,31
3,000 % fällig am 12.03.2024	500	538	0,04	Province of Ontario							
3,375 % fällig am 27.09.2023	200	216	0,01	1,850 % fällig am 01.02.2027	CAD 2.800	2.327	0,15				
Japan Government International Bond				Province of Quebec							
0,100 % fällig am 10.03.2028 (d)	¥ 754.470	7.329	0,49	0,000 % fällig am 29.10.2030 (b)	€ 6.000	7.398	0,49				
0,500 % fällig am 20.09.2046	597.000	5.730	0,38	1,650 % fällig am 03.03.2022	CAD 1.800	1.437	0,09	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>			
0,500 % fällig am 20.03.2049	1.358.000	12.789	0,85	1,850 % fällig am 13.02.2027	2.700	2.250	0,15	Nationwide Building Society			
0,700 % fällig am 20.12.2048	1.262.000	12.531	0,83	2,450 % fällig am 01.03.2023	2.000	1.643	0,11	10,250 %	750	182	0,01
1,200 % fällig am 20.09.2035	398.000	4.399	0,29	3,500 % fällig am 01.12.2022	500	417	0,03				
1,300 % fällig am 20.06.2035	90.000	1.006	0,07	Qatar Government International Bond							
1,400 % fällig am 20.09.2034	350.000	3.946	0,26	3,750 % fällig am 16.04.2030	\$ 300	354	0,02				
Lithuania Government International Bond				Queensland Treasury Corp.							
0,100 % fällig am 01.04.2023	€ 3.800	4.695	0,31	1,750 % fällig am 21.08.2031	AUD 300	243	0,02	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
6,125 % fällig am 09.03.2021	\$ 100	101	0,01	Regie Autonome des Transports Parisiens	€ 300	395	0,03	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
Malaysia Government International Bond				0,875 % fällig am 25.05.2027	€ 300	395	0,03	(0,107) % fällig am			
3,502 % fällig am 31.05.2027	MYR 2.200	584	0,04	Bundesrepublik Deutschland	9.500	12.331	0,82	29.03.2021 (b)(c)	¥ 10.330.000	100.077	6,63
3,906 % fällig am 15.07.2026	2.200	593	0,04	0,000 % fällig am 15.08.2030 (b)				(0,090) % fällig am	6.440.000	62.386	4,13
Malaysia Government Investment Issue				Romania Government International Bond				08.03.2021 (b)(c)	6.440.000	62.386	4,13
4,130 % fällig am 09.07.2029	3.600	991	0,07	1,375 % fällig am 02.12.2029	900	1.122	0,07	(0,089) % fällig am	1.390.000	13.464	0,89
4,369 % fällig am 31.10.2028	1.900	529	0,03	2,625 % fällig am 02.12.2040	500	653	0,04	18.01.2021 (b)(c)		175.927	11,65
Mexico Government International Bond				Russia Government International Bond				Summe kurzfristige Instrumente		175.927	11,65
5,000 % fällig am 27.04.2051	\$ 500	624	0,04	7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB 43.500	664	0,04	Summe Übertragbare Wertpapiere		2.052.641	135,98
Nederlandse Waterschapsbank NV				Slovenia Government International Bond							
2,375 % fällig am 24.03.2026	1.000	1.092	0,07	1,188 % fällig am 14.03.2029	€ 700	958	0,06				
New South Wales Treasury Corp.				5,250 % fällig am 18.02.2024	\$ 928	1.067	0,07	<b>AKTIEN</b>			
2,000 % fällig am 20.03.2031	AUD 2.100	1.735	0,11	Societe Du Grand Paris EPIC	€ 4.400	5.500	0,36	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
New Zealand Government International Bond				0,700 % fällig am 15.10.2060				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD 2.100	1.588	0,10	South Africa Government International Bond	\$ 1.000	1.064	0,07	PIMCO Funds: Global Investors			
1,750 % fällig am 15.05.2041	600	427	0,03	4,850 % fällig am 30.09.2029				Series plc - Global			
Northern Territory Treasury Corp.				Spain Government International Bond				Investment Grade Credit			
2,000 % fällig am 21.04.2031	AUD 1.100	888	0,06	0,250 % fällig am 30.07.2024	€ 2.400	3.019	0,20	ESG Fund (f)	580.000	6.629	0,44
Panama Government International Bond				1,000 % fällig am 31.10.2050	700	888	0,06	Summe Investmentfonds		\$ 6.629	0,44
4,300 % fällig am 29.04.2053	\$ 200	255	0,02	1,250 % fällig am 31.10.2030	14.800	20.249	1,34				
4,500 % fällig am 01.04.2056	300	388	0,03	1,400 % fällig am 30.07.2028	4.300	5.897	0,39				

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	0,090 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 45.700	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024	\$ (46.725)	\$ 45.700	\$ 45.700	3,03
FICC	0,000	31.12.2020	04.01.2021	5.041	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	(5.142)	5.041	5.041	0,33
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (51.867)	\$ 50.741	\$ 50.741	3,36

(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
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2021	73	\$ (4)	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	241	88	0,01
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	176	(37)	(0,01)
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2021	35	6	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	495	727	0,05
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	155	(18)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	11	8	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	88	11	0,00

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2021	807	\$ 95	0,01
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	23	(25)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2021	154	32	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	557	150	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	216	19	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	18	25	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	70	(140)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	8	(15)	0,00
				\$ 922	0,06

## OPTIONSKAUF

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call - CME 90-Day Eurodollar June 2022 Futures	\$ 99,750	13.06.2022	46	\$ 11	\$ 13	0,00
Call - CME 90-Day Eurodollar March 2022 Futures	99,750	14.03.2022	24	5	6	0,00
				\$ 16	\$ 19	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 941	0,06

## 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 Nettovermögens
3-Month USD-LIBOR <sup>(1)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,091 %	18.03.2022	\$ 160.300	\$ (68)	(0,01)
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	12.06.2022	1.100	0	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 <sup>(1)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,073 %	27.04.2023	13.700	(3)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(1)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,088 %	06.09.2024	46.500	(13)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(1)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,011 %	27.09.2024	14.200	(5)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(1)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,010 %	04.10.2024	13.400	(3)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(1)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,084 %	26.04.2022	21.400	(9)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(1)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	07.03.2024	6.300	0	0,00
				\$ (104)	(0,01)

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,684 %	30.04.2025	\$ 900	\$ (114)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,696	30.04.2025	900	(114)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,710	30.04.2025	1.000	(128)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,714	30.04.2025	1.900	(243)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,850	03.01.2022	BRL 42.400	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022	110.600	(8)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	29.900	(2)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,871	03.01.2022	41.300	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,300	03.01.2022	562.900	693	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	35.300	(1)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,270	03.03.2022	CAD 7.000	66	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2022	2.500	19	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	300	10	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	42.000	698	0,05
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029	1.400	59	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	13.200	563	0,04
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2029	17.900	1.209	0,08
Zahlung	3-Month CHF-LIBOR	0,500	16.09.2025	CHF 36.100	139	0,01
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	0,908	16.12.2030	KRW 2.700.000	(66)	0,00
Erhalt	3-Month NZD-BBR	0,500	16.12.2025	NZD 1.200	5	0,00
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	2,405	30.01.2029	PLN 1.300	48	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	SEK 11.700	44	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,400	15.01.2028	\$ 31.000	(272)	(0,02)
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,750	30.03.2031	73.700	896	0,06
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	6.700	(11)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025	29.900	33	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	9.600	20	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	57.200	18	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,249	31.08.2024	8.800	(247)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025	5.100	(20)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,250	09.06.2041	9.600	12	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond ESG Fund (Forts.)

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	\$ (2)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,298	25.08.2024	600	(18)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,306	21.08.2023	11.450	(382)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,325	02.12.2050	1.500	74	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,635	31.08.2051	1.050	56	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2021	38.000	(341)	(0,02)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	20.06.2023	ZAR 11.400	61	0,01
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 8.100	(18)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK 7.400	24	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2051	€ 3.500	(109)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	16.06.2051	8.200	28	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	600	1	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,060	17.11.2032	3.900	28	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	1.300	(33)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	17.03.2031	9.100	(2)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031	5.800	(13)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035	200	(2)	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2023	48.000	40	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.03.2026	1.000	5	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2026	2.000	(6)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,310	19.06.2029	900	57	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2023	£ 7.000	6	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	1.300	(1)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	17.03.2031	6.600	16	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	16.06.2031	5.100	26	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	17.03.2051	900	9	0,00
Zahlung	6-Month GBP-LIBOR	0,500	17.06.2050	400	23	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,035	29.11.2029	¥ 1.500.000	(27)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,200	19.06.2029	1.060.000	(19)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,400	19.06.2039	430.000	(128)	(0,01)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,500	19.06.2049	210.000	(43)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN 20.400	9	0,00
Erhalt	UKRPI	3,000	15.11.2050	£ 1.300	78	0,01
Erhalt	UKRPI	3,051	15.11.2050	1.100	58	0,00
Erhalt	UKRPI	3,143	15.11.2050	600	(19)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,217	15.11.2040	3.150	(82)	(0,01)
Erhalt	UKRPI	3,258	15.02.2025	9.000	(233)	(0,01)
Erhalt	UKRPI	3,262	15.02.2025	9.900	(260)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	3,272	15.11.2040	1.100	(19)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,273	15.11.2040	1.550	(27)	0,00
Erhalt	UKRPI	3,334	15.08.2025	7.800	(56)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,340	15.11.2040	1.470	21	0,00
Erhalt	UKRPI	3,355	15.11.2025	4.000	(19)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,386	15.01.2030	1.100	32	0,00
Erhalt	UKRPI	3,397	15.11.2030	1.850	(9)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,436	15.02.2030	700	23	0,00
Erhalt	UKRPI	3,445	15.11.2030	1.550	(9)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,450	15.02.2030	2.000	69	0,01
Zahlung	UKRPI	3,453	15.02.2030	10.600	385	0,03
Zahlung	UKRPI	3,473	15.11.2030	4.000	44	0,00
Zahlung	UKRPI	3,475	15.08.2030	9.500	163	0,01
Erhalt	UKRPI	3,510	15.11.2030	870	(16)	0,00
					\$ 2.745	0,18
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 2.641	0,17

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

### OPTIONSKAUF

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,300 %	13.10.2021	9.000	\$ 94	\$ 106	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,175	15.09.2021	2.100	87	21	0,00
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,306	29.10.2021	300	22	14	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,306	29.10.2021	300	22	25	0,00
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,370	25.10.2021	800	57	43	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,370	25.10.2021	800	57	58	0,01
FBF	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,733	26.08.2021	2.500	185	68	0,01
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,365	22.10.2021	1.000	71	53	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,365	22.10.2021	1.000	71	74	0,01
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,100	29.01.2021	11.500	89	24	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,752	23.08.2021	2.000	148	51	0,00
							\$ 903	\$ 537	0,04

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	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	\$ 167	\$ 160	0,01

## VERKAUFSOPTIONEN

## DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
HUS	Put - OTC EUR versus CNH	CNH 7,750	04.02.2021	5.643	\$ (30)	\$ (6)	0,00
	Call - OTC EUR versus CNH	8,050	04.02.2021	5.643	(30)	(33)	0,00
	Put - OTC USD versus CNH	6,550	07.01.2021	6.651	(33)	(55)	(0,01)
	Call - OTC USD versus CNH	6,750	07.01.2021	6.651	(33)	0	0,00
					\$ (126)	\$ (94)	(0,01)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	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 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,100	29.01.2021	4.400	(50)	(8)	0,00
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,460	29.01.2021	4.400	(51)	(69)	(0,01)
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	2.200	(166)	(170)	(0,01)
FAR	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,223	15.01.2021	2.700	(30)	(5)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,523	15.01.2021	2.700	(30)	(13)	0,00
FBF	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,399	26.08.2021	20.800	(185)	(1)	0,00
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	1.700	(76)	(14)	0,00
JPM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	1.000	(43)	(8)	0,00
MYC	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 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	17.02.2021	1.700	(57)	(13)	0,00
							\$ (923)	\$ (301)	(0,02)

## ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,000 %	07.10.2022	11.500	\$ (12)	\$ (5)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,000	08.10.2022	6.000	(6)	(2)	0,00
						\$ (18)	\$ (7)	0,00

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 101,563	07.01.2021	1.700	\$ (6)	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	101,672	07.01.2021	2.700	(9)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,141	04.03.2021	3.300	(10)	(3)	0,00
					\$ (25)	\$ (3)	0,00

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

<sup>(2)</sup> Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Japan Government International Bond	(1,000) %	20.06.2022	\$ 100	\$ (4)	\$ 2	\$ (2)	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)	4	(33)	0,00
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	600	(11)	(3)	(14)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	300	(10)	6	(4)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.900	(48)	6	(42)	(0,01)
CBK	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	800	(29)	17	(12)	0,00
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.300	(25)	(4)	(29)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	500	(17)	10	(7)	0,00
HUS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	600	(15)	2	(13)	0,00
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	900	(22)	2	(20)	0,00
					\$ (221)	\$ 44	\$ (177)	(0,01)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond ESG Fund (Forts.)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinstrument	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 1.700	\$ (41)	\$ 49	\$ 8	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.100	(27)	32	5	0,00
MYC	Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2021	€ 700	5	2	7	0,00
					\$ (63)	\$ 83	\$ 20	0,00

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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	\$ 72	\$ 192	\$ 264	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)	451	450	0,03
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)	451	441	0,03
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	7.256	44	497	541	0,04
						\$ 105	\$ 1.591	\$ 1.696	0,11

## 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	\$ 19	\$ 19	0,00
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,785	20.03.2029	3.569.000	0	150	150	0,01
NGF	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,725	20.03.2024	3.205.000	0	72	72	0,01
SCX	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,785	20.03.2029	760.000	23	9	32	0,00
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,795	20.03.2029	554.000	0	24	24	0,00
						\$ 23	\$ 274	\$ 297	0,02

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	AUD 9.545	\$ 7.048	\$ 0	\$ (318)	\$ (318)	(0,02)
	01.2021	¥ 1.701.395	16.354	0	(126)	(126)	(0,01)
	01.2021	PLN 539	139	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	TWD 38.413	1.367	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 4.459	NOK 39.415	145	0	145	0,01
BPS	03.2021	1.806	KRW 1.970.707	6	0	6	0,00
	01.2021	CLP 2.638.064	\$ 3.639	0	(73)	(73)	(0,01)
	01.2021	€ 9.334	11.400	8	(30)	(22)	0,00
	01.2021	PLN 183	47	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	TWD 137.076	4.889	10	0	10	0,00
	01.2021	\$ 5.170	CHF 4.593	26	0	26	0,00
	01.2021	7.644	£ 5.664	98	0	98	0,01
	01.2021	7.824	¥ 810.300	24	0	24	0,00
	01.2021	1.741	SEK 14.695	49	0	49	0,00
	02.2021	DKK 75.319	\$ 12.020	0	(368)	(368)	(0,02)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	03.2021	TWD	\$ 95.679	\$ 3.437	\$ 0	\$ (11)	0,00
	03.2021	\$	3.640	CLP 2.638.064	73	0	0,00
	03.2021		2.489	CNH 16.615	57	0	0,00
	03.2021		7.034	KRW 7.770.945	111	0	0,01
	01.2021	BRL	8.120	\$ 1.542	0	(22)	0,00
	01.2021	¥	1.613.700	15.314	0	(318)	(0,02)
	01.2021	\$	1.563	BRL 8.120	1	0	0,00
	01.2021		2.378	RUB 183.308	98	0	0,01
	02.2021		1.541	BRL 8.120	22	0	0,00
	03.2021		2	KRW 2.210	0	0	0,00
CBK	01.2021	€	7.110	\$ 8.564	0	(136)	(0,01)
	01.2021	¥	218.867	2.101	0	(19)	0,00
	01.2021	PEN	2.936	814	2	0	0,00
	01.2021	\$	4.544	CHF 4.022	6	0	0,00
	01.2021		2.594	CLP 1.936.164	131	0	0,01
	01.2021		804	€ 663	7	0	0,00
	01.2021		3.837	¥ 398.800	26	0	0,00
	01.2021		1.234	NOK 10.885	38	0	0,00
	01.2021		325	RUB 24.981	13	0	0,00
	01.2021		2.042	SEK 17.415	79	0	0,01
GLM	01.2021		1.715	ZAR 26.824	107	0	0,01
	02.2021	DKK	79.029	\$ 12.664	0	(335)	(0,02)
	02.2021	ILS	8.669	2.665	0	(37)	0,00
	02.2021	PEN	4.391	1.220	6	0	0,00
	02.2021	\$	551	MXN 12.647	82	0	0,01
	02.2021		1.425	RUB 106.613	14	(3)	0,00
	03.2021	CNH	509.158	\$ 76.240	0	(1.759)	(0,12)
	03.2021	MXN	17.441	854	0	(14)	0,00
	03.2021	TWD	63.377	2.272	1	(13)	0,00
	03.2021	\$	2.019	CNH 13.402	34	0	0,00
HUS	04.2021	ILS	7.500	\$ 2.214	0	(127)	(0,01)
	05.2021	PEN	17.490	4.857	23	0	0,00
	07.2022	DKK	77.060	12.480	0	(348)	(0,02)
	01.2021	MXN	64.713	3.170	0	(71)	0,00
	01.2021	PEN	2.725	756	2	0	0,00
	01.2021	\$	1	CLP 747	0	0	0,00
	01.2021		33.396	¥ 3.456.550	84	0	0,01
	01.2021		5.625	NZD 8.009	141	0	0,01
	01.2021		406	RUB 31.098	14	0	0,00
	02.2021	DKK	73.109	\$ 11.761	0	(264)	(0,02)
JPM	02.2021	¥	3.456.550	33.406	0	(85)	(0,01)
	02.2021	\$	1.145	DKK 6.930	0	(5)	0,00
	03.2021	CNH	103	\$ 15	0	0	0,00
	03.2021	MXN	17.441	873	4	0	0,00
	03.2021	\$	6.099	CNH 40.094	43	0	0,00
	03.2021		4.105	MXN 87.630	264	(4)	0,02
	01.2021	AUD	3.411	\$ 2.580	0	(53)	0,00
	01.2021	BRL	7.084	1.363	0	(1)	0,00
	01.2021	€	13.160	15.913	0	(190)	(0,01)
	01.2021	£	89.581	119.808	0	(2.650)	(0,18)
JPM	01.2021	¥	404.334	3.880	0	(37)	0,00
	01.2021	PLN	453	119	0	(3)	0,00
	01.2021	\$	2.720	AUD 3.613	68	0	0,00
	01.2021		1.364	BRL 7.084	0	0	0,00
	01.2021		3.649	CAD 4.673	19	0	0,00
	01.2021		936	CLP 699.659	49	0	0,00
	01.2021		6.186	€ 5.099	53	0	0,00
	01.2021		6.561	£ 4.893	128	0	0,01
	01.2021		2.968	SEK 25.248	107	0	0,01
	01.2021		1.553	ZAR 24.028	79	0	0,01
JPM	02.2021	DKK	23.980	\$ 3.950	6	0	0,00
	02.2021	PEN	9.704	2.663	0	(20)	0,00
	02.2021	\$	1.571	DKK 9.640	14	0	0,00
	02.2021		846	RUB 62.950	3	(2)	0,00
	03.2021	CNH	106.086	\$ 16.063	0	(188)	(0,01)
	03.2021	CNY	28.003	4.222	0	(60)	0,00
	03.2021	¥	6.440.000	61.991	0	(428)	(0,03)
	03.2021	PEN	8.647	2.409	19	0	0,00
	03.2021	TWD	81.022	2.912	0	(8)	0,00
	03.2021	\$	5.864	CNH 38.608	51	0	0,00
JPM	03.2021		1.270	KRW 1.386.708	6	(1)	0,00
	04.2021	PEN	6.056	\$ 1.676	2	0	0,00
	01.2021	AUD	7.215	5.309	0	(259)	(0,02)
	01.2021	BRL	1.036	199	0	0	0,00
	01.2021	TWD	9.618	343	1	0	0,00
	01.2021	\$	199	BRL 1.036	1	0	0,00
	01.2021		28	CLP 22.094	3	0	0,00
	01.2021		3.660	€ 2.997	8	0	0,00
	01.2021		60	RUB 4.588	2	0	0,00
	02.2021		288	ILS 993	21	0	0,00
03.2021	CNH	47.619	\$ 7.282	0	(13)	0,00	
03.2021	CNY	5.180	786	0	(6)	0,00	
03.2021	TWD	89.391	3.219	8	(11)	0,00	

## Aufstellung der Wertpapieranlagen 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		
MYI	03.2021	\$	6.888 CNH	45.627	\$ 101	\$ 0	101	0,01	
	03.2021		4.314 KRW	4.761.951	65	0	65	0,00	
	01.2021	CHF	8.915	\$ 9.893	0	(194)	(194)	(0,01)	
	01.2021	€	2.451	\$ 3.006	7	0	7	0,00	
	01.2021	£	35	\$ 48	0	0	0	0,00	
	01.2021	¥	10.489.500	\$ 101.516	0	(110)	(110)	(0,01)	
	01.2021	NZD	6.177	\$ 4.337	0	(110)	(110)	(0,01)	
	01.2021	PLN	34	\$ 9	0	0	0	0,00	
	01.2021	\$	716	AUD 928	0	0	0	0,00	
	01.2021		3.961	£ 2.997	136	0	136	0,01	
	01.2021		1.774	¥ 184.500	13	0	13	0,00	
	01.2021		1.104	NOK 9.770	37	0	37	0,00	
	06.2021		29	€ 23	0	(1)	(1)	0,00	
	04.2022	DKK	78.800	\$ 12.744	0	(344)	(344)	(0,02)	
	RBC	02.2021	\$	2.497 DKK	15.250	11	0	11	0,00
SCX	01.2021	AUD	4.213	\$ 3.104	0	(148)	(148)	(0,01)	
	01.2021	€	243.005	\$ 291.021	0	(6.308)	(6.308)	(0,42)	
	01.2021	\$	1.061	£ 797	29	0	29	0,00	
	02.2021	€	243.005	\$ 297.528	0	(3)	(3)	0,00	
	02.2021	ILS	1.175	\$ 342	0	(24)	(24)	0,00	
	03.2021	CNY	35.788	\$ 5.447	0	(26)	(26)	0,00	
	03.2021	MYR	10.832	\$ 2.661	0	(36)	(36)	0,00	
	03.2021	TWD	93.517	\$ 3.361	0	(9)	(9)	0,00	
	TOR	01.2021	CAD	27.823	\$ 21.476	0	(363)	(363)	(0,02)
		01.2021	¥	2.142.354	\$ 20.525	0	(226)	(226)	(0,02)
		01.2021	\$	21.839	CAD 27.823	0	0	0	0,00
	01.2021		2	CLP 1.494	0	0	0	0,00	
	UAG	02.2021	CAD	27.823	\$ 21.841	0	0	0	0,00
		01.2021	AUD	14.178	\$ 10.424	0	(517)	(517)	(0,03)
		01.2021	\$	40	RUB 3.027	1	0	1	0,00
02.2021		DKK	94.225	\$ 15.086	0	(412)	(412)	(0,03)	
02.2021		\$	1.108	RUB 82.293	3	(3)	0	0,00	
03.2021		TWD	17.589	\$ 635	1	0	1	0,00	
03.2021		\$	1.071	TWD 29.684	0	(1)	(1)	0,00	
				\$ 2.901	\$ (17.258)	\$ (14.357)	(0,95)		

### ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 22.441	AUD 30.384	\$ 1.006	\$ 0	\$ 1.006	0,07
BPS	01.2021	577	785	28	0	28	0,00
BRC	01.2021	377	497	6	0	6	0,00
CBK	01.2021	301	394	3	0	3	0,00
FBF	01.2021	406	534	6	0	6	0,00
HUS	01.2021	12.171	16.460	531	0	531	0,03
JPM	01.2021	5.894	8.010	288	0	288	0,02
MYI	01.2021	2.461	3.261	55	0	55	0,00
SCX	01.2021	6.249	8.443	266	0	266	0,02
UAG	01.2021	22.011	29.887	1.053	0	1.053	0,07
				\$ 3.242	\$ 0	\$ 3.242	0,21

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	CHF 26	\$ 29	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 5.824	CHF 5.261	128	0	128	0,01
BPS	01.2021	31	28	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	4	4	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	CHF 3	\$ 3	0	0	0	0,00
GLM	01.2021	\$ 5.638	CHF 5.089	121	0	121	0,01
MYI	01.2021	6.136	5.551	144	0	144	0,01
SCX	01.2021	144	130	3	0	3	0,00
UAG	01.2021	726	641	1	(1)	0	0,00
				\$ 397	\$ (1)	\$ 396	0,03

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend 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	01.2021	€ 53.526	\$ 65.204	\$ 0	\$ (293)	\$ (293)	(0,02)
	01.2021	\$ 614	€ 500	0	(3)	(3)	0,00
BPS	01.2021	216.480	€ 180.437	4.306	(11)	4.295	0,28
	02.2021	27.139	22.165	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	1.442	1.180	2	0	2	0,00
CBK	01.2021	5.368	4.463	93	0	93	0,01
HUS	01.2021	€ 62.306	\$ 75.420	0	(820)	(820)	(0,05)
	01.2021	\$ 12.217	€ 10.020	53	(9)	44	0,00
JPM	01.2021	3.212	2.631	7	0	7	0,00
MYI	01.2021	42.774	34.928	4	(39)	(35)	0,00
SCX	01.2021	223.960	187.006	4.850	0	4.850	0,32
	02.2021	308.231	251.743	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2021	211.163	176.320	4.574	0	4.574	0,30
	02.2021	308.231	251.743	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 13.889	\$ (1.177)	\$ 12.712	0,84

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 25.343	£ 18.985	\$ 610	\$ 0	\$ 610	0,04
BRC	01.2021	128	£ 96	3	0	3	0,00
CBK	01.2021	25.143	18.809	569	0	569	0,04
HUS	01.2021	£ 14	\$ 18	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 25.027	£ 18.711	552	0	552	0,04
MYI	01.2021	£ 223	\$ 300	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	\$ 19	£ 14	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	235	176	6	0	6	0,00
				\$ 1.740	\$ (6)	\$ 1.734	0,12

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse 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	01.2021	\$ 140.310	NOK 1.240.220	\$ 4.542	\$ 0	\$ 4.542	0,30
BRC	01.2021	136.781	1.201.079	3.501	0	3.501	0,23
GLM	01.2021	NOK 1.990	\$ 226	0	(7)	(7)	0,00
	01.2021	\$ 140.145	NOK 1.239.674	4.643	0	4.643	0,31
MYI	01.2021	54.432	475.881	1.149	0	1.149	0,08
RYL	01.2021	4.546	39.010	10	0	10	0,00
				\$ 13.845	\$ (7)	\$ 13.838	0,92

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse Institutional NZD (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	01.2021	\$ 5.634	NZD 8.008	\$ 132	\$ 0	\$ 132	0,01
GLM	01.2021	12.481	17.771	314	0	314	0,02
MYI	01.2021	NZD 22	\$ 16	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 17.793	NZD 25.253	390	0	390	0,02
SCX	01.2021	12.008	17.070	282	0	282	0,02
				\$ 1.118	\$ 0	\$ 1.118	0,07

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 20.811 1,38

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,500 % fällig am 01.02.2051 (h)	\$ 37.400	\$ (39.362)	(2,61)
3,000 % fällig am 01.01.2051	80.200	(84.035)	(5,57)
3,500 % fällig am 01.01.2036	500	(530)	(0,03)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (123.927)	(8,21)
Summe Anlagen		\$ 2.010.477	133,18
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (500.883)	(33,18)
Nettovermögen		\$ 1.509.594	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) Zum 31. Dezember 2020 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Morgan Stanley	0,790 %	03.02.2023	30.01.2020	\$ 3.479	\$ 3.617	0,24

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 25.675 als Sicherheiten verpfändet.

(k) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 5.445 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 12.872 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 5.800 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	941	23.452	0	24.393
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(123.927)	0	(123.927)
<b>Summen</b>	<b>\$ 7.570</b>	<b>\$ 1.996.538</b>	<b>\$ 6.369</b>	<b>\$ 2.010.477</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 967.152	\$ 0	\$ 967.152
Investmentfonds	6.049	0	0	6.049
Pensionsgeschäfte	0	25.880	0	25.880
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(122)	15.702	0	15.580
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(5.957)	0	(5.957)
<b>Summen</b>	<b>\$ 5.927</b>	<b>\$ 1.002.777</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 1.008.704</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
SCX	0,170 %	11.12.2020	11.01.2021	\$ (25.559)	\$ (25.562)	(1,69)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (25.562)</b>	<b>(1,69)</b>

## Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
TDM	0,160 %	10.12.2020	10.02.2021	\$ (5.461)	\$ (5.461)	(0,36)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (5.461)</b>	<b>(0,36)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 264	\$ 0	\$ 264
BOA	5.262	(5.060)	202
BPS	4.900	(5.710)	(810)
BRC	3.241	(3.450)	(209)
CBK	(1.013)	1.550	537
FAR	(21)	0	(21)
FBF	73	0	73
GLM	5.917	(5.620)	297
GST	(36)	0	(36)
HUS	(2.838)	2.870	32
JPM	188	0	188
MYC	603	(340)	263
MYI	1.132	(1.340)	(208)
NGF	72	0	72
RBC	11	0	11
RYL	10	0	10
SCX	(1.063)	1.380	317
TOR	3.984	(5.130)	(1.146)
UAG	125	0	125

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	61,44	65,71
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	72,79	61,15
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,75	0,00
Investmentfonds	0,44	0,79
Pensionsgeschäfte	3,36	3,39
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,06	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,17	(0,08)
Freiverkehrsfinauzderivate	1,38	2,14
Leerverkaufte Wertpapiere	(8,21)	(0,78)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,69)	(4,47)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,36)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	37,85	46,15
Kommunalanleihen und Wechsel	0,35	0,16
US-Regierungsbehörden	43,84	34,85
US-Schatzobligationen	4,41	4,89
Non-Agency-MBS	6,91	7,64
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,65	5,96
Staatsemissionen	24,31	23,95
Vorzugswertpapiere	0,01	0,02
Kurzfristige Instrumente	11,65	3,24
Investmentfonds	0,44	0,79
Pensionsgeschäfte	3,36	3,39
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,06	(0,02)
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps — Basisswaps	(0,01)	0,00
Zinsswaps	0,18	(0,08)

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Deisenoptionen	k. A.	0,01
Zinsswapoptionen	0,04	0,14
Optionen auf Wertpapiere	0,01	k. A.
Verkaufsoptionen		
Deisenoptionen	(0,01)	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,15)
Zinsscaps	0,00	0,00
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,01)	(0,03)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,11	0,03
Zinsswaps	0,02	0,08
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,95)	(0,46)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	2,19	2,51
Leerverkaufte Wertpapiere	(8,21)	(0,78)
Sonstige Aktiva und Passiva	(33,18)	(32,30)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>ARGENTINIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Pan American Energy LLC			
38,606 % fällig am 26.02.2021	ARS	1.682	\$ 12 0,00
<b>AUSTRALIEN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Driver Australia Four Trust			
0,960 % fällig am 21.08.2025	AUD	114	88 0,01
Pepper SPARKZ Trust No.3			
1,067 % fällig am 17.08.2028		2.200	1.697 0,18
			1.785 0,19
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Pepper Residential Securities Trust			
1,219 % fällig am 16.09.2059		699	539 0,06
RESIMAC Bastille Trust			
1,083 % fällig am 05.09.2057	\$	873	874 0,09
			1.413 0,15
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Australia Government International Bond</b>			
0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD	22.600	17.488 1,88
1,750 % fällig am 21.06.2051		6.400	4.699 0,51
3,000 % fällig am 21.03.2047		1.100	1.046 0,11
New South Wales Treasury Corp.			
2,000 % fällig am 20.03.2031		1.800	1.488 0,16
Queensland Treasury Corp.			
1,750 % fällig am 21.08.2031		1.300	1.051 0,11
Treasury Corp. of Victoria			
4,250 % fällig am 20.12.2032		1.700	1.712 0,19
			27.484 2,96
Summe Australien			30.682 3,30
<b>BRASILIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Bradesco S.A.			
2,850 % fällig am 27.01.2023	\$	1.500	1.536 0,16
Petrobras Global Finance BV			
5,093 % fällig am 15.01.2030		1.730	1.936 0,21
7,250 % fällig am 17.03.2044		300	388 0,04
Summe Brasilien			3.860 0,41
<b>KANADA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Fairfax Financial Holdings Ltd.			
2,750 % fällig am 29.03.2028	€	1.600	2.182 0,24
HSBC Bank Canada			
3,300 % fällig am 28.11.2021	\$	2.300	2.361 0,25
Royal Bank of Canada			
0,628 % fällig am 03.10.2024	£	2.700	3.733 0,40
			8.276 0,89
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Real Estate Asset Liquidity Trust			
3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD	734	593 0,06
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>Canadian Government Real Return Bond</b>			
1,500 % fällig am 01.12.2044 (e)		832	941 0,10
Province of Alberta			
3,350 % fällig am 01.11.2023	\$	400	434 0,05
Province of Ontario			
0,010 % fällig am 25.11.2030	€	2.300	2.830 0,30
Province of Quebec			
0,000 % fällig am 29.10.2030 (d)		3.100	3.822 0,41
5,000 % fällig am 01.12.2038	CAD	1.400	1.632 0,18
			9.659 1,04
Summe Kanada			18.528 1,99

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>CAYMAN INSELN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
CBAM CLO Ltd.			
1,238 % fällig am 17.04.2031	\$	2.000	1.990 0,21
Dryden Senior Loan Fund			
1,137 % fällig am 15.10.2027		2.019	2.014 0,22
Evans Grove CLO Ltd.			
1,144 % fällig am 28.05.2028		507	505 0,05
Figueroa CLO Ltd.			
1,137 % fällig am 15.01.2027		389	390 0,04
ICG U.S. CLO Ltd.			
1,596 % fällig am 22.10.2031		2.400	2.404 0,26
Jamestown CLO Ltd.			
0,927 % fällig am 15.07.2026		112	112 0,01
LCM LP			
1,258 % fällig am 20.10.2027		2.200	2.200 0,24
Limerock CLO LLC			
1,418 % fällig am 20.10.2026		944	945 0,10
Loomis Sayles CLO Ltd.			
1,137 % fällig am 15.04.2028		2.103	2.096 0,22
Marathon CLO Ltd.			
1,083 % fällig am 21.11.2027		1.412	1.402 0,15
Mountain View CLO Ltd.			
1,037 % fällig am 15.10.2026		164	164 0,02
Telos CLO Ltd.			
1,488 % fällig am 17.01.2027		894	894 0,10
Tralee CLO Ltd.			
1,328 % fällig am 20.10.2028		2.500	2.500 0,27
Venture CLO Ltd.			
1,117 % fällig am 15.04.2027		461	459 0,05
WhiteHorse Ltd.			
1,148 % fällig am 17.04.2027		154	153 0,02
			18.228 1,96
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
CIFI Holdings Group Co. Ltd.			
7,625 % fällig am 28.02.2023		500	524 0,06
Country Garden Holdings Co. Ltd.			
7,125 % fällig am 25.04.2022		300	313 0,03
QNB Finance Ltd.			
1,310 % fällig am 12.02.2022		20.300	20.377 2,19
1,574 % fällig am 31.05.2021		1.300	1.304 0,14
Sands China Ltd.			
4,600 % fällig am 08.08.2023		500	532 0,06
5,125 % fällig am 08.08.2025		500	562 0,06
5,400 % fällig am 08.08.2028		900	1.057 0,11
Sunac China Holdings Ltd.			
7,875 % fällig am 15.02.2022		500	513 0,06
Tencent Holdings Ltd.			
3,595 % fällig am 19.01.2028		200	221 0,02
U.S. Capital Funding Ltd.			
0,964 % fällig am 01.08.2034		722	683 0,07
			26.086 2,80
Summe Cayman Inseln			44.314 4,76
<b>CHINA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd.			
2,400 % fällig am 10.12.2022		2.700	2.768 0,30
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>China Development Bank</b>			
3,050 % fällig am 25.08.2026	CNY	30.100	4.526 0,49
3,180 % fällig am 05.04.2026		30.300	4.610 0,49
3,390 % fällig am 10.07.2027		18.100	2.765 0,30
3,430 % fällig am 14.01.2027		32.400	4.959 0,53
3,500 % fällig am 13.08.2026		38.000	5.845 0,63
3,680 % fällig am 26.02.2026		170.900	26.618 2,86
3,740 % fällig am 10.09.2025		7.600	1.187 0,13
3,800 % fällig am 25.01.2036		1.800	274 0,03
4,040 % fällig am 10.04.2027		92.800	14.652 1,57
4,040 % fällig am 06.07.2028		28.100	4.441 0,48
4,150 % fällig am 26.10.2025		4.200	667 0,07
4,240 % fällig am 24.08.2027		125.900	20.141 2,17
4,880 % fällig am 09.02.2028		40.800	6.800 0,73

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>CHINA Government Bond</b>			
2,740 % fällig am 04.08.2026	CNY	8.000	1.207 0,13
2,850 % fällig am 04.06.2027		6.200	931 0,10
2,950 % fällig am 16.06.2023		4.100	629 0,07
3,220 % fällig am 06.12.2025		4.100	635 0,07
3,290 % fällig am 18.10.2023		12.200	1.889 0,20
3,820 % fällig am 02.11.2027		6.600	1.059 0,11
			103.835 11,16
Summe China			106.603 11,46
<b>DÄNEMARK</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Jyske Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	59.672	9.933 1,07
1,500 % fällig am 01.10.2050		3.200	541 0,06
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
1,000 % fällig am 01.10.2050		82.637	13.761 1,48
1,500 % fällig am 01.10.2050		10.051	1.698 0,18
Nykredit Realkredit A/S			
1,000 % fällig am 01.10.2050		67.423	11.201 1,20
1,500 % fällig am 01.10.2050		24.235	4.095 0,44
2,000 % fällig am 01.10.2050		4.708	800 0,09
Summe Dänemark			42.029 4,52
<b>FINNLAND</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Finnvera Oyj			
0,625 % fällig am 22.09.2022	€	600	750 0,08
<b>FRANKREICH</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
BNP Paribas S.A.			
1,904 % fällig am 30.09.2028	\$	3.100	3.157 0,34
3,375 % fällig am 23.01.2026	£	800	1.233 0,13
Danone S.A.			
3,000 % fällig am 15.06.2022	\$	1.400	1.454 0,16
Teleperformance			
1,875 % fällig am 02.07.2025	€	300	395 0,04
			6.239 0,67
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>France Government International Bond</b>			
0,750 % fällig am 25.05.2052 (j)		3.900	5.321 0,57
1,500 % fällig am 25.05.2050 (j)		3.500	5.711 0,62
2,000 % fällig am 25.05.2048 (j)		11.500	20.520 2,21
3,250 % fällig am 25.05.2045 (j)		2.200	4.655 0,50
SNCF Reseau			
0,750 % fällig am 25.05.2036		3.100	4.114 0,44
			40.321 4,34
Summe Frankreich			46.560 5,01
<b>DEUTSCHLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Deutsche Bank AG			
0,050 % fällig am 20.11.2024		4.900	6.067 0,65
1,000 % fällig am 19.11.2025		1.000	1.244 0,13
1,031 % fällig am 22.01.2021	\$	1.400	1.400 0,15
1,375 % fällig am 03.09.2026	€	700	885 0,10
1,625 % fällig am 20.01.2027		3.300	4.222 0,45
1,750 % fällig am 19.11.2030		1.100	1.416 0,15
3,961 % fällig am 26.11.2025	\$	2.100	2.297 0,25
4,250 % fällig am 04.02.2021		600	602 0,06
4,250 % fällig am 14.10.2021		3.700	3.795 0,41
Deutsche Pfandbriefbank AG			
3,375 % fällig am 22.11.2021		2.400	2.460 0,26
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)			
3,625 % fällig am 15.05.2025 (c)	€	1.300	1.626 0,18
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau			
5,000 % fällig am 19.03.2024	AUD	100	89 0,01
Landwirtschaftliche Rentenbank			
4,250 % fällig am 24.01.2023		1.500	1.253 0,14
5,375 % fällig am 23.04.2024	NZD	1.100	917 0,10
Summe Deutschland			28.273 3,04

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,800 % fällig am 15.09.2022	\$ 400	\$ 423	0,05
<b>HONGKONG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Horse Gallop Finance Ltd. 1,431 % fällig am 28.06.2021	1.000	1.000	0,11
Poly Developments and Holdings Group Co. Ltd. 3,950 % fällig am 05.02.2023	600	625	0,07
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 1,757 % fällig am 25.05.2023	600	599	0,06
Summe Hongkong		2.224	0,24
<b>INDIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,700 % fällig am 27.02.2022	900	916	0,10
State Bank of India 4,000 % fällig am 24.01.2022	600	617	0,06
Summe Indien		1.533	0,16
<b>IRLAND</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Black Diamond CLO Designated Activity Co. 0,650 % fällig am 03.10.2029	€ 1.563	1.911	0,21
Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029	1.914	2.337	0,25
Palmer Square European Loan Funding DAC 1,150 % fällig am 15.01.2030	1.500	1.839	0,20
Sorrento Park CLO DAC 0,437 % fällig am 16.11.2027	388	475	0,05
Toro European CLO DAC 0,650 % fällig am 15.04.2030	2.300	2.810	0,30
0,900 % fällig am 15.10.2030	2.500	3.058	0,33
		12.430	1,34
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AIB Group PLC 4,750 % fällig am 12.10.2023	\$ 400	440	0,05
CDBL Funding 1,500 % fällig am 04.11.2023	1.000	1.001	0,11
PartnerRe Ireland Finance DAC 1,250 % fällig am 15.09.2026	€ 1.100	1.434	0,15
		2.875	0,31
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
European Residential Loan Securitisation DAC 0,276 % fällig am 24.03.2063	1.222	1.495	0,16
Summe Irland		16.800	1,81
<b>ISRAEL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Israel Government International Bond 2,000 % fällig am 31.03.2027	ILS 7.600	2.600	0,28
3,800 % fällig am 13.05.2060	\$ 2.200	2.619	0,28
4,125 % fällig am 17.01.2048	700	904	0,10
Summe Israel		6.123	0,66
<b>ITALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	€ 2.000	2.539	0,27
Banca Carige SpA 0,877 % fällig am 25.02.2021	4.000	4.894	0,53
0,977 % fällig am 25.05.2022	1.100	1.354	0,14
1,189 % fällig am 25.10.2021	1.000	1.231	0,13
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 0,875 % fällig am 08.10.2027	200	258	0,03
2,000 % fällig am 29.01.2024	2.200	2.877	0,31
2,625 % fällig am 28.04.2025	100	126	0,01
4,000 % fällig am 10.07.2022	700	891	0,10

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>ITALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Intesa Sanpaolo SpA 7,000 % fällig am 19.01.2021 (f)(h)	€ 900	\$ 1.106	0,12
UniCredit SpA 7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h)	1.000	1.424	0,15
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 2.800	3.324	0,36
		20.024	2,15
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,500 % fällig am 01.02.2026	€ 1.300	1.631	0,18
1,450 % fällig am 15.11.2024 (j)	13.100	17.064	1,83
1,700 % fällig am 01.09.2051 (j)	2.750	3.581	0,39
1,800 % fällig am 01.03.2041	900	1.218	0,13
1,850 % fällig am 01.07.2025 (j)	5.600	7.457	0,80
Italy Government International Bond 6,000 % fällig am 04.08.2028	€ 100	180	0,02
		31.131	3,35
Summe Italien		51.155	5,50
<b>JAPAN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Central Nippon Expressway Co. Ltd. 0,681 % fällig am 15.02.2022	\$ 1.400	1.402	0,15
2,091 % fällig am 14.09.2021	200	202	0,02
2,362 % fällig am 28.05.2021	2.100	2.118	0,23
2,567 % fällig am 02.11.2021	2.200	2.236	0,24
Meiji Yasuda Life Insurance Co. 5,100 % fällig am 26.04.2048	400	486	0,05
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3,455 % fällig am 02.03.2023	2.200	2.346	0,25
Mizuho Financial Group, Inc. 1,221 % fällig am 11.09.2024	1.500	1.521	0,16
3,549 % fällig am 05.03.2023	600	639	0,07
3,922 % fällig am 11.09.2024	1.000	1.088	0,12
Nissan Motor Co. Ltd. 3,522 % fällig am 17.09.2025	200	214	0,02
4,345 % fällig am 17.09.2027	200	221	0,02
4,810 % fällig am 17.09.2030	200	226	0,03
ORIX Corp. 3,250 % fällig am 04.12.2024	400	438	0,05
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 4,009 % fällig am 07.11.2029	€ 1.800	2.292	0,25
2,014 % fällig am 07.11.2022	\$ 8.500	8.752	0,94
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % fällig am 15.10.2027	€ 2.000	2.465	0,27
Toyota Tsusho Corp. 3,625 % fällig am 13.09.2023	\$ 700	752	0,08
		27.398	2,95
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Development Bank of Japan, Inc. 1,875 % fällig am 02.10.2024	1.200	1.259	0,13
Japan Bank for International Cooperation 1,750 % fällig am 17.10.2024	400	419	0,04
Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % fällig am 27.09.2023	1.800	1.940	0,21
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 (e)	¥ 774.589	7.525	0,81
0,500 % fällig am 20.09.2046	721.000	6.920	0,74
0,500 % fällig am 20.03.2049	916.000	8.627	0,93
0,700 % fällig am 20.12.2048	2.198.000	21.825	2,35
1,400 % fällig am 20.09.2034	3.670.000	41.376	4,45
Tokyo Metropolitan Government 0,750 % fällig am 16.07.2025	\$ 800	802	0,09
2,000 % fällig am 17.05.2021	1.200	1.208	0,13
2,500 % fällig am 08.06.2022	4.500	4.631	0,50
2,625 % fällig am 29.05.2024	400	428	0,04
		96.960	10,42
Summe Japan		124.358	13,37

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
AA Bond Co. Ltd. 2,750 % fällig am 31.07.2043	£ 200	270	0,03
<b>LUXEMBURG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Aroundtown S.A. 0,000 % fällig am 16.07.2026 (d)	€ 800	\$ 960	0,10
0,375 % fällig am 23.09.2022	1.300	1.601	0,17
2,000 % fällig am 02.11.2026	700	934	0,10
Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 2,200 % fällig am 24.07.2025	700	919	0,10
CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 12.05.2026	2.100	2.793	0,30
Logicor Financing SARL 1,500 % fällig am 14.11.2022	1.300	1.631	0,18
		8.838	0,95
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Miravet SARL 0,322 % fällig am 26.05.2065	1.300	1.561	0,17
Summe Luxemburg		10.399	1,12
<b>MALAYSIA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Petronas Capital Ltd. 3,500 % fällig am 21.04.2030	\$ 400	461	0,05
4,550 % fällig am 21.04.2050	300	402	0,04
4,800 % fällig am 21.04.2060	300	435	0,05
		1.298	0,14
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Malaysia Government International Bond 3,502 % fällig am 31.05.2027	MYR 2.900	770	0,08
3,733 % fällig am 15.06.2028	2.200	596	0,06
3,899 % fällig am 16.11.2027	2.000	544	0,06
3,906 % fällig am 15.07.2026	4.400	1.186	0,13
Malaysia Government Investment Issue 3,655 % fällig am 15.10.2024	3.700	972	0,10
4,130 % fällig am 09.07.2029	3.900	1.073	0,12
4,369 % fällig am 31.10.2028	2.100	584	0,06
		5.725	0,61
Summe Malaysia		7.023	0,75
<b>MEXIKO</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 15.03.2115	€ 400	566	0,06
<b>MULTINATIONAL</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Preferred Term Securities Ltd. 0,629 % fällig am 23.06.2035	\$ 1.267	1.165	0,12
<b>NIEDERLANDE</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
Accunia European CLO BV 0,950 % fällig am 15.07.2030	€ 800	979	0,10
Cairn CLO BV 0,930 % fällig am 30.04.2031	2.200	2.694	0,29
Jubilee CLO BV 0,257 % fällig am 15.12.2029	500	609	0,07
0,334 % fällig am 12.07.2028	1.668	2.027	0,22
		6.309	0,68
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Cooperative Rabobank UA 6,625 % fällig am 29.06.2021 (f)(h)	600	756	0,08
Enel Finance International NV 2,650 % fällig am 10.09.2024	\$ 1.100	1.174	0,13
3,625 % fällig am 25.05.2027	300	341	0,04
ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026 (f)(h)	1.100	1.196	0,13
JAB Holdings BV 1,000 % fällig am 20.12.2027	€ 1.400	1.789	0,19
JT International Financial Services BV 2,750 % fällig am 28.09.2033	£ 700	1.096	0,12
LeasePlan Corp. NV 0,125 % fällig am 13.09.2023	€ 2.300	2.822	0,30

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>			
Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % (f)	€ 371	\$ 603	0,07
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£ 200	276	0,03
1,875 % fällig am 07.09.2021	800	1.104	0,12
Volkswagen International Finance NV 1,037 % fällig am 16.11.2024	€ 2.800	3.554	0,38
1,125 % fällig am 02.10.2023	1.800	2.274	0,24
		16.985	1,83
<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
Jubilee Place BV 0,485 % fällig am 17.10.2057	2.000	2.445	0,26
Summe Niederlande		25.739	2,77
<b>NEUSEELAND STAATSEMISSIONEN</b>			
New Zealand Government International Bond 1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD 1.700	1.286	0,14
1,750 % fällig am 18.05.2041	700	498	0,05
Summe Neuseeland		1.784	0,19
<b>NORWEGEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
DNB Boligkredit A/S 3,250 % fällig am 28.06.2023	\$ 1.100	1.178	0,13
Sparebanken Soer Boligkredit A/S 0,250 % fällig am 22.03.2021	€ 100	123	0,01
		1.301	0,14
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Kommunalbanken A/S 6,500 % fällig am 12.04.2021	AUD 2.700	2.119	0,23
Norway Government International Bond 1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK 6.300	772	0,08
3,750 % fällig am 25.05.2021	3.700	438	0,05
		3.329	0,36
Summe Norwegen		4.630	0,50
<b>PANAMA STAATSEMISSIONEN</b>			
Panama Government International Bond 4,500 % fällig am 01.04.2056	\$ 200	259	0,03
<b>PERU UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco de Credito del Peru 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 2.400	715	0,08
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Peru Government International Bond 1,862 % fällig am 01.12.2032	\$ 600	606	0,07
5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN 1.900	547	0,06
5,940 % fällig am 12.02.2029	11.400	3.933	0,42
6,150 % fällig am 12.08.2032	2.000	679	0,07
6,350 % fällig am 12.08.2028	17.400	6.114	0,66
6,950 % fällig am 12.08.2031	2.200	791	0,08
		12.670	1,36
Summe Peru		13.385	1,44
<b>PORTUGAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Espirito Santo S.A. 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	€ 400	76	0,01
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	700	133	0,01
Summe Portugal		209	0,02
<b>KATAR STAATSEMISSIONEN</b>			
Qatar Government International Bond 3,250 % fällig am 02.06.2026	\$ 2.200	2.451	0,27
3,750 % fällig am 16.04.2030	800	943	0,10
4,000 % fällig am 14.03.2029	3.700	4.394	0,47
4,500 % fällig am 23.04.2028	1.900	2.305	0,25
Summe Katar		10.093	1,09

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>			
<b>RUMÄNIEN STAATSEMISSIONEN</b>			
Romania Government International Bond 1,375 % fällig am 02.12.2029	€ 700	\$ 873	0,09
2,625 % fällig am 02.12.2040	600	784	0,09
Summe Rumänien		1.657	0,18
<b>RUSSLAND STAATSEMISSIONEN</b>			
Russia Government International Bond 4,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 1.000	1.168	0,12
7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB 120.600	1.841	0,20
Summe Russland		3.009	0,32
<b>SAUDI-ARABIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Saudi Arabian Oil Co. 3,250 % fällig am 24.11.2050	\$ 500	508	0,05
3,500 % fällig am 24.11.2070	900	913	0,10
		1.421	0,15
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Saudi Government International Bond 4,000 % fällig am 17.04.2025	6.100	6.823	0,73
4,375 % fällig am 16.04.2029	600	714	0,08
		7.537	0,81
Summe Saudi-Arabien		8.958	0,96
<b>SINGAPUR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
BOC Aviation Ltd. 2,750 % fällig am 18.09.2022	200	204	0,02
3,500 % fällig am 18.09.2027	500	535	0,06
DBS Bank Ltd. 3,300 % fällig am 27.11.2021	900	925	0,10
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 0,672 % fällig am 17.05.2021	1.200	1.201	0,13
Summe Singapur		2.865	0,31
<b>SLOWENIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 1.000	1.110	0,12
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Slovenia Government International Bond 5,250 % fällig am 18.02.2024	\$ 1.748	2.009	0,22
Summe Slowenien		3.119	0,34
<b>SÜDAFRIKA STAATSEMISSIONEN</b>			
South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029	700	745	0,08
<b>SÜDKOREA STAATSEMISSIONEN</b>			
Korea Government International Bond 2,125 % fällig am 10.06.2027	KRW 2.095.000	2.007	0,21
2,375 % fällig am 10.12.2027	2.480.000	2.412	0,26
2,375 % fällig am 10.12.2028	11.848.000	11.537	1,24
2,625 % fällig am 10.06.2028	4.190.000	4.148	0,45
5,500 % fällig am 10.03.2028	2.480.000	2.901	0,31
Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd. 3,750 % fällig am 25.07.2023	\$ 400	432	0,05
Summe Südkorea		23.437	2,52
<b>SPANIEN FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	€ 1.885	2.309	0,25
Driver Espana Four 0,000 % fällig am 21.04.2028	203	248	0,03
		2.557	0,28
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h)	€ 1.000	\$ 1.283	0,14
6,000 % fällig am 29.03.2024 (f)(h)	1.600	2.106	0,23

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
<b>BESCHREIBUNG</b>			
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 22.07.2025	100	125	0,01
1,125 % fällig am 11.03.2027	100	127	0,01
1,750 % fällig am 10.05.2024	100	127	0,01
Banco Santander S.A. 3,848 % fällig am 12.04.2023	\$ 400	430	0,05
4,375 % fällig am 14.01.2026	€ 200	246	0,03
(f)(h)			
5,250 % fällig am 29.09.2023	400	512	0,05
(f)(h)			
6,250 % fällig am 11.09.2021	800	1.004	0,11
(f)(h)			
CaixaBank S.A. 1,750 % fällig am 24.10.2023	900	1.155	0,12
IE2 Holdco S.A.U. 2,375 % fällig am 27.11.2023	800	1.041	0,11
Merlin Properties Socimi S.A. 1,750 % fällig am 26.05.2025	400	514	0,06
2,375 % fällig am 13.07.2027	1.200	1.584	0,17
		10.254	1,10
<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035	400	663	0,07
4,900 % fällig am 15.09.2021	1.400	1.773	0,19
Spain Government International Bond 0,250 % fällig am 30.07.2024 (j)	2.100	2.642	0,28
1,000 % fällig am 31.10.2050 (j)	3.000	3.804	0,41
1,250 % fällig am 31.10.2030 (j)	8.700	11.903	1,28
1,400 % fällig am 30.07.2028 (j)	10.400	14.263	1,53
1,850 % fällig am 30.07.2035 (j)	3.600	5.339	0,58
5,250 % fällig am 06.04.2029	£ 500	904	0,10
		41.291	4,44
Summe Spanien		54.102	5,82
<b>SUPRANATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 0,500 % fällig am 21.12.2023	AUD 3.100	2.391	0,26
Europäische Investitionsbank 0,500 % fällig am 21.07.2023	1.200	929	0,10
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2035 (d)	€ 1.700	2.138	0,23
Nordic Investment Bank 5,000 % fällig am 19.04.2022	AUD 900	738	0,08
Summe Supranational		6.196	0,67
<b>SCHWEIZ UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Credit Suisse AG 3,625 % fällig am 09.09.2024	\$ 500	555	0,06
6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	500	565	0,06
Credit Suisse Group AG 1,420 % fällig am 14.12.2023	3.400	3.442	0,37
3,800 % fällig am 09.06.2023	1.800	1.940	0,21
3,869 % fällig am 12.01.2029	1.150	1.304	0,14
4,282 % fällig am 09.01.2028	450	520	0,06
4,550 % fällig am 17.04.2026	750	883	0,10
6,250 % fällig am 18.12.2024	200	219	0,02
(f)(h)			
6,375 % fällig am 21.08.2026	200	223	0,02
(f)(h)			
UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)	600	663	0,07
7,625 % fällig am 17.08.2022 (h)	3.750	4.152	0,45
Summe Schweiz		14.466	1,56
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
First Abu Dhabi Bank PJSC 1,180 % fällig am 16.04.2022	1.500	1.509	0,16
3,000 % fällig am 30.03.2022	1.200	1.238	0,13
		2.747	0,29
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,125 % fällig am 16.04.2030	600	679	0,07



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
Discover Bank 3,350 % fällig am 06.02.2023	\$ 500	\$ 528	0,06	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 3,150 % fällig am 01.04.2022	\$ 1.900	1.955	0,21	GS Mortgage Securities Trust 1,932 % fällig am 10.11.2045 (a)	\$ 2.448	\$ 66	0,01
Equifax, Inc. 1,091 % fällig am 15.08.2021	400	401	0,04	3,550 % fällig am 01.04.2025	\$ 200	\$ 221	0,02	GSR Mortgage Loan Trust 2,930 % fällig am 25.03.2033	18	18	0,00
Equitable Holdings, Inc. 3,900 % fällig am 20.04.2023	100	108	0,01			53.374	5,74	HarborView Mortgage Loan Trust 1,459 % fällig am 19.12.2036 ^	176	165	0,02
4,350 % fällig am 20.04.2028	100	118	0,01	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				2,609 % fällig am 19.10.2035	502	365	0,04
Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 14.05.2021	€ 800	975	0,11	CenturyLink, Inc. 2,397 % fällig am 15.03.2027	840	832	0,09	Impac CMB Trust 1,148 % fällig am 25.07.2033	3	3	0,00
0,000 % fällig am 01.12.2021	650	788	0,09	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				IndyMac Mortgage Loan Trust 2,900 % fällig am 25.12.2034	13	13	0,00
0,000 % fällig am 07.12.2022	200	237	0,03	Adjustable Rate Mortgage Trust 3,311 % fällig am 25.09.2035 ^	24	23	0,00	3,114 % fällig am 25.03.2036	780	730	0,08
2,748 % fällig am 14.06.2024	£ 600	821	0,09	American Home Mortgage Assets Trust 0,528 % fällig am 25.05.2046 ^	304	265	0,03	JPMorgan Alternative Loan Trust 0,628 % fällig am 25.10.2036	396	385	0,04
3,375 % fällig am 13.11.2025	\$ 400	411	0,04	1,549 % fällig am 25.10.2046	1.150	943	0,10	5,500 % fällig am 25.11.2036 ^	2	1	0,00
4,000 % fällig am 13.11.2030	300	315	0,03	Banc of America Funding Trust 0,312 % fällig am 20.02.2047	1.262	1.189	0,13	JPMorgan Mortgage Trust 2,230 % fällig am 25.11.2033	6	6	0,00
5,750 % fällig am 01.02.2021	200	201	0,02	3,112 % fällig am 20.10.2046 ^	121	103	0,01	2,982 % fällig am 25.02.2036 ^	128	106	0,01
General Mills, Inc. 4,000 % fällig am 17.04.2025	100	113	0,01	3,500 % fällig am 20.01.2047 ^	62	59	0,01	3,222 % fällig am 27.07.2037	295	295	0,03
General Motors Financial Co., Inc. 0,009 % fällig am 26.03.2022	€ 100	122	0,01	Banc of America Mortgage Trust 6,500 % fällig am 25.10.2031	2	2	0,00	MASTR Alternative Loan Trust 0,548 % fällig am 25.03.2036 ^	88	5	0,00
1,080 % fällig am 09.04.2021	\$ 400	400	0,04	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 2,725 % fällig am 25.10.2033	12	12	0,00	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 0,599 % fällig am 15.12.2030	21	20	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 0,041 % fällig am 21.04.2023	€ 1.600	1.963	0,21	2,883 % fällig am 25.08.2033	8	9	0,00	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust 0,258 % fällig am 25.03.2037	7.135	2.832	0,31
1,375 % fällig am 15.05.2024	1.400	1.769	0,19	3,115 % fällig am 25.05.2034	22	20	0,00	Residential Accredit Loans, Inc. Trust 0,298 % fällig am 25.06.2037 ^	498	426	0,05
4,223 % fällig am 01.05.2029	\$ 600	712	0,08	3,800 % fällig am 25.05.2047 ^	230	225	0,03	0,298 % fällig am 25.10.2036 ^	205	109	0,01
JetBlue Pass-Through Trust 4,000 % fällig am 15.05.2034	1.000	1.084	0,12	Bear Stearns ALT-A Trust 3,002 % fällig am 25.11.2035 ^	163	144	0,02	0,308 % fällig am 25.03.2047	1.119	1.054	0,11
Kilroy Realty LP 3,450 % fällig am 15.12.2024	200	217	0,02	3,108 % fällig am 25.11.2036 ^	491	330	0,04	0,508 % fällig am 25.07.2036 ^	1.420	818	0,09
Lehman Brothers Holdings, Inc. 0,000 % fällig am 16.11.2009 ^	700	8	0,00	3,152 % fällig am 25.09.2035 ^	339	267	0,03	0,508 % fällig am 25.06.2046	882	315	0,03
5,625 % fällig am 24.01.2013 ^	600	7	0,00	Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust 2,728 % fällig am 26.12.2046 ^	564	503	0,05	0,948 % fällig am 25.10.2045	90	78	0,01
6,200 % fällig am 26.09.2014 ^	1.400	17	0,00	Chase Mortgage Finance Trust 3,276 % fällig am 25.07.2037	70	64	0,01	1,812 % fällig am 25.11.2037	1.021	936	0,10
7,875 % fällig am 08.05.2018 ^	£ 1.800	38	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust 3,361 % fällig am 25.09.2037 ^	385	375	0,04	6,000 % fällig am 25.06.2036	578	564	0,06
Morgan Stanley 0,790 % fällig am 03.02.2023 (i)	CAD 6.300	4.954	0,53	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 2,290 % fällig am 25.09.2035	39	39	0,01	Residential Asset Securitization Trust 6,610 % fällig am 25.05.2036	601	345	0,04
1,875 % fällig am 30.03.2023	€ 1.100	1.409	0,15	3,494 % fällig am 25.08.2035 ^	591	587	0,06	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 3,338 % fällig am 25.09.2035 ^	48	37	0,00
MUFG Union Bank N.A. 0,798 % fällig am 09.12.2022	\$ 2.750	2.769	0,30	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates	2.674	2.481	0,05	Sequoia Mortgage Trust 0,852 % fällig am 20.07.2033	26	26	0,00
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,950 % fällig am 01.09.2022	1.400	1.439	0,16	CitiMortgage Alternative Loan Trust 0,748 % fällig am 25.02.2037	2.957	2.458	0,27	3,225 % fällig am 20.07.2037	818	748	0,08
Nissan Motor Acceptance Corp. 0,737 % fällig am 15.03.2021	400	400	0,04	Countrywide Alternative Loan Trust 0,332 % fällig am 20.02.2047 ^	1.073	826	0,09	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 2,724 % fällig am 25.04.2034	38	38	0,00
Nutrition & Biosciences, Inc. 0,697 % fällig am 15.09.2022	1.400	1.405	0,15	0,362 % fällig am 20.07.2046 ^	279	220	0,02	3,080 % fällig am 25.02.2034	23	22	0,00
ONEOK, Inc. 4,550 % fällig am 15.07.2028	300	344	0,04	0,498 % fällig am 25.05.2037 ^	84	27	0,00	Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,308 % fällig am 25.01.2037	1.691	1.589	0,17
Pacific Gas & Electric Co. 2,100 % fällig am 01.08.2027	100	102	0,01	1,688 % fällig am 25.11.2035	174	156	0,02	0,338 % fällig am 25.07.2046 ^	468	376	0,04
2,950 % fällig am 01.03.2026 ^	100	106	0,01	2,109 % fällig am 25.11.2035	83	76	0,01	0,568 % fällig am 25.05.2036	236	203	0,02
3,150 % fällig am 01.01.2026	100	107	0,01	2,649 % fällig am 25.11.2035	33	31	0,00	0,588 % fällig am 25.05.2036	832	787	0,09
3,450 % fällig am 01.07.2025	100	109	0,01	2,659 % fällig am 20.10.2035	1.513	1.193	0,13	0,732 % fällig am 19.07.2034	9	10	0,00
3,950 % fällig am 01.12.2047 ^	100	104	0,01	3,674 % fällig am 25.02.2037 ^	193	188	0,02	0,852 % fällig am 19.03.2034	4	4	0,00
4,250 % fällig am 15.03.2046 ^	300	323	0,04	5,250 % fällig am 25.06.2035 ^	28	27	0,00	Structured Asset Securities Corp. 0,428 % fällig am 25.01.2036	199	179	0,02
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	100	107	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2037	2.439	1.745	0,19	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 0,438 % fällig am 25.10.2036	584	506	0,06
4,550 % fällig am 01.07.2030	200	228	0,02	6,250 % fällig am 25.08.2037 ^	68	53	0,01	Thornburg Mortgage Securities Trust 1,589 % fällig am 25.06.2047 ^	132	122	0,01
Penske Truck Leasing Co. LP 3,950 % fällig am 10.03.2025	1.500	1.681	0,18	6,500 % fällig am 25.06.2036 ^	187	142	0,02	Wachovia Mortgage Loan Trust 0,508 % fällig am 25.01.2037	2.020	1.125	0,12
Santander Holdings USA, Inc. 3,400 % fällig am 18.01.2023	900	946	0,10	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0,608 % fällig am 25.05.2035	29	26	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,768 % fällig am 25.01.2045	33	32	0,00
Sempra Energy 0,667 % fällig am 15.03.2021	1.400	1.401	0,15	0,788 % fällig am 25.03.2035	136	124	0,01	1,609 % fällig am 25.02.2046	303	300	0,03
Southwest Airlines Co. 5,250 % fällig am 04.05.2025	600	695	0,08	0,808 % fällig am 25.02.2035	73	72	0,01	1,753 % fällig am 27.02.2034	13	13	0,00
Sprint Spectrum Co. LLC 4,738 % fällig am 20.09.2029	500	543	0,06	0,908 % fällig am 25.09.2034	8	8	0,00	3,046 % fällig am 25.09.2036	206	193	0,02
Volkswagen Group of America Finance LLC 1,154 % fällig am 12.11.2021	800	806	0,09	2,749 % fällig am 25.11.2034	7	7	0,00	3,173 % fällig am 25.06.2037 ^	153	134	0,02
4,000 % fällig am 12.11.2021	600	619	0,07	3,059 % fällig am 25.08.2034 ^	6	6	0,00	3,451 % fällig am 25.02.2037 ^	1.308	1.285	0,14
Walt Disney Co. 3,500 % fällig am 13.05.2040	800	942	0,10	3,090 % fällig am 25.08.2034 ^	6	5	0,00	3,517 % fällig am 25.05.2037 ^	615	596	0,06
3,600 % fällig am 13.01.2051	900	1.092	0,12	6,000 % fällig am 25.02.2037	1.335	1.023	0,11	3,768 % fällig am 25.03.2034	2	2	0,00
WEA Finance LLC 3,750 % fällig am 17.09.2024	600	633	0,07	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 0,488 % fällig am 25.06.2035	186	175	0,02	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 1,549 % fällig am 25.07.2046 ^	98	68	0,01
Wells Fargo & Co. 1,741 % fällig am 04.05.2030	€ 600	816	0,09	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 0,388 % fällig am 25.08.2036 ^	611	578	0,06		32.973	3,55	
				Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 0,248 % fällig am 25.10.2036 ^	6	4	0,00	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
				Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 0,412 % fällig am 19.08.2045	76	73	0,01	Fannie Mae 0,255 % fällig am 25.03.2036	5	5	0,00
				0,472 % fällig am 19.07.2045 ^	6	0	0,00	0,268 % fällig am 25.03.2034	8	8	0,00
				First Horizon Mortgage Pass-Through Trust 3,197 % fällig am 25.08.2035	24	21	0,00				
				GreenPoint Mortgage Funding Trust 0,688 % fällig am 25.11.2045	21	19	0,00				

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Ex-US 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
0,298 % fällig am 25.08.2034	\$ 10	\$ 10	0,00	4,000 % fällig am 01.03.2049 - 01.06.2050	\$ 4.377	\$ 4.68	0,50	U.S. Treasury STRIPS			
0,548 % fällig am 25.06.2036	35	35	0,00	7,000 % fällig am 01.08.2037	32	34	0,00	0,000 % fällig am 15.11.2023 (d)	\$ 300	\$ 298	0,03
0,648 % fällig am 25.10.2040	72	73	0,01	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA						53.047	5,70
2,944 % fällig am 25.07.2039	925	967	0,10	2,000 % fällig am 01.01.2051	107.300	111.106	11,95	Summe USA		582.006	62,58
6,000 % fällig am 25.04.2043 - 25.07.2044	124	143	0,02	2,500 % fällig am 01.01.2051	38.500	40.463	4,35				
Freddie Mac				3,500 % fällig am 01.01.2036 - 01.02.2051	57.500	60.867	6,55	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.449.661		155,88
0,499 % fällig am 15.01.2038	534	533	0,06	4,000 % fällig am 01.01.2051	157.500	168.234	18,09				
0,759 % fällig am 15.12.2037 - 15.07.2040	239	242	0,03			414.380	44,56				
1,148 % fällig am 25.05.2043	24	25	0,00								
1,809 % fällig am 25.10.2044	203	207	0,02								
1,944 % fällig am 25.02.2045	76	76	0,01								
2,365 % fällig am 01.09.2035	4	4	0,00								
2,663 % fällig am 15.01.2038 (a)	534	32	0,00								
Ginnie Mae											
3,000 % fällig am 20.07.2046	96	98	0,01								
3,000 % fällig am 20.05.2047	57	59	0,01								
3,125 % fällig am 20.11.2022	1	1	0,00								
Ginnie Mae, TBA											
2,000 % fällig am 01.03.2051	11.100	11.572	1,24								
Uniform Mortgage-Backed Security											
1,802 % fällig am 01.12.2034	15	15	0,00								
1,843 % fällig am 01.10.2034	5	5	0,00								
1,944 % fällig am 01.09.2044	59	60	0,01								
2,500 % fällig am 01.11.2050	1.188	1.264	0,14								
2,880 % fällig am 01.11.2034	76	81	0,01								
3,000 % fällig am 01.04.2043 - 01.03.2060	3.585	3.890	0,42								
3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.01.2059	8.876	9.582	1,03								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 1.069	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (1.090)	\$ 1.069	\$ 1.069	0,11
Total Repurchase Agreements						\$ (1.090)	\$ 1.069	\$ 1.069	0,11

(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 March Futures	Short	03.2021	56	\$ (4)	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	163	100	0,01
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von EUR 115.000 auf Euro-Schatz Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	258	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 183.000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	58	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 193.000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	167	0	0,00
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	180	(42)	0,00
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2021	41	7	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	319	464	0,05
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	160	(12)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	55	19	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	60	(37)	0,00
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2021	258	37	0,01
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	50	(51)	(0,01)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 131,500 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Long	02.2021	41	0	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2021	130	(39)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	205	(56)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	22	91	0,01
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2021	10	21	0,00
				\$ 498	0,06

(1) Future-Style-Option.

**OPTIONSKAUF****OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note March 2021 Futures	\$ 129,250	19.02.2021	120	\$ 1	\$ 0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note March 2021 Futures	153,000	19.02.2021	55	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note March 2021 Futures	154,000	19.02.2021	150	1	0	0,00
Call - CME 90-Day Eurodollar June 2022 Futures	99,750	13.06.2022	67	15	19	0,00
Call - CME 90-Day Eurodollar March 2022 Futures	99,750	14.03.2022	36	8	9	0,00
Call - MSE Canada Government 10-Year Bond March Futures	CAD 189,000	19.02.2021	180	2	1	0,00
				\$ 27	\$ 29	0,00

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ 527 0,06

**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<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Enbridge, Inc.	1,000 %	20.12.2022	\$ 300	\$ 2	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.06.2022	700	26	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	€ 900	(63)	(0,01)
Shell International Finance BV	1,000	20.12.2026	900	58	0,01
Tesco PLC	1,000	20.06.2025	1.500	79	0,01
				\$ 102	0,01

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>**

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-34 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2025	\$ 92	\$ (5)	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000)	20.12.2025	5.900	(243)	(0,03)
CDX.IG-33 10-Year Index	(1,000)	20.12.2029	14.900	(194)	(0,02)
CDX.IG-34 10-Year Index	(1,000)	20.06.2030	18.000	(38)	0,00
CDX.IG-35 10-Year Index	(1,000)	20.12.2030	67.000	(210)	(0,02)
iTraxx Europe Main 31 10-Year Index	(1,000)	20.06.2029	€ 5.100	(50)	(0,01)
iTraxx Europe Main 32 10-Year Index	(1,000)	20.12.2029	600	3	0,00
				\$ (737)	(0,08)

**ZINSSWAPS - BASISWAPS**

Zahlung/ variabler Zinssatz- index	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,091 %	18.03.2022	\$ 363.000	\$ (154)	(0,02)
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	12.06.2022	7.700	(2)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,084 %	12.06.2022	16.100	(8)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,085 %	19.06.2022	24.700	(10)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,088 %	06.09.2024	20.700	(3)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,010 %	04.10.2024	29.200	(7)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(4)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	07.03.2024	7.400	0	0,00
				\$ (184)	(0,02)

**ZINSSWAPS**

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,850 %	03.01.2022	BRL 26.900	\$ (1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022	65.200	(5)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	18.800	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,871	03.01.2022	27.700	(2)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,883	03.01.2022	29.500	(4)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,300	03.01.2022	381.500	471	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	22.400	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,880	04.01.2021	1.500	26	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 6.900	124	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,270	03.03.2022	6.600	62	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2022	2.300	18	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	6.000	206	0,02
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	16.900	753	0,08
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029	2.100	88	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	31.900	1.448	0,16
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,200	18.12.2049	6.500	626	0,07

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Ex-US 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	2,500 %	19.06.2029	CAD 17.900	\$ 996	0,11
Zahlung	3-Month CHF-LIBOR	0,500	16.09.2025	CHF 33.300	144	0,02
Erhalt	3-Month NZD-BBR	0,500	16.12.2025	NZD 850	4	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK 56.200	(3)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,250	30.03.2023	\$ 48.900	(62)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,400	30.03.2026	29.000	5	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,400	15.01.2028	45.500	(395)	(0,04)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022	5.500	6	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,750	30.03.2031	64.200	700	0,08
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	2.200	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025	4.000	5	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	15.000	96	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	23.400	(16)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,150	30.03.2051	9.200	326	0,04
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,249	31.08.2024	11.650	(327)	(0,04)
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,250	09.06.2041	3.600	(9)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050	700	24	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,298	25.08.2024	10.200	(302)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,305	21.08.2023	12.550	(419)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,325	02.12.2050	1.700	84	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	4.200	(342)	(0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.01.2030	19.100	(2.040)	(0,22)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	17.500	(3.140)	(0,34)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2021	28.700	(267)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	18.12.2029	1.800	(199)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2026	2.600	(284)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	20.06.2023	ZAR 16.700	89	0,01
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 5.600	(11)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK 24.300	80	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2051	€ 6.300	(173)	(0,02)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	16.06.2051	11.600	40	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	450	1	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,060	17.11.2032	3.000	21	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	1.000	(26)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	17.03.2031	5.900	33	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031	54.500	(53)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035	1.600	(16)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2023	81.000	67	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2026	67.400	(138)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	15.12.2040	100	2	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	1,310	19.06.2029	6.500	410	0,04
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2023	£ 15.900	6	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	11.800	(7)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	16.06.2031	7.700	73	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	17.03.2051	2.000	19	0,00
Zahlung	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051	950	(4)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	20.03.2024	HUF 342.600	48	0,01
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,035	29.11.2029	¥ 600.000	21	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,400	19.06.2039	640.000	(190)	(0,02)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,500	19.06.2049	100.000	51	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN 86.100	36	0,00
Erhalt	UKRPI	3,000	15.11.2050	£ 800	50	0,01
Erhalt	UKRPI	3,051	15.11.2050	700	37	0,00
Erhalt	UKRPI	3,143	15.11.2050	500	(16)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,217	15.11.2040	1.940	(53)	(0,01)
Erhalt	UKRPI	3,257	15.02.2025	8.300	(214)	(0,02)
Erhalt	UKRPI	3,258	15.02.2025	7.300	(189)	(0,02)
Erhalt	UKRPI	3,262	15.02.2025	5.200	(136)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,272	15.11.2040	700	(12)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,273	15.11.2040	990	(17)	0,00
Erhalt	UKRPI	3,334	15.08.2025	1.700	(7)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,340	15.11.2040	1.220	18	0,00
Zahlung	UKRPI	3,386	15.01.2030	1.500	44	0,00
Erhalt	UKRPI	3,397	15.11.2030	1.140	(5)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,436	15.02.2030	900	30	0,00
Erhalt	UKRPI	3,445	15.11.2030	990	(6)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,450	15.02.2030	6.000	211	0,02
Zahlung	UKRPI	3,453	15.02.2030	10.100	367	0,04
Zahlung	UKRPI	3,475	15.08.2030	1.700	26	0,00
Erhalt	UKRPI	3,510	15.11.2030	720	(13)	0,00
					\$ (1.117)	(0,12)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (1.936)</b>	<b>(0,21)</b>

(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) 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.

(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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### 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 <sup>(2)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC USD versus CHF	CHF 0,780	04.02.2021	6.800	\$ 1	\$ 0	0,00
	Call - OTC USD versus SEK	SEK 10,700	04.02.2021	3.600	0	0	0,00
					<b>\$ 1</b>	<b>\$ 0</b>	<b>0,00</b>

###### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,175 %	15.09.2021	3.500	\$ 145	\$ 35	0,00
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,306	29.10.2021	300	22	14	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,306	29.10.2021	300	22	25	0,00
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,758	23.08.2021	2.900	213	73	0,01
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,370	25.10.2021	700	50	38	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,370	25.10.2021	700	50	51	0,01
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,300	21.12.2021	1.500	60	17	0,00
FBF	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,733	26.08.2021	3.300	244	90	0,01
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,300	13.10.2021	5.600	59	66	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,365	22.10.2021	700	50	37	0,00
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,365	22.10.2021	700	50	52	0,01
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,100	29.01.2021	8.500	65	18	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,300	21.12.2021	2.400	94	27	0,00
						<b>\$ 1.124</b>	<b>\$ 543</b>	<b>0,06</b>	

###### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	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	\$ 116	0,01
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 70,000	07.01.2021	30.000	1	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	72,000	04.02.2021	3.000	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.02.2051	74,000	04.02.2021	4.900	1	0	0,00
					<b>\$ 123</b>	<b>\$ 116</b>	<b>0,01</b>

###### VERKAUFSOPTIONEN

###### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.01.2021	2.100	\$ (4)	\$ 0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	1.000	(2)	0	0,00
BPS	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450	20.01.2021	4.200	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	7.500	(12)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	1.100	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	500	(4)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	2.600	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	1.200	(2)	0	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	2.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	1.900	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	2.000	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	400	0	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	2.700	(3)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	1.600	(3)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	2.700	(5)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	1.100	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	1.800	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	4.400	(3)	(3)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	2.800	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	2.900	(4)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	4.400	(4)	(5)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	2.800	(3)	(3)	0,00
Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	1.900	(1)	(1)	0,00	
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	1.900	(3)	(3)	0,00	
BRC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	3.700	(8)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	2.600	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	1.800	(3)	(2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	4.800	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	4.800	(9)	(8)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	900	(1)	(1)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,950 %	20.01.2021	1.000	\$ (2)	\$ 0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	2.500	(4)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	2.500	(2)	(2)	0,00
FBF	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	2.500	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	17.02.2021	700	(2)	0	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	2.000	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	800	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	900	(1)	(1)	0,00
JLN	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	2.200	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	2.200	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	3.800	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	2.200	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	3.800	(4)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	2.200	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	2.200	(4)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	2.300	(5)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	2.200	(4)	0	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	1.900	(1)	(1)	0,00
MYC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	1.900	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.700	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	1.500	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	1.500	(2)	(1)	0,00
						\$ (158)	\$ (80)	(0,01)

## DEIVENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens	
HUS	Put - OTC EUR versus CNH	CNH	7.750	04.02.2021	3.833	\$ (20)	\$ (4)	0,00
	Call - OTC EUR versus CNH		8.050	04.02.2021	3.833	(20)	(22)	0,00
	Put - OTC USD versus CNH		6.550	07.01.2021	5.002	(25)	(41)	(0,01)
	Call - OTC USD versus CNH		6.750	07.01.2021	5.002	(25)	0	0,00
							\$ (90)	\$ (67)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	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	\$ (144)	\$ 0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,100	29.01.2021	3.000	(35)	(6)	0,00
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,460	29.01.2021	3.000	(35)	(47)	(0,01)
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	1.600	(121)	(124)	(0,01)
BRC	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,448	23.08.2021	24.100	(213)	(1)	0,00
DUB	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,020	21.12.2021	12.800	(58)	0	0,00
FBF	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,399	26.08.2021	27.500	(244)	(1)	0,00
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	1.400	(63)	(12)	0,00
JPM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	22.02.2021	900	(39)	(7)	0,00
MYC	Put - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,020	21.12.2021	19.500	(90)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,210	19.01.2021	1.800	(17)	(3)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,550	19.01.2021	1.800	(17)	(7)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,150	17.02.2021	1.500	(50)	(11)	0,00
						\$ (1.126)	\$ (220)	(0,02)	

## ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,000 %	07.10.2022	16.750	\$ (17)	\$ (7)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(1)</sup>	1-Year USD-LIBOR	0,000	08.10.2022	9.000	(9)	(4)	0,00
						\$ (26)	\$ (11)	0,00

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens		
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	\$ 102,906	11.03.2021	700	\$ (2)	\$ (5)	0,00		
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2050	103,367	14.01.2021	1.200	(5)	0	0,00		
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2051	103,594	14.01.2021	1.200	(5)	0	0,00		
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	1.500	(2)	(1)	0,00		
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	1.100	(3)	(5)	0,00		
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	600	(1)	(3)	0,00		
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	700	(2)	(2)	0,00		
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	99,688	04.02.2021	4.100	(25)	(21)	(0,01)		
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,188	04.02.2021	4.600	(11)	(10)	0,00		
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,266	04.02.2021	3.900	(9)	(9)	0,00		
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,141	04.03.2021	900	(3)	(1)	0,00		
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	104,141	04.03.2021	900	(1)	(1)	0,00		
							\$ (69)	\$ (58)	(0,01)

(1) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Japan Government International Bond	(1,000) %	20.06.2022	\$ 500	\$ (17)	\$ 10	\$ (7)	0,00
BPS	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	1.900	(68)	40	(28)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	3.100	(76)	8	(68)	(0,01)
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.600	(31)	(5)	(36)	0,00
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	2.600	(91)	53	(38)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	4.400	(111)	14	(97)	(0,01)
CBK	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	3.400	(120)	70	(50)	(0,01)
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.900	(56)	(10)	(66)	(0,01)
	Japan Government International Bond	(1,000)	20.06.2022	3.300	(115)	67	(48)	(0,01)
HUS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.500	(38)	5	(33)	0,00
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.100	(50)	4	(46)	(0,01)
					\$ (773)	\$ 256	\$ (517)	(0,06)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 1.500	\$ (37)	\$ 44	\$ 7	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.000	(24)	28	4	0,00
MYC	Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2021	€ 800	6	2	8	0,00
					\$ (55)	\$ 74	\$ 19	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	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 5.900	\$ 4.445	\$ 29	\$ 78	\$ 107	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	7.100	4.899	(2)	628	626	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	7.000	4.830	(14)	631	617	0,07
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	9	98	107	0,01
						\$ 22	\$ 1.435	\$ 1.457	0,16

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

## 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	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 13.200	22.03.2021	\$ 7	\$ (116)	\$ (109)	(0,01)
GST	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	7.900	22.03.2021	4	(60)	(56)	(0,01)
JPM	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.600	22.03.2021	1	(15)	(14)	0,00
							\$ 12	\$ (191)	\$ (179)	(0,02)

## 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.	0,080	CAD 5.600	05.02.2021	\$ 0	\$ 365	\$ 365	0,04

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	AUD	11.386	\$ 8.407	\$ 0	\$ (379)	(0,04)
	01.2021	¥	4.082.301	39.249	0	(292)	(0,03)
	01.2021	TWD	26.695	950	0	0	0,00
	01.2021	\$	628	AUD 850	28	0	0,00
	01.2021		561	£ 420	13	0	0,00
	01.2021		1.978	NOK 17.483	64	0	0,01
	01.2021		35	PLN 133	1	0	0,00
BPS	01.2021	€	5.575	\$ 6.769	0	(53)	(0,01)
	01.2021	TWD	18.752	669	2	0	0,00
	01.2021	\$	274	CAD 350	1	0	0,00
	01.2021		3.494	CHF 3.104	18	0	0,00
	01.2021		4.532	£ 3.361	63	0	0,01
	01.2021		4.449	¥ 460.700	14	0	0,00
	01.2021		12	PLN 45	1	0	0,00
	01.2021		998	SEK 8.430	28	0	0,00
	02.2021	DKK	61.530	\$ 9.820	0	(300)	(0,03)
	02.2021	\$	787	ILS 2.661	42	0	0,01
	03.2021	TWD	70.955	\$ 2.549	0	(8)	0,00
	03.2021	\$	1.834	CNH 12.243	42	0	0,01
	03.2021		2	KRW 2.184	0	0	0,00
BRC	01.2021	BRL	4.619	\$ 877	0	(12)	(0,00)
	01.2021	\$	889	BRL 4.619	0	0	0,00
	01.2021		1.860	RUB 143.417	78	0	0,01
	02.2021		877	BRL 4.619	12	0	0,00
	03.2021		1.180	KRW 1.303.617	19	0	0,00
CBK	01.2021	€	1.590	\$ 1.908	0	(37)	(0,00)
	01.2021	¥	432.977	4.157	0	(37)	(0,00)
	01.2021	PEN	12.910	3.586	17	0	0,00
	01.2021	\$	3.385	CHF 2.996	5	0	0,00
	01.2021		841	CLP 627.726	42	0	0,01
	01.2021		1.379	¥ 142.500	1	0	0,00
	01.2021		62	MXN 1.316	4	0	0,00
	01.2021		797	NOK 7.030	24	0	0,00
	01.2021		3.046	NZD 4.330	71	0	0,01
	01.2021		3	PLN 10	0	0	0,00
	01.2021		111	RUB 8.519	4	0	0,00
	01.2021		1.199	SEK 10.225	46	0	0,01
	01.2021		1.139	ZAR 17.817	71	0	0,01
	01.2021	ZAR	72	\$ 5	0	0	0,00
	02.2021	DKK	64.561	10.345	0	(274)	(0,03)
	02.2021	ILS	11.122	3.419	0	(47)	(0,01)
	02.2021	PEN	12.459	3.463	19	(1)	0,00
	02.2021	\$	134	RUB 9.896	0	(1)	0,00
	03.2021	PEN	3.824	\$ 1.078	20	0	0,00
	03.2021	TWD	52.534	1.885	2	(10)	(0,00)
	03.2021	\$	1.263	CNH 8.380	21	0	0,00
	03.2021		2.345	MXN 47.911	37	0	0,00
	04.2021	PEN	9.149	\$ 2.545	16	0	0,00
	05.2021		2.980	828	4	0	0,00
GLM	01.2021	MXN	23.375	1.143	0	(28)	(0,00)
	01.2021	PEN	2.412	669	2	0	0,00
	01.2021	\$	794	CLP 593.039	41	0	0,01
	01.2021		77.268	¥ 7.997.253	196	0	0,02
	01.2021		138	RUB 10.605	5	0	0,00
	02.2021	DKK	49.897	\$ 8.004	0	(203)	(0,02)
	02.2021	¥	7.997.253	77.289	0	(196)	(0,02)
	02.2021	RON	99	24	0	(1)	0,00
	02.2021	\$	1.198	DKK 7.255	0	(5)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	03.2021	CNH	\$	\$	\$	\$	
	03.2021	PEN					
HUS	03.2021	\$	CNH				
	01.2021	AUD	\$				
	01.2021	BRL					
	01.2021	€					
	01.2021	£					
	01.2021	¥					
	01.2021	\$	BRL				
	01.2021		CAD				
	01.2021		CLP				
	01.2021		€				
	01.2021		£				
	01.2021		PLN				
	01.2021		SEK				
	01.2021		ZAR				
	02.2021	PEN	\$				
	02.2021	\$	RUB				
	03.2021	CNH	\$				
	03.2021	CNY					
	03.2021	TWD					
	03.2021	\$	CNH				
IND	03.2021		KRW				
JPM	01.2021		£				
	01.2021	AUD	\$				
	01.2021	BRL					
	01.2021	TWD					
	01.2021	\$	BRL				
	01.2021		€				
	01.2021		RUB				
	02.2021		ILS				
	03.2021	TWD	\$				
	03.2021	\$	CNH				
MYI	03.2021		KRW				
	01.2021	CHF	\$				
	01.2021	NZD					
	01.2021	\$	NOK				
	03.2021		CNH				
	03.2021		KRW				
	06.2021		€				
RBC	01.2021						
SCX	01.2021	AUD	\$				
	01.2021	€					
	01.2021	\$	€				
	01.2021		£				
	02.2021	€	\$				
	02.2021	ILS					
	03.2021	MYR					
	03.2021	TWD					
SSB	01.2021	MXN					
	03.2021	KRW					
TOR	01.2021	CAD					
	01.2021	¥					
	01.2021	\$	CAD				
	01.2021		CLP				
	01.2021		¥				
	02.2021	CAD	\$				
UAG	01.2021	AUD					
	01.2021	\$	RUB				
	02.2021	DKK	\$				
	02.2021	\$	RUB				
				\$	\$	\$	

\$ 1.830 \$ (10.710) \$ (8.880) (0,94)

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	€	\$	\$	\$	\$	
	01.2021	\$	€				
BPS	01.2021	€	\$				
	01.2021	\$	€				
	02.2021						
CBK	01.2021						
HUS	01.2021						
MYI	01.2021	€	\$				
SCX	01.2021	\$	€				
	02.2021						
TOR	01.2021						
	02.2021						
				\$	\$	\$	

\$ 1.123 \$ (96) \$ 1.027 0,11

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 1	£ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	01.2021	87	65	2	0	2	0,00
HUS	01.2021	92	68	2	0	2	0,00
SSB	01.2021	97	73	2	0	2	0,00
				\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	€ 35	\$ 43	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	IDR 1.190.552	84	0	0	0	0,00
	01.2021	¥ 29.332	283	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	MXN 5.864	292	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 75	HUF 22.786	2	0	2	0,00
	01.2021	84	IDR 1.190.552	1	0	1	0,00
	01.2021	56	¥ 5.790	0	0	0	0,00
	01.2021	88	NOK 777	3	0	3	0,00
	02.2021	291	MXN 5.864	2	0	2	0,00
BPS	01.2021	€ 22	\$ 27	0	0	0	0,00
	01.2021	SGD 270	203	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 456	AUD 619	22	0	22	0,00
	01.2021	54	€ 44	0	0	0	0,00
	02.2021	240	DKK 1.485	5	0	5	0,00
	02.2021	203	SGD 270	1	0	1	0,00
	02.2021	113	\$ 85	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	CLP 38.152	52	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2021	€ 115	139	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	£ 22	29	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	IDR 1.190.552	84	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 50	CLP 38.152	3	0	3	0,00
	01.2021	62	£ 45	0	0	0	0,00
	01.2021	84	IDR 1.190.552	1	0	1	0,00
	01.2021	283	¥ 29.332	1	0	1	0,00
	01.2021	121	NZD 172	3	0	3	0,00
	01.2021	143	RUB 10.972	5	0	5	0,00
	02.2021	IDR 1.190.552	\$ 84	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	¥ 29.332	283	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$ 52	CLP 38.152	1	0	1	0,00
GLM	01.2021	¥ 1.418.703	\$ 13.707	0	(35)	(35)	0,00
	01.2021	MYR 1.279	315	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 13.597	¥ 1.414.446	104	0	104	0,01
	01.2021	291	MXN 5.864	3	0	3	0,00
	01.2021	312	MYR 1.279	6	0	6	0,00
	02.2021	13.711	¥ 1.418.703	35	0	35	0,01
	02.2021	316	MYR 1.283	2	0	2	0,00
HUS	01.2021	CNY 40.141	\$ 6.139	1	0	1	0,00
	01.2021	IDR 4.762.208	336	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	KRW 1.270.164	1.162	0	(8)	(8)	0,00
	01.2021	\$ 6.152	CNY 40.141	0	(15)	(15)	0,00
	01.2021	95	CZK 2.083	2	0	2	0,00
	01.2021	240	€ 198	2	0	2	0,00
	01.2021	4.800	£ 3.589	107	0	107	0,01
	01.2021	337	IDR 4.762.208	2	0	2	0,00
	01.2021	1.167	KRW 1.270.164	2	0	2	0,00
	01.2021	471	SEK 4.011	17	0	17	0,00
	02.2021	6.104	CNY 40.001	0	0	0	0,00
	02.2021	335	IDR 4.763.922	3	0	3	0,00
	02.2021	1.164	KRW 1.271.562	7	0	7	0,00
MYI	01.2021	495	CHF 448	12	0	12	0,00
	01.2021	37	¥ 3.843	0	0	0	0,00
	01.2021	216	PLN 814	2	0	2	0,00
NGF	01.2021	201	SGD 270	3	0	3	0,00
SCX	01.2021	CNY 39.978	\$ 6.127	14	0	14	0,00
	01.2021	£ 84	113	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 201	AUD 273	10	0	10	0,00
	01.2021	6.089	CNY 39.978	24	0	24	0,00
	01.2021	13.194	€ 11.017	287	0	287	0,03
	02.2021	23.002	18.787	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	IDR 4.762.208	\$ 333	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	\$ 337	IDR 4.762.208	2	0	2	0,00
	01.2021	32	¥ 3.338	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	CAD 3.258	\$ 2.557	0	0	0	0,00
	01.2021	¥ 8.714	83	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 2.515	CAD 3.258	43	0	43	0,01
	01.2021	9.305	€ 7.770	203	0	203	0,02
	02.2021	2.558	CAD 3.258	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	KRW 1.270.164	\$ 1.167	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
	01.2021	\$ 567	AUD 771	\$ 28	\$ 0	\$ 28	0,01
	01.2021	124	ILS 411	4	0	4	0,00
	01.2021	1.149	KRW 1.270.164	20	0	20	0,00
				\$ 995	\$ (83)	\$ 912	0,10
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ (5.567)</b>	<b>(0,59)</b>

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,500 % fällig am 01.02.2051	\$ 20.700	\$ (21.786)	(2,34)
3,000 % fällig am 01.01.2051	27.600	(28.919)	(3,11)
3,000 % fällig am 01.02.2051	48.300	(50.653)	(5,45)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (101.358)</b>	<b>(10,90)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 1.348.258</b>	<b>144,98</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (418.278)</b>	<b>(44,98)</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 929.980</b>	<b>100,00</b>

## 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 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	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Morgan Stanley	0,790 %	03.02.2023	30.01.2020	\$ 4.764	\$ 4.954	0,53

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 146.075 als Sicherheiten verpfändet.

(k) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 7.519 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 1.302 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 15.827 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 7.440 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	527	(7.501)	(2)	(6.976)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(101.358)	0	(101.358)
<b>Summen</b>	<b>\$ 6.389</b>	<b>\$ 1.336.993</b>	<b>\$ 4.876</b>	<b>\$ 1.348.258</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 1.558.442	\$ 0	\$ 1.558.442
Investmentfonds	5.394	0	0	5.394
Pensionsgeschäfte	0	5.606	0	5.606
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	518	(13.712)	0	(13.194)
<b>Summen</b>	<b>\$ 5.912</b>	<b>\$ 1.550.336</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 1.556.248</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	(0,480) %	18.11.2020	17.02.2021	€ (6.724)	\$ (8.223)	(0,88)
	(0,480)	19.11.2020	17.02.2021	(42.307)	(51.735)	(5,56)
	(0,480)	03.12.2020	17.02.2021	(2.632)	(3.219)	(0,35)
	0,180	03.12.2020	11.02.2021	£ (2.307)	(3.154)	(0,34)
BRC	(0,520)	16.11.2020	17.02.2021	€ (4.149)	(5.073)	(0,55)
CEW	0,190	12.11.2020	11.02.2021	£ (5.750)	(7.861)	(0,84)
	0,210	03.12.2020	11.02.2021	(924)	(1.263)	(0,14)
GRE	0,170	03.11.2020	03.02.2021	\$ (3.404)	(3.405)	(0,37)
	0,180	28.10.2020	27.01.2021	(16.455)	(16.460)	(1,77)
	0,180	28.10.2020	28.01.2021	(3.472)	(3.473)	(0,37)
	0,180	13.11.2020	13.01.2021	(6.686)	(6.687)	(0,72)
IND	(0,500)	19.11.2020	17.02.2021	€ (4.436)	(5.425)	(0,58)
	0,150	16.12.2020	11.02.2021	\$ (3.030)	(3.030)	(0,33)
JML	(0,530)	18.11.2020	17.02.2021	€ (15.937)	(19.487)	(2,10)
RYL	(0,470)	02.12.2020	17.02.2021	(5.586)	(6.832)	(0,73)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (145.327)</b>	<b>(15,63)</b>

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	0,180 %	29.10.2020	29.01.2021	\$ (3.642)	\$ (3.643)	(0,39)
NOM	0,060	16.12.2020	15.01.2021	(3.867)	(3.867)	(0,42)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (7.510)</b>	<b>(0,81)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ 107	\$ 0	\$ 107
BOA	(796)	570	(226)
BPS	120	0	120
BRC	(10)	0	(10)
CBK	691	0	691
CIB	365	(290)	75
DUB	13	(50)	(37)
FBF	87	0	87
GLM	(322)	620	298
GST	(184)	280	96
HUS	(1.865)	1.530	(335)
IND	9	0	9
JPM	(311)	380	69
MYC	123	(750)	(627)
MYI	(135)	90	(45)
NGF	3	0	3
RBC	25	0	25
SCX	(2.266)	2.710	444
SSB	(453)	350	(103)
TOR	134	(300)	(166)
UAG	(902)	910	8

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,41	90,37
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	66,94	52,31
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,53	k. A.
Investmentfonds	0,63	0,49
Pensionsgeschäfte	0,11	0,51
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,06	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,21)	(0,72)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,59)	(0,54)
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,90)	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(15,63)	(11,24)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,81)	(0,56)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Argentinien	0,00	k. A.
Australien	3,30	0,62
Brasilien	0,41	0,54
Kanada	1,99	2,82
Cayman-Inseln	4,76	3,52
China	11,46	6,69
Dänemark	4,52	5,35
Finnland	0,08	0,06
Frankreich	5,01	3,22
Deutschland	3,04	3,19
Guernsey, Kanalinseln	0,05	0,29
Hongkong	0,24	0,35
Indien	0,16	0,32
Indonesien	k. A.	0,05
Irland	1,81	2,07
Israel	0,66	0,07
Italien	5,50	5,98
Japan	13,37	14,85
Jersey, Kanalinseln	0,03	0,02
Kuwait	k. A.	0,68
Litauen	k. A.	0,14
Luxemburg	1,12	1,54
Malaysia	0,75	k. A.
Mexiko	0,06	0,05
Multinational	0,12	0,11
Niederlande	2,77	3,26
Neuseeland	0,19	k. A.
Norwegen	0,50	0,78
Panama	0,03	k. A.
Peru	1,44	0,67
Polen	k. A.	0,34
Portugal	0,02	0,02
Katar	1,09	1,51
Rumänien	0,18	k. A.
Russland	0,32	0,30
Saudi-Arabien	0,96	1,72
Singapur	0,31	0,26
Slowenien	0,34	0,34
Südafrika	0,08	0,06
Südkorea	2,52	2,02
Spanien	5,82	6,55
Supranational	0,67	0,79
Schweden	k. A.	0,43
Schweiz	1,56	1,70
Vereinigte Arabische Emirate	0,43	0,60
Großbritannien	15,63	14,64
USA	62,58	50,67
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	0,13
Kurzfristige Instrumente	k. A.	3,36
Investmentfonds	0,63	0,49
Pensionsgeschäfte	0,11	0,51
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,06	0,05
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzkauf	(0,08)	(0,15)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	k. A.	0,01
Zinsswaps — Basisswaps	(0,02)	0,01
Zinsswaps	(0,12)	(0,60)

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	0,01
Zinsswapoptionen	0,06	0,14
Optionen auf Wertpapiere	0,01	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	0,00
Devisenoptionen	(0,01)	(0,01)
Inflation-Capped Options	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,15)
Zinsscaps	0,00	0,00
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	(0,06)	(0,07)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,16	0,03
Zinsswaps	k. A.	0,06
Total Return Swaps auf Indizes	(0,02)	(0,06)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	0,04	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,94)	(0,77)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,21	0,28
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,90)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(44,98)	(42,47)
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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>								<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>								<b>BANKEN UND FINANZEN</b>			
Aviation Capital Group LLC 5,500 % fällig am 15.12.2024	\$ 400	\$ 443	0,06	Microchip Technology, Inc. 3,922 % fällig am 01.06.2021	\$ 100	\$ 101	0,01	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 1,948 % fällig am 25.06.2034	\$ 175	\$ 174	0,03
Bank of America Corp. 5,875 % fällig am 15.03.2028 (g)	650	736	0,10	Mitsubishi Corp. 2,625 % fällig am 14.07.2022	2.300	2.372	0,34	Argent Securities Trust 0,298 % fällig am 25.07.2036	1.529	1.355	0,19
Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.06.2024 (g)(i)	1.200	1.339	0,19	NCL Corp. Ltd. 10,250 % fällig am 01.02.2026	1.100	1.290	0,18	0,468 % fällig am 25.05.2036	441	169	0,02
Credit Suisse Group AG 5,250 % fällig am 11.02.2027 (g)(i)	1.300	1.378	0,20	Pan American Energy LLC 38,606 % fällig am 26.02.2021	ARS 2.881	20	0,00	Babson Euro CLO BV 0,309 % fällig am 25.10.2029	€ 244	296	0,04
DAE Sukuk Dific Ltd. 3,750 % fällig am 15.02.2026	700	721	0,10	Reynolds Group Issuer, Inc. 4,000 % fällig am 15.10.2027	\$ 1.200	1.231	0,17	Cairn CLO BV 0,650 % fällig am 20.10.2028	337	412	0,06
Deutsche Bank AG 4,250 % fällig am 14.10.2021	4.800	4.923	0,70	Rolls-Royce PLC 5,750 % fällig am 15.10.2027	£ 1.000	1.517	0,22	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,730 % fällig am 21.09.2029	238	291	0,04
Ford Motor Credit Co. LLC 5,125 % fällig am 16.06.2025	1.100	1.197	0,17	Royal Caribbean Cruises Ltd. 9,125 % fällig am 15.06.2023	\$ 40	43	0,01	CIT Mortgage Loan Trust 1,498 % fällig am 25.10.2037	\$ 2.314	2.328	0,33
ING Groep NV 4,875 % fällig am 16.05.2029 (g)(i)	1.300	1.334	0,19	United Airlines Pass-Through Trust 3,100 % fällig am 07.01.2030	337	342	0,05	Countrywide Asset-Backed Certificates 0,378 % fällig am 25.05.2037	11.500	10.739	1,53
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 35.010	5.843	0,83	Univision Communications, Inc. 6,625 % fällig am 01.06.2027	400	430	0,06	Dartry Park CLO DAC 0,830 % fällig am 28.04.2029	€ 140	172	0,03
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,750 % fällig am 28.09.2023	\$ 1.100	1.122	0,16	VMware, Inc. 3,900 % fällig am 21.08.2027	200	226	0,03	Driver Australia Four Trust 0,960 % fällig am 21.08.2025	AUD 250	193	0,03
KWG Group Holdings Ltd. 5,875 % fällig am 10.11.2024	1.300	1.339	0,19	YPF S.A. 38,259 % fällig am 04.03.2021	ARS 6.980	48	0,01	Dryden Senior Loan Fund 1,137 % fällig am 15.10.2027	\$ 2.019	2.014	0,29
MGM Growth Properties Operating Partnership LP 3,875 % fällig am 15.02.2029	800	819	0,12	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				First Franklin Mortgage Loan Trust 0,853 % fällig am 25.11.2036	2.200	2.054	0,29
Natwest Group PLC 1,801 % fällig am 25.06.2024	1.000	1.019	0,15	Pacific Gas & Electric Co. 2,500 % fällig am 01.02.2031	\$ 1.100	1.105	0,16	Fremont Home Loan Trust 0,298 % fällig am 25.10.2036	7.578	4.080	0,58
4,519 % fällig am 25.06.2024	700	765	0,11	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		69.469	9,89	Halcyon Loan Advisors Funding Ltd. 1,138 % fällig am 20.04.2027	314	312	0,05
New Metro Global Ltd. 4,800 % fällig am 15.12.2024	1.300	1.323	0,19	<b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>				Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029	€ 1.116	1.364	0,19
6,500 % fällig am 20.05.2022	800	828	0,12	Multiplan Corp. 6,000 % fällig am 15.10.2027 (b)	1.400	1.348	0,19	Home Equity Asset Trust 0,598 % fällig am 25.02.2036	\$ 4.300	4.142	0,59
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 27.750	4.632	0,66	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,358 % fällig am 25.10.2036	146	143	0,02
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	46.174	7.700	1,10	Fannie Mae 6,432 % fällig am 25.03.2036 (a)	216	45	0,01	Jubilee CLO BV 0,257 % fällig am 15.12.2029	€ 360	439	0,06
Societe Generale S.A. 5,375 % fällig am 18.11.2030 (g)(i)	\$ 1.300	1.382	0,20	Freddie Mac 5,941 % fällig am 15.08.2043 (a)	698	127	0,02	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 7,170 % fällig am 15.04.2040 ^	\$ 911	760	0,11
Starwood Property Trust, Inc. 5,500 % fällig am 01.11.2023	400	418	0,06	206	280	0,04	Long Beach Mortgage Loan Trust 0,748 % fällig am 25.01.2036	2.644	2.369	0,34	
Sunac China Holdings Ltd. 8,350 % fällig am 19.04.2023	800	844	0,12	Ginnie Mae 0,599 % fällig am 20.08.2068	1.299	1.289	0,18	Man GLG Euro CLO DAC 0,870 % fällig am 15.01.2030	€ 400	488	0,07
UniCredit SpA 7,500 % fällig am 03.06.2026 (g)(i)	€ 1.000	1.424	0,20	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	100	105	0,01	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,278 % fällig am 25.10.2036	\$ 115	108	0,02
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 8.600	10.211	1,45	<b>US-SCHATZOBIGLATIONEN</b>				0,288 % fällig am 25.10.2036	1.291	792	0,11
Ursa Re Ltd. 3,808 % fällig am 07.12.2027	1.150	1.157	0,16	U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	5.700	5.638	0,80	Residential Asset Securities Corp. Trust 0,398 % fällig am 25.11.2036 ^	3.650	3.390	0,48
Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 15.04.2024	1.300	1.342	0,19	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f) 0,125 % fällig am 15.07.2030	10.968	12.314	1,76	THL Credit Wind River CLO Ltd. 1,107 % fällig am 15.10.2027	143	143	0,02
		54.239	7,72			17.952	2,56	Tralee CLO Ltd. 1,248 % fällig am 20.10.2027	615	614	0,09
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029	800	884	0,13	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,199 % fällig am 25.02.2036 ^	70	69	0,01	Angolan Government International Bond 0,125 % fällig am 09.07.2030	994	398	0,06
American Airlines Pass-Through Trust 3,350 % fällig am 15.04.2031	562	557	0,08	3,447 % fällig am 25.07.2036 ^	150	145	0,02	0,125 % fällig am 09.07.2035	653	235	0,03
3,575 % fällig am 15.07.2029	486	483	0,07	Countrywide Alternative Loan Trust 6,000 % fällig am 25.04.2037	1.213	1.228	0,17	Argentina Government International Bond 34,109 % fällig am 04.10.2022	ARS 5.300	34	0,00
Caesars Entertainment, Inc. 6,250 % fällig am 01.07.2025	400	427	0,06	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	55	37	0,01	36,174 % fällig am 03.04.2022	2.663	18	0,00
Caesars Resort Collection LLC 5,750 % fällig am 01.07.2025	400	424	0,06	Hawksmoor Mortgages PLC 1,104 % fällig am 25.05.2053	£ 2.959	4.052	0,58	Argentina Treasury Bond 1,000 % fällig am 05.08.2021	5.359	38	0,01
Delta Air Lines, Inc. 2,900 % fällig am 28.10.2024	850	839	0,12	IndyMac Mortgage Loan Trust 1,073 % fällig am 20.10.2051	\$ 134	112	0,01	China Development Bank 3,340 % fällig am 14.07.2025	CNY 409.200	62.918	8,96
4,500 % fällig am 20.10.2025	400	428	0,06	Towd Point Mortgage Funding PLC 1,073 % fällig am 20.10.2051	£ 2.472	3.392	0,48	Dominican Republic Government International Bond 8,900 % fällig am 15.02.2023	DOP 46.800	831	0,12
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,750 % fällig am 01.05.2029	700	731	0,10	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,808 % fällig am 25.01.2045	\$ 3.165	3.083	0,44	9,750 % fällig am 05.06.2026	38.900	722	0,10
4,000 % fällig am 01.05.2031	700	740	0,11	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 6,000 % fällig am 25.07.2036	616	538	0,08	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,500 % fällig am 01.02.2026	€ 10.200	12.802	1,82
Jaguar Land Rover Automotive PLC 7,750 % fällig am 15.10.2025	400	432	0,06			12.656	1,80	Peru Government International Bond 5,400 % fällig am 12.08.2034	PEN 5.800	1.756	0,25
JetBlue Pass-Through Trust 4,000 % fällig am 15.05.2034	300	325	0,05								
Marriott International, Inc. 4,625 % fällig am 15.06.2030	200	235	0,03								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
6,350 % fällig am 12.08.2028 PEN	7.900	\$ 2.776	0,39	American Tower Corp.	9.496	\$ 2.131	0,30	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
8,200 % fällig am 12.08.2026	9.100	3.417	0,49	Apartment Income REIT Corp.	44.113	1.694	0,24	(0,088) % fällig am			
Provincia de Buenos Aires				Apartment Investment and Management Co. 'A'	44.113	233	0,03	15.03.2021 (d)(e)	¥ 3.488.000	\$ 33.790	4,81
34,187 % fällig am 31.05.2022 ARS	2.380	14	0,00	Duke Realty Corp.	62.978	2.517	0,36	<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
Qatar Government International Bond				Equinix, Inc.	4.962	3.544	0,51	0,081 % fällig am			
3,875 % fällig am 23.04.2023 \$	2.000	2.152	0,31	Equity LifeStyle Properties, Inc.	21.625	1.370	0,20	25.02.2021 (d)(e)	\$ 46.100	46.096	6,56
South Africa Government International Bond				Equity Residential	28.217	1.673	0,24	0,086 % fällig am			
10,500 % fällig am 21.12.2026 ZAR	184.200	14.879	2,12	First Industrial Realty Trust, Inc.	35.670	1.503	0,21	25.02.2021 (d)(e)	13.100	13.099	1,86
		102.990	14,66	Gaming and Leisure Properties, Inc.	34.945	1.482	0,21	0,089 % fällig am			
<b>AKTIEN</b>				Invitation Homes, Inc.	74.096	2.201	0,31	28.01.2021 (d)(e)(j)	3.000	3.000	0,43
<b>STAMMAKTIE</b>				Life Storage, Inc.	13.519	1.614	0,23	0,117 % fällig am			
<b>LUXUSGÜTER</b>				MGM Growth Properties LLC 'A'	24.375	763	0,11	14.01.2021 (d)(e)	34.500	34.500	4,91
GrandVision NV (c)	106.961	3.337	0,48	SBA Communications Corp.	8.294	2.340	0,33			96.695	13,76
<b>ENERGIE</b>				Simon Property Group, Inc.	5.583	476	0,07	Summe kurzfristige Instrumente		131.088	18,66
Dommo Energia S.A. (c)	50.304	14	0,00	Sun Communities, Inc.	14.390	2.186	0,31	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 421.912	60,07	
<b>FINANZWERTE</b>				Welltower, Inc.	18.159	1.173	0,17				
National General Holdings Corp.	67.873	2.320	0,33	<b>AKTIEN</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Navistar International Corp. (c)	58.195	2.558	0,37	ARGENTINA TREASURY BILLS				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Mortgage Opportunities Fund (h)	7.012.353	74.611	10,62
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				(3,480) % fällig am				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	11.656.511	116.122	16,53
PNM Resources, Inc.	49.758	2.415	0,34	13.09.2021 (d)(e) ARS	57.710	421	0,06			190.733	27,15
		10.644	1,52	(0,275) % fällig am				Summe Investmentfonds	\$ 230.921	32,87	
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				17.04.2021 (d)(e)							
Nationwide Building Society	16.289	3.944	0,56	1,782 % fällig am				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
10,250 %				31.03.2021 (d)(e)				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)	395.212	40.188	5,72
<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>								Summe Investmentfonds	\$ 230.921	32,87	
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	13.975	2.491	0,36								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 981	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (1.001)	\$ 981	\$ 981	0,14
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						\$ (1.001)	\$ 981	\$ 981	0,14

<sup>(1)</sup> 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 March Futures	Long	03.2021	10	\$ 1	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	191	49	0,01
CAC 40 Index January Futures	Short	01.2021	1	0	0,00
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	70	32	0,01
DAX Index March Futures	Long	03.2021	17	340	0,05
E-mini NASDAQ 100 Index March Futures	Long	03.2021	9	83	0,01
E-mini S&P 500 Index March Futures	Long	03.2021	1.206	5.382	0,77
Euro STOXX 50 March Futures	Long	03.2021	153	70	0,01
Euro STOXX 600 March Futures	Long	03.2021	2.478	924	0,13
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2021	86	10	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	38	27	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	56	26	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	33	0	0,00
FTSE 100 Index March Futures	Long	03.2021	25	(46)	(0,01)
FTSE/MIB Index March Futures	Long	03.2021	1	3	0,00
IBEX 35 Index January Futures	Long	01.2021	1	1	0,00
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	16	(16)	0,00
MSCI Emerging Markets Index March Futures	Long	03.2021	964	1.773	0,25
Nikkei 225 Yen-Denominated March Futures	Long	03.2021	165	574	0,08

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
OMXS30 Index January Futures	Short	01.2021	1	\$ 0	0,00
S&P/Toronto Stock Exchange 60 March Futures	Long	03.2021	67	(93)	(0,01)
SPI 200 Index March Futures	Long	03.2021	168	(38)	(0,01)
Swiss Market Index March Futures	Short	03.2021	1	(4)	0,00
Topix Index March Futures	Long	03.2021	170	793	0,11
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2021	284	(64)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2021	254	(70)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	530	143	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	108	(239)	(0,03)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	35	(7)	0,00
				\$ 9.654	1,37
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ 9.654</b>	<b>1,37</b>

## 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<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 34 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	€ 100	\$ (5)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-34 5-Year Index	5,000 %	20.06.2025	\$ 92	\$ 6	0,00
CDX.IG-34 5-Year Index	1,000	20.06.2025	15.300	42	0,01
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	62.900	183	0,02
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 1.500	0	0,00
				\$ 231	0,03

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variablem Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day	INR-MIBOR Compounded-OIS	4,531 %	16.12.2025	INR 530.000	\$ (61)	(0,01)
Zahlung	1-Day	INR-MIBOR Compounded-OIS	4,561	16.12.2025	28.000	(1)	0,00
Erhalt	1-Year	BRL-CDI	2,840	03.01.2022	BRL 14.400	(1)	0,00
Erhalt	1-Year	BRL-CDI	2,848	03.01.2022	11.900	(1)	0,00
Erhalt	1-Year	BRL-CDI	2,850	03.01.2022	55.700	(1)	0,00
Erhalt	1-Year	BRL-CDI	2,865	03.01.2022	17.800	(1)	0,00
Erhalt	1-Year	BRL-CDI	2,870	03.01.2022	16.700	(1)	0,00
Erhalt	1-Year	BRL-CDI	2,871	03.01.2022	19.100	(1)	0,00
Erhalt	1-Year	BRL-CDI	2,880	03.01.2022	3.800	0	0,00
Erhalt	1-Year	BRL-CDI	2,883	03.01.2022	3.500	0	0,00
Erhalt	1-Year	BRL-CDI	2,884	03.01.2022	1.200	0	0,00
Zahlung	1-Year	BRL-CDI	3,290	03.01.2022	308.300	371	0,05
Erhalt	1-Year	BRL-CDI	3,360	03.01.2022	32.200	(1)	0,00
Erhalt	1-Year	BRL-CDI	5,850	02.01.2025	11.600	(30)	0,00
Erhalt	1-Year	BRL-CDI	6,350	02.01.2025	31.000	(189)	(0,03)
Zahlung	1-Year	BRL-CDI	6,390	02.01.2025	65.000	453	0,06
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month	CAD Bank Bill	0,550	20.01.2023	CAD 48.000	(47)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month	CAD Bank Bill	0,800	20.01.2026	57.300	189	0,03
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month	CAD Bank Bill	1,130	20.01.2031	18.400	60	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month	CAD Bank Bill	1,530	20.01.2051	400	(4)	0,00
Erhalt	3-Month	CNY-CNREPOFIX	2,655	16.12.2025	CNY 94.100	(19)	0,00
Zahlung	3-Month	COP-IBR Compounded-OIS	2,955	12.11.2025	COP 15.428.000	(17)	0,00
Zahlung	3-Month	COP-IBR Compounded-OIS	3,195	02.10.2025	10.060.000	31	0,00
Erhalt	3-Month	COP-IBR Compounded-OIS	3,205	11.12.2025	10.060.000	(17)	0,00
Zahlung	3-Month	KRW-KORIBOR	0,939	16.12.2025	KRW 16.094.600	(85)	(0,01)
Erhalt	3-Month	PLN-WIBOR	0,585	22.09.2025	PLN 50.300	40	0,01
Zahlung	3-Month	SGD-SOR	0,490	16.12.2025	SGD 1.700	3	0,00
Erhalt	3-Month	SGD-SOR	0,534	16.12.2025	7.100	(26)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month	USD-LIBOR	0,240	20.01.2023	\$ 113.500	118	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month	USD-LIBOR	0,440	20.01.2026	75.600	(138)	(0,02)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month	USD-LIBOR	0,830	20.01.2031	5.300	5	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month	USD-LIBOR	1,220	20.01.2051	3.700	(68)	(0,01)
Erhalt	3-Month	USD-LIBOR	1,250	17.06.2025	9.000	66	0,01
Zahlung	3-Month	ZAR-JIBAR	4,970	30.09.2025	ZAR 215.700	220	0,03
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	1,300	02.10.2025	CLP 2.817.000	16	0,00
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	1,340	12.11.2025	1.870.800	(12)	0,00
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	1,625	11.12.2025	6.100.000	65	0,01
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	0,665	22.09.2025	CZK 61.600	64	0,01

# Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,070 %	20.01.2051	€ 6.100	\$ 26	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,280	20.01.2031		21.000	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,480	20.01.2026		21.700	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,540	20.01.2023		39.700	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,030	20.01.2026	£ 69.200	(9)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,080	20.01.2023		53.600	(16)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,120	20.01.2031		3.200	(42)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,250	20.01.2051		9.900	160
Erhalt	6-Month HUF-BBR		1,410	02.10.2025	HUF 6.759.200	(308)	(0,04)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR		1,500	20.12.2044	¥ 690.000	(176)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		4,925	03.11.2025	MXN 30.300	16	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		5,030	05.05.2025		65.400	(24)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		5,150	08.05.2025		337.200	(123)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		5,205	21.05.2025		159.100	(62)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		5,505	28.04.2025		10.900	(4)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		5,507	29.04.2025		22.800	(9)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		5,520	24.04.2025		64.100	(25)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE		5,615	23.04.2025		11.600	(5)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,570	31.12.2024		352.800	137
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,620	02.01.2025		350.200	135
						\$ 666	0,10
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 892</b>	<b>0,13</b>

(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 entspricht, 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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC USD versus MXN	MXN 20,000	03.12.2021	8.300	\$ 293	\$ 282	0,04
	Put - OTC USD versus RUB	RUB 75,000	03.12.2021	8.300	365	337	0,05
	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR 15,200	03.12.2021	8.300	364	499	0,07
JPM	Call - OTC AUD versus USD	\$ 0,765	24.02.2021	18.200	187	294	0,04
MYI	Put - OTC USD versus BRL	BRL 5,000	03.12.2021	8.300	397	319	0,04
					\$ 1.606	\$ 1.731	0,24

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
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

#### DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC USD versus MXN	MXN 17,750	03.12.2021	8.300	\$ (47)	\$ (45)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN		03.12.2021	8.300	(244)	(227)	(0,03)
	Put - OTC USD versus RUB	RUB 68,250	03.12.2021	8.300	(104)	(86)	(0,01)
	Call - OTC USD versus RUB		03.12.2021	8.300	(260)	(240)	(0,03)
	Put - OTC USD versus ZAR	ZAR 13,750	03.12.2021	8.300	(107)	(154)	(0,02)
JPM	Call - OTC USD versus ZAR		03.12.2021	8.300	(268)	(192)	(0,03)
JPM	Put - OTC USD versus KRW	KRW 1.095,000	24.02.2021	13.934	(180)	(230)	(0,03)
MYI	Put - OTC USD versus BRL	BRL 4,300	03.12.2021	8.300	(71)	(48)	(0,01)
	Call - OTC USD versus BRL		03.12.2021	8.300	(346)	(335)	(0,05)
					\$ (1.627)	\$ (1.557)	(0,22)

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	8.200	\$ (374)	\$ (7)	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)	\$ (7)	0,00

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 2.900	\$ (86)	\$ 124	\$ 38	0,01	
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	12.200	(403)	561	158	0,02	
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.200	(5)	23	18	0,00	
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	5.100	(148)	214	66	0,01	
						\$ (642)	\$ 922	\$ 280	0,04

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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
BOA	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,245 %	02.10.2025	ILS 67.900	\$ 0	\$ (34)	\$ (34)	0,00
CBK	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,430	01.07.2029	KRW 100	0	0	0	0,00
GLM	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,245	10.12.2025	ILS 10.900	0	(3)	(3)	0,00
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,053	16.12.2025	MYR 5.300	0	(4)	(4)	0,00
MYC	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,188	16.12.2025	23.900	0	18	18	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,715	16.12.2025	THB 11.000	0	1	1	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,768	16.12.2025	274.500	0	62	62	0,01
						\$ 0	\$ 40	\$ 40	0,01

## 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	\$ 100	21.06.2021	\$ 0	\$ 1	\$ 1	0,00	
FBF	Erhalt	DWRTFT Index	36	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	367	07.04.2021	0	(1)	(1)	(0,00)	
	Erhalt	DWRTFT Index	1.619	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	16.517	25.08.2021	0	4	4	0,00	
JPM	Erhalt	DWRTFT Index	757	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	7.709	15.04.2021	0	(12)	(12)	(0,00)	
	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	
	Zahlung	JPPMRFL Index	135.427	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	40.847	03.11.2021	0	(14)	(14)	(0,00)	
	Zahlung	JPPMTOAL Index	374.962	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	37.608	30.11.2021	0	308	308	0,04	
	Erhalt	JPPMTOAS Index	312.809	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	31.094	30.11.2021	0	(84)	(84)	(0,01)	
								\$ 0	\$ 203	\$ 203	0,03

## VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt Volatilität	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 <sup>(1)</sup>	6,425 %	05.11.2021	\$ 62	\$ 0	\$ 15	\$ 15	0,00
JPM	Zahlung	USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup>	6,350	24.11.2021	62	0	7	7	0,00
						\$ 0	\$ 22	\$ 22	0,00

<sup>(1)</sup> Varianz-Swaps

Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	01.2021	PLN	89	\$ 23	\$ 0	\$ (1)	0,00
	01.2021	\$	22.280	¥ 2.317.040	163	0	163
	03.2021	INR	35.400	\$ 471	0	(10)	(10)
BPS	01.2021	CAD	2.472	1.907	0	(34)	(34)
	01.2021	€	2.052	2.513	2	0	2
	01.2021	PLN	30	8	0	0	0
	01.2021	\$	2.661	AUD 3.618	131	0	131
	01.2021		1.578	€ 1.294	6	(1)	5
	01.2021	ZAR	2.555	\$ 162	0	(11)	(11)
	02.2021	DKK	26.003	4.150	0	(127)	(127)
	03.2021	KRW	708.833	640	0	(11)	(11)
	03.2021	\$	1.039	HKD 8.056	0	0	0
	04.2021		42	MXN 863	0	0	0
BRC	01.2021	BRL	2.021	\$ 381	0	(8)	(8)
	01.2021	\$	389	BRL 2.021	0	0	0
CBK	01.2021		628	€ 514	1	0	1
	01.2021	BRL	11.009	\$ 2.073	0	(47)	(47)
	01.2021	PEN	4.296	1.195	7	0	7
	01.2021	\$	2.176	BRL 11.009	0	(56)	(56)
	01.2021		467	€ 389	9	0	9
	01.2021		5.981	HUF 1.833.875	206	0	206
	01.2021		2.097	¥ 218.423	19	0	19
	01.2021		25	PLN 96	0	0	0
	01.2021	ZAR	1.126	\$ 72	0	(5)	(5)
	02.2021	BRL	11.009	2.175	56	0	56
DUB GLM	02.2021	DKK	27.284	4.372	0	(116)	(116)
	03.2021	CNH	5.062	763	0	(12)	(12)
	03.2021	PEN	42.622	11.901	116	0	116
	05.2021	\$	7.957	PEN 28.994	57	(1)	56
	02.2021	PEN	6.302	\$ 1.752	9	0	9
	01.2021	¥	4.828.410	46.651	0	(117)	(117)
	01.2021	\$	839	¥ 86.500	0	(2)	(2)
	01.2021		6.922	NZD 9.855	174	0	174
	02.2021	DKK	21.087	\$ 3.383	0	(86)	(86)
	02.2021	RUB	1.023	13	0	0	0
HUS	02.2021	\$	410	DKK 2.485	0	(2)	(2)
	02.2021		46.664	¥ 4.828.410	119	0	119
	03.2021	DOP	45.228	\$ 761	0	(10)	(10)
	03.2021	¥	3.488.000	33.542	0	(269)	(269)
	03.2021	PEN	5.523	1.541	14	0	14
	03.2021	\$	1	MYR 4	0	0	0
	06.2021	DOP	38.844	\$ 657	3	0	3
	01.2021	£	6.351	8.494	0	(188)	(188)
	01.2021	PLN	75	20	0	0	0
	01.2021	\$	3.872	¥ 403.514	36	0	36
JPM	01.2021		6.685	SEK 56.870	240	0	240
	01.2021	ZAR	1.495	\$ 95	0	(7)	(7)
	02.2021	RUB	681	9	0	0	0
	03.2021	CNH	169.566	25.816	0	(160)	(160)
	03.2021	CNY	243.969	37.109	0	(198)	(198)
	03.2021	\$	1.051	CNY 6.969	15	0	15
	03.2021		40	PEN 144	0	(1)	(1)
	03.2021		955	SGD 1.281	14	0	14
	01.2021	CLP	68.526	\$ 87	0	(9)	(9)
	01.2021	\$	2.098	AUD 2.851	102	0	102
MYI	03.2021	PHP	48	\$ 1	0	0	0
	03.2021	\$	1	IDR 14.208	0	0	0
	01.2021	€	33	\$ 41	0	0	0
	01.2021	£	3.261	4.389	0	(69)	(69)
	01.2021	\$	1.793	CHF 1.624	44	0	44
	01.2021		1.034	€ 847	3	0	3
	01.2021		53	£ 39	0	0	0
	01.2021		190	HUF 58.874	9	0	9
	01.2021		12.923	NOK 114.412	441	0	441
	01.2021		1.518	¥ 157.600	8	0	8
RBC	03.2021	TWD	25.141	\$ 895	0	(11)	(11)
	01.2021	HUF	130.093	426	0	(13)	(13)
SCX	01.2021	\$	1.226	AUD 1.665	58	0	58
	01.2021		44.795	€ 37.390	956	(1)	955
	01.2021		416	ZAR 6.114	0	(1)	(1)
	01.2021	ZAR	112.695	\$ 7.436	0	(217)	(217)
	02.2021	\$	45.064	€ 36.805	0	0	0
SSB	02.2021		437	ILS 1.499	31	0	31
	01.2021	ZAR	108.355	\$ 7.131	0	(229)	(229)
	01.2021	\$	16.601	¥ 1.731.833	174	0	174
UAG	01.2021		4.119	AUD 5.602	204	0	204
	01.2021		8.183	MXN 163.115	0	(12)	(12)
	02.2021		32.530	\$ 5.208	0	(142)	(142)
	02.2021	RUB	2.252	30	0	(1)	(1)
	03.2021	\$	1	TRY 8	0	0	0
				\$ 3.427	\$ (2.185)	\$ 1.242	0,18

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilklassen 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	01.2021	IDR	1.766.450	\$	124	\$	(1)	0,00		
	01.2021	¥	924.087		8.886		(65)	(0,01)		
	01.2021	NOK	14.452		1.635		(53)	(0,01)		
	01.2021	\$	967	€	787		(4)	0,00		
	01.2021		125	IDR	1.766.450		0	0,00		
	01.2021		1.434	MXN	28.798		11	0,00		
	02.2021	MXN	28.798	\$	1.430		(11)	0,00		
	01.2021	AUD	5.432		3.996		(197)	(0,03)		
	01.2021	CHF	507		573		0	0,00		
	01.2021	€	3.000		3.640		(31)	(0,01)		
BPS	01.2021	£	1.095		1.462		(34)	(0,01)		
	01.2021	TWD	105.542		3.729		(27)	0,00		
	01.2021	\$	95.107	€	79.214	1.826	(8)	1.818	0,26	
	01.2021		12.032	HKD	93.273		(2)	(2)	0,00	
	01.2021		2.941	SGD	3.902	11	0	11	0,00	
	01.2021		3.756	TWD	105.542		0	0	0,00	
	02.2021	DKK	18.118	\$	2.924		(56)	(56)	(0,01)	
	02.2021	HKD	93.290		12.034	1	0	1	0,00	
	02.2021	SGD	3.902		2.941	0	(11)	(11)	0,00	
	01.2021	BRL	12.328		2.323	0	(50)	(50)	(0,01)	
BRC	01.2021	\$	2.372	BRL	12.328	1	0	1	0,00	
	02.2021	CNY	2.364	\$	360	0	(2)	(2)	0,00	
	01.2021	BRL	14.527		2.806	10	(1)	9	0,00	
	01.2021	CLP	144.422		190	0	(13)	(13)	0,00	
	01.2021	€	598		721	0	(10)	(10)	0,00	
	01.2021	¥	122.895		1.183	0	(8)	(8)	0,00	
	01.2021	NZD	2.287		1.609	0	(38)	(38)	(0,01)	
	01.2021	RUB	58.740		768	0	(26)	(26)	0,00	
	01.2021	SEK	7.083		831	0	(32)	(32)	(0,01)	
	01.2021	\$	2.871	BRL	14.527	0	(74)	(74)	(0,01)	
CBK	01.2021		198	CLP	144.422	5	0	5	0,00	
	01.2021		95	€	79	2	0	2	0,00	
	01.2021	ZAR	41.023	\$	2.691	0	(100)	(100)	(0,02)	
	02.2021	BRL	14.527		2.870	74	0	74	0,01	
	02.2021	CLP	144.422		198	0	(5)	(5)	0,00	
	01.2021	MXN	28.798		1.429	0	(16)	(16)	0,00	
	01.2021	MYR	3.181		775	0	(16)	(16)	0,00	
	01.2021	PHP	29.587		612	0	(4)	(4)	0,00	
	01.2021	\$	20.720	¥	2.144.565	52	0	52	0,01	
	01.2021		785	MYR	3.181	6	0	6	0,00	
GLM	01.2021		1.014	THB	30.446	2	0	2	0,00	
	02.2021	¥	2.144.565	\$	20.726	0	(53)	(53)	(0,01)	
	02.2021	MYR	3.191		787	0	(8)	(8)	0,00	
	02.2021	THB	30.445		1.014	0	(2)	(2)	0,00	
	01.2021	AUD	581		429	0	(19)	(19)	0,00	
	01.2021	CAD	831		649	0	(4)	(4)	0,00	
	01.2021	CNY	10.097		1.548	3	0	3	0,00	
	01.2021	€	466		570	1	(2)	(1)	0,00	
	01.2021	£	7.927		10.601	0	(236)	(236)	(0,03)	
	01.2021	HKD	73.861		9.528	2	0	2	0,00	
HUS	01.2021	IDR	7.065.801		499	0	(4)	(4)	0,00	
	01.2021	INR	137.673		1.840	0	(44)	(44)	(0,01)	
	01.2021	¥	158.297		1.519	0	(14)	(14)	0,00	
	01.2021	KRW	4.586.478		4.216	0	(7)	(7)	0,00	
	01.2021	SEK	28.952		3.403	0	(122)	(122)	(0,02)	
	01.2021	SGD	1.416		1.058	0	(14)	(14)	0,00	
	01.2021	THB	17.410		577	0	(4)	(4)	0,00	
	01.2021	TWD	178.653		6.358	0	0	0	0,00	
	01.2021	\$	1.544	CNY	10.097	0	0	0	0,00	
	01.2021		35.502	€	29.583	699	0	699	0,10	
HUS	01.2021		498	IDR	7.065.801	5	0	5	0,00	
	01.2021		3.019	INR	222.466	26	0	26	0,00	
	01.2021		4.197	KRW	4.586.478	25	0	25	0,00	
	01.2021		614	PHP	29.587	2	0	2	0,00	
	01.2021		6.379	TWD	178.653	0	(21)	(21)	0,00	
	02.2021	CNY	10.124	\$	1.545	0	(7)	(7)	0,00	
	02.2021	HKD	2.361		305	0	0	0	0,00	
	02.2021	IDR	7.068.345		497	0	(10)	(10)	0,00	
	02.2021	INR	222.987		3.017	0	(28)	(28)	0,00	
	02.2021	KRW	4.591.524		4.202	0	(21)	(21)	0,00	
HUS	02.2021	PHP	29.669		615	0	(2)	(2)	0,00	
	02.2021	TWD	177.506		6.390	45	0	45	0,01	
	01.2021	HKD	4.745		612	0	0	0	0,00	
	01.2021	THB	13.036		434	0	(1)	(1)	0,00	
	JPM	01.2021	AUD	1.597		1.175	0	(57)	(57)	(0,01)
		01.2021	IDR	1.783.400		126	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$	1.024	€	838	2	0	2	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
	01.2021	\$	126	IDR 1.783.400	\$ 0	\$ 0	0,00
	02.2021	KRW	1.240.838	\$ 1.141	0	0	0,00
	02.2021	TWD	34.462	1.232	0	0	0,00
MYI	01.2021	AUD	297	225	0	(4)	(4)
	01.2021	CHF	6.729	7.430	0	(184)	(184)
	01.2021	€	116	142	0	(1)	(1)
	01.2021	INR	84.793	1.140	0	(21)	(21)
	01.2021	¥	207.833	1.993	0	(20)	(20)
	01.2021	KRW	656.358	605	1	0	1
	01.2021	NOK	7.353	831	0	(28)	(28)
	01.2021	NZD	613	430	0	(11)	(11)
	01.2021	PLN	2.402	646	4	(3)	1
	01.2021	\$	603	KRW 656.358	1	0	1
NGF	01.2021	SGD	2.486	\$ 1.855	0	(26)	(26)
RBC	01.2021	CAD	584	454	0	(4)	(4)
	01.2021	HKD	3.348	432	0	0	0
	01.2021	¥	52.060	504	0	0	0
	01.2021	TWD	73.111	2.573	0	(29)	(29)
	01.2021	\$	2.602	TWD 73.111	0	0	0
RYL	02.2021	MXN	4.518	\$ 224	0	(2)	(2)
SCX	01.2021	CHF	944	1.044	0	(24)	(24)
	01.2021	CNY	10.097	1.538	0	(6)	(6)
	01.2021	\$	1.548	CNY 10.097	0	(4)	(4)
	01.2021		145.756	€ 121.706	3.158	0	3.158
	02.2021		235.043	191.968	0	(1)	(1)
SSB	01.2021	IDR	7.065.801	\$ 500	0	(3)	(3)
	01.2021	\$	495	IDR 7.065.801	8	0	8
	02.2021	DKK	4.234	\$ 690	0	(6)	(6)
	02.2021	TWD	7.382	264	0	0	0
TOR	01.2021	CAD	11.019	8.505	0	(145)	(145)
	01.2021	¥	679.393	6.513	0	(68)	(68)
	01.2021	\$	8.649	CAD 11.019	0	0	0
	01.2021		137.427	€ 114.752	2.978	0	2.978
	02.2021	CAD	11.019	\$ 8.650	0	0	0
	02.2021	\$	140.460	€ 114.718	0	(1)	(1)
UAG	01.2021	AUD	1.882	\$ 1.382	0	(70)	(70)
	01.2021	HKD	11.319	1.460	0	0	0
	01.2021	ILS	812	245	0	(8)	(8)
	01.2021	KRW	3.930.120	3.556	0	(62)	(62)
	01.2021	SEK	2.185	264	0	(2)	(2)
	01.2021	\$	3.612	KRW 3.930.120	6	0	6
					\$ 8.967	\$ (2.309)	\$ 6.658
							0,95

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	IDR	26.154	\$ 2	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	¥	11.433	\$ 110	0	(1)	(1)
	01.2021	NOK	187	21	0	(1)	(1)
	01.2021	\$	13	CAD 17	0	0	0,00
	01.2021		2	€ 2	0	0	0,00
	01.2021		2	IDR 26.154	0	0	0,00
	01.2021		19	MXN 383	0	0	0,00
BPS	02.2021	MXN	383	\$ 19	0	0	0,00
	01.2021	AUD	69	51	0	(3)	(3)
	01.2021	CAD	14	11	0	0	0,00
	01.2021	SEK	59	7	0	0	0,00
	01.2021	TWD	1.160	41	0	0	0,00
	01.2021	\$	329	£ 246	8	0	8
	01.2021		151	HKD 1.169	0	0	0,00
	01.2021		36	SGD 48	0	0	0,00
	01.2021		41	TWD 1.160	0	0	0,00
	02.2021	DKK	228	\$ 37	0	(1)	(1)
	02.2021	HKD	1.148	148	0	0	0,00
BRC	02.2021	SGD	48	36	0	0	0,00
	01.2021	BRL	178	34	0	(1)	(1)
	01.2021	SGD	15	11	0	0	0,00
	01.2021	\$	34	BRL 178	0	0	0,00
	02.2021	SGD	4	\$ 3	0	0	0,00
CBK	01.2021	BRL	178	34	0	0	0,00
	01.2021	CLP	2.256	3	0	0	0,00
	01.2021	£	21	29	0	0	0,00
	01.2021	¥	1.116	11	0	0	0,00
	01.2021	NOK	85	10	0	0	0,00
	01.2021	NZD	35	25	0	(1)	(1)
	01.2021	RUB	1.867	24	0	(1)	(1)
	01.2021	TWD	1.064	38	0	0	0,00
	01.2021	\$	35	BRL 178	0	(1)	(1)
	01.2021		3	CLP 2.256	0	0	0,00
	01.2021		5	€ 4	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	
	01.2021	\$	1.224	£ 915	\$ 28	\$ 0	28	0,00
	01.2021		14	RUB 1.038		0	0	0,00
	01.2021		38	TWD 1.064		0	0	0,00
	01.2021	ZAR	481	\$ 32		(1)	(1)	0,00
	02.2021	BRL	178	35	1	0	1	0,00
	02.2021	CLP	2.256	3	0	0	0	0,00
GLM	01.2021	MXN	660	33	0	0	0	0,00
	01.2021	MYR	39	10	0	0	0	0,00
	01.2021	\$	246	¥ 25.457	1	0	1	0,00
	01.2021		10	MYR 39	0	0	0	0,00
	01.2021		10	THB 302	0	0	0	0,00
	02.2021	¥	25.457	\$ 246	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	MYR	40	10	0	0	0	0,00
	02.2021	THB	302	10	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	CNY	138	21	0	0	0	0,00
	01.2021	€	29	35	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	HKD	734	95	0	0	0	0,00
	01.2021	IDR	104.616	7	0	0	0	0,00
	01.2021	INR	2.333	31	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	¥	2.062	20	0	0	0	0,00
	01.2021	KRW	56.700	52	0	0	0	0,00
	01.2021	SEK	390	46	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	SGD	8	6	0	0	0	0,00
	01.2021	THB	302	10	0	0	0	0,00
	01.2021	TWD	2.308	82	0	0	0	0,00
	01.2021	\$	21	CNY 138	0	0	0	0,00
	01.2021		1.741	£ 1.302	38	0	38	0,01
	01.2021		7	IDR 104.616	0	0	0	0,00
	01.2021		38	INR 2.777	0	0	0	0,00
	01.2021		52	KRW 56.700	0	0	0	0,00
	01.2021		8	PHP 385	0	0	0	0,00
	01.2021		3	SGD 4	0	0	0	0,00
	01.2021		82	TWD 2.308	0	0	0	0,00
	02.2021	CNY	138	\$ 21	0	0	0	0,00
	02.2021	IDR	104.653	7	0	0	0	0,00
	02.2021	INR	2.783	38	0	0	0	0,00
	02.2021	KRW	56.762	52	0	0	0	0,00
	02.2021	PHP	386	8	0	0	0	0,00
	02.2021	TWD	2.294	83	1	0	1	0,00
IND	01.2021	HKD	202	26	0	0	0	0,00
JPM	01.2021	AUD	22	16	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	IDR	26.405	2	0	0	0	0,00
	01.2021	\$	2	IDR 26.405	0	0	0	0,00
	02.2021	KRW	14.138	\$ 13	0	0	0	0,00
	02.2021	TWD	364	13	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	CHF	91	100	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	INR	444	6	0	0	0	0,00
	01.2021	¥	1.994	19	0	0	0	0,00
	01.2021	KRW	13.019	12	0	0	0	0,00
	01.2021	PHP	385	8	0	0	0	0,00
	01.2021	PLN	26	7	0	0	0	0,00
	01.2021	\$	12	KRW 13.019	0	0	0	0,00
NGF	02.2021	DKK	66	\$ 11	0	0	0	0,00
RBC	01.2021	SGD	25	19	0	0	0	0,00
	01.2021	CAD	19	15	0	0	0	0,00
	01.2021	HKD	39	5	0	0	0	0,00
	01.2021	TWD	84	3	0	0	0	0,00
	01.2021	\$	3	TWD 84	0	0	0	0,00
SCX	02.2021	TWD	84	\$ 3	0	0	0	0,00
	01.2021	CNY	138	21	0	0	0	0,00
	01.2021	€	225	269	0	(6)	(6)	(0,01)
	01.2021	\$	21	CNY 138	0	0	0	0,00
	02.2021	€	225	\$ 275	0	0	0	0,00
SSB	02.2021	\$	3	TWD 84	0	0	0	0,00
	01.2021	HKD	23	\$ 3	0	0	0	0,00
	01.2021	IDR	104.616	7	0	0	0	0,00
	01.2021	\$	1.861	£ 1.394	45	0	45	0,01
	01.2021		7	IDR 104.616	0	0	0	0,00
TOR	01.2021		14	MXN 277	0	0	0	0,00
	01.2021	CAD	134	\$ 103	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	¥	8.851	85	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$	105	CAD 134	0	0	0	0,00
	02.2021	CAD	134	\$ 105	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	AUD	26	19	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	CHF	5	6	0	0	0	0,00
	01.2021	HKD	171	22	0	0	0	0,00
	01.2021	ILS	12	4	0	0	0	0,00
	01.2021	KRW	43.681	40	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	NZD	4	3	0	0	0	0,00
	01.2021	SGD	4	3	0	0	0	0,00
	01.2021	\$	40	KRW 43.681	0	0	0	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
	02.2021	HKD	23	\$ 3	\$ 0	\$ 0	0,00
				\$ 122	\$ (31)	\$ 91	0,01
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ 8.703</b>	<b>1,24</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>\$ 673.063</b>	<b>95,82</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>\$ 29.367</b>	<b>4,18</b>
<b>Nettovermögen</b>						<b>\$ 702.430</b>	<b>100,00</b>

## 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 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) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurde zum 31. Dezember 2020 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 645 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 39.215 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	9.653	9.596	0	19.249
<b>Summen</b>	<b>\$ 240.407</b>	<b>\$ 431.294</b>	<b>\$ 1.362</b>	<b>\$ 673.063</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 58.193	\$ 525.321	\$ 420	\$ 583.934
Investmentfonds	245.043	0	0	245.043
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(2.115)	13.670	0	11.555
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(165.996)	0	(165.996)
<b>Summen</b>	<b>\$ 301.121</b>	<b>\$ 372.995</b>	<b>\$ 420</b>	<b>\$ 674.536</b>

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 167	\$ (180)	\$ (13)
BPS	1.431	(1.880)	(449)
BRC	(58)	0	(58)
CBK	42	0	42
DUB	24	(60)	(36)
FBF	3	383	386
GLM	(229)	(220)	(449)
GST	38	0	38
HUS	35	(610)	(575)
IND	(1)	0	(1)
JPM	306	(1.790)	(1.484)
MYC	239	(185)	54

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
MYI	\$ 95	\$ 0	\$ 95
NGF	(26)	0	(26)
RBC	(36)	0	(36)
RYL	(2)	0	(2)
SAL	18	0	18
SCX	3.930	(4.830)	(900)
SSB	(185)	262	77
TOR	2.935	(3.670)	(735)
UAG	(23)	0	(23)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	21,79	26,48
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	37,21	45,22
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,07	k. A.
Investmentfonds	32,87	30,09
Pensionsgeschäfte	0,14	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	1,37	(0,28)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,13	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate	1,24	1,68
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(20,38)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(4,06)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	9,89	10,11
Wandelanleihen & Wechsel	0,19	k. A.
US-Regierungsbehörden	0,26	21,67
US-Schatzobligationen	2,56	5,97
Non-Agency-MBS	1,80	1,80
Forderungsbesicherte Wertpapiere	5,78	6,15
Staatsemissionen	14,66	4,21
Stammaktien	1,52	5,45
Vorzugswertpapiere	0,56	0,55
Real Estate Investment Trusts	4,19	2,11
Kurzfristige Instrumente	18,66	13,68
Investmentfonds	32,87	30,09
Pensionsgeschäfte	0,14	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	1,37	(0,26)
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Optionen auf Indizes	k. A.	0,03
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Indizes	k. A.	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	k. A.	0,01
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,03	0,06
Zinsswaps	0,10	(0,04)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Barrier-Optionen	k. A.	0,00
Devisenoptionen	0,24	k. A.
Zinsswapoption	0,00	0,00
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Straddle-Optionen	k. A.	0,23
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	(0,01)
Devisenoptionen	(0,22)	(0,04)
Inflation-Capped Options	0,00	0,00
Zinsswapoption	k. A.	(0,03)
Zinsscaps	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,04	0,03
Zinsswaps	0,01	0,00
Total Return Swaps auf Indizes	0,03	0,95
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	(0,06)
Varianz-Swaps	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,18	0,06
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,96	0,55
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(20,38)
Sonstige Aktiva und Passiva	4,18	17,17
Nettovermögen	100,00	100,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global High Yield 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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>BELGIEN</b>				<b>BELGIEN</b>				<b>BELGIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Sarens Finance Co. NV 5,750 % fällig am 21.02.2027	€ 4.000	\$ 4.558	0,08	UPCB Finance Ltd. 3,625 % fällig am 15.06.2029	€ 12.500	15.910	0,29	IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % bar oder 5,500 % PIK) 4,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	\$ 6.000	\$ 6.233	0,12
<b>BERMUDAS</b>				<b>BERMUDAS</b>				<b>BERMUDAS</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Digicel Group 0.5 Ltd. (5,000 % bar und 3,000 % PIK) 8,000 % fällig am 01.04.2025 (b)	\$ 262	138	0,00	Wynn Macau Ltd. 5,125 % fällig am 15.12.2029 5,500 % fällig am 01.10.2027	\$ 2.500 5.000	2.558 5.199	0,05 0,10	Nidda BondCo GmbH 5,000 % fällig am 30.09.2025	€ 24.000	29.778	0,55
<b>KANADA</b>				<b>KANADA</b>				<b>KANADA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
B.C. Unlimited Liability Co. 3,500 % fällig am 15.02.2029 4,000 % fällig am 15.10.2030 4,250 % fällig am 15.05.2024 4,375 % fällig am 15.01.2028	4.000 15.000 2.582 3.250	4.003 15.220 2.636 3.353	0,07 0,28 0,05 0,06	Nokia Oyj 2,375 % fällig am 15.05.2025 3,125 % fällig am 15.05.2028	2.500 3.750	3.241 5.056	0,06 0,09	Nidda Healthcare Holding GmbH 3,500 % fällig am 30.09.2024	26.750	32.800	0,61
<b>DÄNEMARK</b>				<b>DÄNEMARK</b>				<b>DÄNEMARK</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bausch Health Cos., Inc. 5,000 % fällig am 30.01.2028 5,250 % fällig am 30.01.2030 5,250 % fällig am 15.02.2031 5,500 % fällig am 01.11.2025 5,750 % fällig am 15.08.2027 6,125 % fällig am 15.04.2025 6,250 % fällig am 15.02.2029 7,000 % fällig am 15.03.2024 7,000 % fällig am 15.01.2028 7,250 % fällig am 30.05.2029 9,000 % fällig am 15.12.2025	5.000 7.000 4.000 11.310 2.500 6.000 8.000 6.000 3.625 5.000 2.000	5.159 7.358 4.186 11.732 2.686 6.190 8.702 6.178 3.991 5.629 2.212	0,10 0,14 0,08 0,22 0,05 0,11 0,16 0,11 0,07 0,10 0,04	DKT Finance ApS 7,000 % fällig am 17.06.2023 9,375 % fällig am 17.06.2023	€ 2.000 \$ 6.000	2.529 6.225	0,05 0,11	Platin GmbH 5,375 % fällig am 15.06.2023	5.000	6.113	0,11
<b>FRANKREICH</b>				<b>FRANKREICH</b>				<b>FRANKREICH</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bombardier, Inc. 5,750 % fällig am 15.03.2022 7,500 % fällig am 01.12.2024 7,500 % fällig am 15.03.2025 7,875 % fällig am 15.04.2027 8,750 % fällig am 01.12.2021	4.000 2.750 7.000 3.000 5.000	4.085 2.645 6.501 2.763 5.208	0,08 0,05 0,12 0,05 0,10	Norican A/S 4,500 % fällig am 15.05.2023	€ 5.000	5.340	0,10	Techem Verwaltungsgesellschaft mbH 2,000 % fällig am 15.07.2025	15.000	18.295	0,34
<b>FINNLAND</b>				<b>FINNLAND</b>				<b>FINNLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Cenovus Energy, Inc. 4,250 % fällig am 15.04.2027 5,250 % fällig am 15.06.2037 5,375 % fällig am 15.07.2025 6,750 % fällig am 15.11.2039	5.000 2.000 2.000 6.000	5.464 2.267 2.257 7.942	0,10 0,04 0,04 0,15	Summe Dänemark		14.094	0,26	Vertical Midco GmbH 4,375 % fällig am 15.07.2027	7.000	9.051	0,17
<b>IRLAND</b>				<b>IRLAND</b>				<b>IRLAND</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
GFL Environmental, Inc. 3,500 % fällig am 01.09.2028 4,000 % fällig am 01.08.2028 4,250 % fällig am 01.06.2025	4.000 4.000 2.500	4.077 4.038 2.598	0,08 0,07 0,05	Summe Finnland		8.297	0,15	WEPA Hygieneprodukte GmbH 2,875 % fällig am 15.12.2027	12.000	14.911	0,28
<b>ITALIEN</b>				<b>ITALIEN</b>				<b>ITALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Masonite International Corp. 5,375 % fällig am 01.02.2028	7.000	7.528	0,14	Summe Frankreich		116.464	2,16	Motion Bondco DAC 4,500 % fällig am 15.11.2027 6,625 % fällig am 15.11.2027	3.000 \$ 6.000	3.568 6.292	0,06 0,12
<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				<b>JERSEY, KANALINSELN</b>				<b>JERSEY, KANALINSELN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
MEG Energy Corp. 7,000 % fällig am 31.03.2024 7,125 % fällig am 01.02.2027	2.400 7.000	2.430 7.245	0,05 0,13	Ceramtac BondCo GmbH 5,250 % fällig am 15.12.2025	22.000	27.524	0,51	Atlantia SpA 1,625 % fällig am 03.02.2025 1,875 % fällig am 13.07.2027	€ 2.000 12.500	2.446 15.160	0,04 0,28
<b>LIBERIA</b>				<b>LIBERIA</b>				<b>LIBERIA</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>LUXEMBURG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Open Text Corp. 5,875 % fällig am 01.06.2026	7.000	7.280	0,13	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3,500 % fällig am 11.02.2027 4,375 % fällig am 15.01.2028	11.000 7.000	13.543 8.805	0,25 0,16	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 5,375 % fällig am 18.01.2028 8,000 % fällig am 22.01.2030 10,500 % fällig am 23.07.2029	9.700 5.000 4.000	10.340 6.052 6.074	0,19 0,11 0,11
<b>LUXEMBURG</b>				<b>LUXEMBURG</b>				<b>LUXEMBURG</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>LUXEMBURG</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Teine Energy Ltd. 6,875 % fällig am 30.09.2022	3.050	3.053	0,06	Deutsche Bank AG 6,000 % fällig am 30.10.2025 (f)(h)	\$ 5.000	5.025	0,09	F-Brasile SpA 7,375 % fällig am 15.08.2026	\$ 5.000	4.863	0,09
<b>NETTO-VERMÖGEN</b>				<b>NETTO-VERMÖGEN</b>				<b>NETTO-VERMÖGEN</b>			
Videotron Ltd. 5,000 % fällig am 15.07.2022 5,125 % fällig am 15.04.2027	2.000 3.000	2.106 3.191	0,04 0,06	IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK) 3,625 % fällig am 15.05.2025 (b)	€ 2.750	3.440	0,06	Intesa Sanpaolo SpA 5,017 % fällig am 26.06.2024 5,710 % fällig am 15.01.2026 5,875 % fällig am 01.09.2031 (f)(h) 6,250 % fällig am 16.05.2024 (f)(h) 7,700 % fällig am 17.09.2025 (f)(h) 7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h)	9.250 5.000 € 5.000 5.500 \$ 7.000 € 4.000	10.125 5.727 6.879 7.350 7.963 5.879	0,19 0,11 0,13 0,14 0,15 0,11
<b>NETTO-VERMÖGEN</b>				<b>NETTO-VERMÖGEN</b>				<b>NETTO-VERMÖGEN</b>			
Summe Kanada		171.913	3,18	IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	3.000	3.783	0,07	Summe Irland		9.860	0,18
<b>NETTO-VERMÖGEN</b>				<b>NETTO-VERMÖGEN</b>				<b>NETTO-VERMÖGEN</b>			
Transocean Poseidon Ltd. 6,875 % fällig am 01.02.2027	3.000	2.737	0,05	IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK) 3,875 % fällig am 15.05.2027 (b)	2.000	2.549	0,05	Summe Italien		153.978	2,85
<b>NETTO-VERMÖGEN</b>				<b>NETTO-VERMÖGEN</b>				<b>NETTO-VERMÖGEN</b>			
Transocean Proteus Ltd. 6,250 % fällig am 01.12.2024	2.400	2.265	0,04					Summe Jersey, Kanalinseln		14.743	0,27

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
Aramark International Finance SARL 3,125 % fällig am 01.04.2025	€ 5.000	\$ 6.169	0,11	Ashland Services BV 2,000 % fällig am 30.01.2028	€ 15.000	\$ 18.376	0,34	Foodco Bondco S.A. 6,250 % fällig am 15.05.2026	€ 3.000	\$ 3.298	0,06
Camelot Finance S.A. 4,500 % fällig am 01.11.2026	\$ 5.000	5.228	0,10	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3,750 % fällig am 15.01.2025	10.000	12.503	0,23	Grifols S.A. 1,625 % fällig am 15.02.2025	7.000	8.603	0,16
Cirsa Finance International SARL 4,750 % fällig am 22.05.2025	€ 3.000	3.605	0,07	Clear Channel International BV 6,625 % fällig am 01.08.2025	\$ 3.000	3.176	0,06	2,250 % fällig am 15.11.2027	5.000	6.222	0,12
6,250 % fällig am 20.12.2023	7.000	8.578	0,16	Diamond BC BV 5,625 % fällig am 15.08.2025	€ 17.500	21.828	0,40	Lorca Telecom Bondco S.A. 4,000 % fällig am 18.09.2027	7.150	9.233	0,17
FAGE International S.A. 5,625 % fällig am 15.08.2026	\$ 3.000	3.086	0,06	Energizer Gamma Acquisition BV 4,625 % fällig am 15.02.2026	€ 8.507	10.825	0,20	Summe Spanien		36.106	0,67
Intelsat Jackson Holdings S.A. 5,500 % fällig am 01.08.2023 ^	5.000	3.400	0,06	LeasePlan Corp. NV 7,375 % fällig am 29.05.2024 (f)(h)	7.000	9.407	0,17	<b>SCHWEDEN</b>			
LHMC Finco 2 SARL (7,250 % bar oder 8,000 % PIK) 7,250 % fällig am 02.10.2025 (b)	€ 3.120	3.489	0,06	Nouryon Holding BV 6,500 % fällig am 01.10.2026	16.000	20.721	0,38	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024	7.250	8.990	0,17	8,000 % fällig am 01.10.2026	\$ 5.000	5.322	0,10	Intrum AB 2,750 % fällig am 15.07.2022	200	246	0,01
Nielsen Co. Luxembourg SARL 5,000 % fällig am 01.02.2025 (j)	\$ 6.000	6.169	0,11	OI European Group BV 2,875 % fällig am 15.02.2025	€ 4.000	4.982	0,09	3,000 % fällig am 15.09.2027	12.000	14.168	0,26
Rossini SARL 6,750 % fällig am 30.10.2025	€ 5.000	6.542	0,12	2,000 % fällig am 01.03.2027	1.375	1.629	0,03	3,125 % fällig am 15.07.2024	4.000	4.920	0,09
SIG Combibloc Purchase Co. SARL 1,875 % fällig am 18.06.2023	3.750	4.751	0,09	Schoeller Packaging BV 6,375 % fällig am 01.11.2024	7.500	9.428	0,17	3,500 % fällig am 15.07.2026	4.000	4.870	0,09
2,125 % fällig am 18.06.2025	7.650	9.866	0,18	Sensata Technologies BV 4,875 % fällig am 15.10.2023	\$ 4.000	4.325	0,08	4,875 % fällig am 15.08.2025	3.000	3.813	0,07
Summer BC Holdco SARL 5,750 % fällig am 31.10.2026	6.000	7.764	0,14	5,000 % fällig am 01.10.2025	1.000	1.114	0,02	Summe Schweden		28.017	0,52
9,250 % fällig am 31.10.2027	3.154	4.090	0,07	Sigma Holdco BV 5,750 % fällig am 15.05.2026	€ 15.000	18.215	0,34	<b>SCHWEIZ</b>			
Telecom Italia Capital S.A. 6,375 % fällig am 15.11.2033	\$ 7.500	9.242	0,17	7,875 % fällig am 15.05.2026	\$ 6.600	6.780	0,13	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
7,200 % fällig am 18.07.2036	3.000	4.057	0,07	Sunshine Mid BV 6,500 % fällig am 15.05.2026	€ 5.000	6.376	0,12	Credit Suisse Group AG 6,375 % fällig am 21.08.2026 (f)(h)	\$ 4.900	5.461	0,10
Telenet Finance Luxembourg Notes SARL 3,500 % fällig am 01.03.2028	€ 5.000	6.362	0,12	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % fällig am 31.03.2027	7.500	8.362	0,16	<b>GROSSBRITANNIEN</b>			
		133.554	2,47	2,200 % fällig am 21.07.2021	\$ 2.073	2.072	0,04	<b>AKTIEN</b>			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				3,150 % fällig am 01.10.2026	8.000	7.705	0,14	<b>STAMMAKTIEN</b>			
Intelsat Jackson Holdings S.A. 3,600 % - 6,500 % fällig am 13.07.2022	\$ 875	895	0,02	4,100 % fällig am 01.10.2046	6.000	5.355	0,10	Bibby Offshore Services PLC (c)(i)	257.031	1.186	0,02
Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 3,398 % fällig am 30.06.2025	3.974	3.925	0,07	Trivium Packaging Finance BV 3,750 % fällig am 15.08.2026	€ 4.250	5.366	0,10	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Sunshine Luxembourg SARL 4,254 % fällig am 01.10.2026	14.862	14.925	0,28	5,500 % fällig am 15.08.2026	\$ 5.000	5.297	0,10	Afren PLC 10,250 % fällig am 08.04.2019 ^	\$ 9.691	247	0,00
		19.745	0,37	United Group BV 3,125 % fällig am 15.02.2026	€ 7.000	8.415	0,16	Arqiva Broadcast Finance PLC 6,750 % fällig am 30.09.2023	£ 5.000	7.073	0,13
Summe Luxemburg		153.299	2,84	3,250 % fällig am 15.02.2026	1.700	2.038	0,04	Barclays PLC 6,125 % fällig am 15.12.2025 (f)(h)	\$ 4.000	4.320	0,08
<b>MAURITIUS</b>				3,625 % fällig am 15.02.2028	5.000	6.011	0,11	Boparan Finance PLC 7,625 % fällig am 30.11.2025	£ 3.000	4.161	0,08
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				UPC Holding BV 3,875 % fällig am 15.06.2029	10.000	12.603	0,23	Drax Finco PLC 2,625 % fällig am 01.11.2025	€ 4.400	5.558	0,10
Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025	3.000	3.120	0,06	Ziggo Bond Co. BV 3,375 % fällig am 28.02.2030	10.000	12.344	0,23	FCE Bank PLC 1,134 % fällig am 10.02.2022	3.000	3.673	0,07
5,950 % fällig am 29.07.2026	3.500	3.798	0,07	5,125 % fällig am 28.02.2030	\$ 5.000	5.283	0,10	1,615 % fällig am 11.05.2023	900	1.107	0,02
Summe Mauritius		6.918	0,13	6,000 % fällig am 15.01.2027	10.000	10.586	0,20	1,875 % fällig am 24.06.2021	4.000	4.909	0,09
<b>MULTINATIONAL</b>				Ziggo BV 2,875 % fällig am 15.01.2030	€ 7.000	8.747	0,16	2,727 % fällig am 03.06.2022	£ 3.750	5.197	0,10
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,500 % fällig am 15.01.2027	\$ 11.419	11.940	0,22	Heathrow Finance PLC 4,375 % fällig am 01.03.2027	10.000	13.759	0,25
Ardagh Packaging Finance PLC 2,125 % fällig am 15.08.2026	€ 4.800	5.897	0,11	Summe Niederlande		272.564	5,05	4,625 % fällig am 01.09.2029	3.200	4.369	0,08
4,125 % fällig am 15.08.2026	\$ 12.000	12.555	0,23	<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				INEOS Finance PLC 2,125 % fällig am 15.11.2025	€ 2.250	2.729	0,05
5,250 % fällig am 15.08.2027	11.600	12.190	0,22	Diamond BC BV 3,147 % - 3,214 % fällig am 06.09.2024	4.987	4.924	0,09	2,875 % fällig am 01.05.2026	5.000	6.213	0,11
6,000 % fällig am 15.02.2025	964	1.000	0,02	Summe Niederlande		277.488	5,14	International Game Technology PLC 2,375 % fällig am 15.04.2028	2.500	3.047	0,06
CANPACK S.A. 2,375 % fällig am 01.11.2027	€ 4.100	5.186	0,10	<b>NORWEGEN</b>				3,500 % fällig am 15.07.2024	2.500	3.199	0,06
3,125 % fällig am 01.11.2025	\$ 6.500	6.541	0,12	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,250 % fällig am 15.01.2029	\$ 3.000	3.237	0,06
Clarios Global LP 4,375 % fällig am 15.05.2026	€ 14.000	17.822	0,33	Adevinta ASA 2,625 % fällig am 15.11.2025	€ 10.000	12.529	0,23	6,250 % fällig am 15.02.2022	4.596	4.754	0,09
8,500 % fällig am 15.05.2027	\$ 5.000	5.440	0,10	<b>PANAMA</b>				6,500 % fällig am 15.02.2025	10.000	11.205	0,21
Connect Finco SARL 6,750 % fällig am 01.10.2026	6.500	7.012	0,13	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Lloyds Banking Group PLC 7,500 % fällig am 27.06.2024 (f)(h)	6.000	6.780	0,13
Endo DAC 6,000 % fällig am 30.06.2028	5.759	4.901	0,09	Carnival Corp. 7,625 % fällig am 01.03.2026	\$ 7.250	7.912	0,15	7,625 % fällig am 27.06.2023 (f)(h)	£ 7.000	10.547	0,20
9,500 % fällig am 31.07.2027	4.273	4.778	0,09	<b>SPANIEN</b>				Nomad Foods Bondco PLC 3,250 % fällig am 15.05.2024	€ 3.000	3.728	0,07
Summe multinational		83.322	1,54	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				NWEN Finance PLC 5,875 % fällig am 21.06.2021	£ 3.250	4.508	0,08
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				RAC Bond Co. PLC 5,000 % fällig am 06.05.2046	2.884	3.966	0,07
Alcoa Nederland Holding BV 6,750 % fällig am 30.09.2024	1.000	1.043	0,02	Celnex Telecom S.A. 1,000 % fällig am 20.04.2027	€ 4.100	4.970	0,09	Rolls-Royce PLC 0,875 % fällig am 09.05.2024	€ 7.250	8.383	0,16
7,000 % fällig am 30.09.2026	1.500	1.600	0,03	1,875 % fällig am 26.06.2029	3.000	3.780	0,07	4,625 % fällig am 16.02.2026	2.500	3.319	0,06
								5,750 % fällig am 15.10.2027	£ 4.000	6.069	0,11
								Sensata Technologies UK Financing Co. PLC 6,250 % fällig am 15.02.2026	\$ 7.000	7.289	0,13









# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global High Yield 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	
				<b>US-SCHATZOBBLIGATIONEN</b>				<b>INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				
U.S. Renal Care, Inc. 5,147 % fällig am 26.06.2026	\$ 9.875	\$ 9.846	0,18	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	\$ 5.000	\$ 4.889	0,09	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)	1.219.084	\$ 14.251	0,26	
Welbilt, Inc. 2,645 % fällig am 23.10.2025	4.000	3.807	0,07	0,625 % fällig am 15.08.2030	15.000	14.627	0,27					
		53.888	1,00	1,500 % fällig am 15.02.2030	10.000	10.581	0,20					
								30.097 0,56				
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Summe USA				3.253.270 60,20				
Bear Stearns ALT-A Trust 3,472 % fällig am 25.03.2036 ^	55	47	0,00	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>								
				<b>U.S. TREASURY BILLS</b>								
Countrywide Alternative Loan Trust 5,500 % fällig am 25.11.2035	1.519	1.236	0,02	0,122 % fällig am 09.02.2021 (d)(e)	35.000	34.999	0,65	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (g)	3.637.652	46.778	0,87	
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 0,462 % fällig am 19.10.2036 ^	404	306	0,01	0,137 % fällig am 21.01.2021 (d)(e)	3.900	3.900	0,07					
HarborView Mortgage Loan Trust 0,282 % fällig am 19.03.2037	113	107	0,00	Summe kurzfristige Instrumente				38.899 0,72				
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 4,184 % fällig am 25.02.2036 ^	133	122	0,00	Summe Übertragbare Wertpapiere				\$ 4.866.996 90,07				
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 1,449 % fällig am 25.05.2047 ^	28	3	0,00									
1,579 % fällig am 25.05.2046 ^	108	91	0,00									
		1.912	0,03					Summe Investmentfonds \$ 471.018 8,72				

## 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<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000 %	20.12.2025	\$ 160.000	\$ 6.754	0,12
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ 6.754	0,12

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	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	\$ 10.000	22.03.2021	\$ (19)	\$ 1.257	\$ 1.238	0,02	
GST	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	220.000	22.03.2021	(466)	21.480	21.014	0,39	
								\$ (485)	\$ 22.737	\$ 22.252	0,41

#### DEVISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BPS	01.2021	£	\$	701	936	\$ 0	\$ (22)	0,00
	01.2021	\$	€	3.776	3.088	6	(4)	0,00
BRC	01.2021	€	\$	7.230	8.835	0	(12)	0,00
CBK	01.2021	\$	€	2.054	1.694	19	0	0,00
HUS	01.2021	€	\$	43.133	51.695	0	(1.085)	(0,02)
	01.2021	£	\$	63.301	84.659	0	(1.872)	(0,03)
	01.2021	\$	€	1.240	1.021	10	0	0,00
MYI	01.2021	€	\$	423	517	0	0	0,00
	01.2021	£	\$	908	1.233	0	(8)	0,00
	01.2021	SGD	\$	236	178	0	0	0,00
	01.2021	\$	€	775	630	0	(4)	0,00
	01.2021	£	\$	12.709	9.373	105	0	0,00
SCX	01.2021	CHF	\$	2.039	1.844	47	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2021	\$ 4.340	£ 3.270	\$ 130	\$ 0	\$ 130	0,00
TOR	01.2021	€ 943.002	\$ 1.129.334	0	(24.477)	(24.477)	(0,45)
	02.2021	943.002	1.154.587	0	(10)	(10)	0,00
UAG	01.2021	3.451	4.199	0	(23)	(23)	0,00
				\$ 317	\$ (27.517)	\$ (27.200)	(0,50)

**ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE**

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 19.037	CHF 17.196	\$ 418	\$ 0	\$ 418	0,01
BPS	01.2021	CHF 177	\$ 202	1	0	1	0,00
BRC	01.2021	60	67	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2021	71	80	0	0	0	0,00
GLM	01.2021	\$ 84	CHF 75	1	0	1	0,00
MYI	01.2021	21.359	19.344	526	0	526	0,01
SCX	01.2021	2.185	1.976	51	0	51	0,00
SSB	01.2021	21.423	19.305	418	0	418	0,01
UAG	01.2021	225	200	1	0	1	0,00
				\$ 1.416	\$ (1)	\$ 1.415	0,03

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	€ 1.522	\$ 1.869	\$ 7	\$ 0	\$ 7	0,00
BPS	01.2021	52.058	63.193	5	(513)	(508)	(0,01)
	01.2021	\$ 627.183	€ 523.617	13.494	(5)	13.489	0,25
	02.2021	119.688	97.754	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01.2021	906	742	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	€ 48.892	\$ 58.990	0	(838)	(838)	(0,02)
	01.2021	\$ 1.749	€ 1.447	22	0	22	0,00
HUS	01.2021	€ 111.910	\$ 136.123	0	(816)	(816)	(0,01)
	01.2021	\$ 35.282	€ 29.353	637	(1)	636	0,01
JPM	01.2021	€ 106	\$ 129	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	440	537	0	(2)	(2)	0,00
SCX	01.2021	\$ 763.619	€ 637.620	16.541	0	16.541	0,31
	02.2021	1.016.686	830.362	0	(4)	(4)	0,00
TOR	01.2021	719.984	601.185	15.596	0	15.596	0,29
	02.2021	1.016.686	830.362	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 46.303	\$ (2.184)	\$ 44.119	0,82

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 10.844	£ 8.077	\$ 197	\$ 0	\$ 197	0,00
BRC	01.2021	£ 10.959	\$ 14.661	0	(320)	(320)	(0,01)
CBK	01.2021	6.353	8.653	0	(32)	(32)	0,00
	01.2021	\$ 281.610	£ 210.670	6.374	0	6.374	0,12
HUS	01.2021	£ 961	\$ 1.282	0	(31)	(31)	0,00
	01.2021	\$ 340.503	£ 254.534	7.443	0	7.443	0,14
MYI	01.2021	£ 73	\$ 98	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 34.351	£ 25.733	825	0	825	0,02
SCX	01.2021	£ 4.215	\$ 5.595	0	(167)	(167)	0,00
	01.2021	\$ 2.367	£ 1.773	57	0	57	0,00
SSB	01.2021	344.839	258.340	8.311	0	8.311	0,15
				\$ 23.207	\$ (552)	\$ 22.655	0,42

Zum 31. Dezember 2020 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
BPS	01.2021	SGD 3.289	\$ 2.479	\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	0,00
	02.2021	\$ 2.479	SGD 3.289	9	0	9	0,00
BRC	01.2021	SGD 4	\$ 3	0	0	0	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global 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
	01.2021	\$ 23	SGD 30	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	02.2021	124	165	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	2.374	3.197	45	0	45	0,00
GLM	02.2021	53	70	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	SGD 12	\$ 9	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 30	SGD 40	0	0	0	0,00
	02.2021	344	458	2	0	2	0,00
MYI	01.2021	SGD 1.464	\$ 1.100	0	(8)	(8)	0,00
	02.2021	\$ 1.100	SGD 1.464	8	0	8	0,00
NGF	01.2021	SGD 3.355	\$ 2.518	0	(21)	(21)	0,00
	01.2021	\$ 2.361	SGD 3.165	34	0	34	0,00
	02.2021	2.518	3.355	21	0	21	0,00
SCX	01.2021	1.002	1.345	15	0	15	0,00
SSB	01.2021	SGD 16	\$ 12	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 239	SGD 320	3	0	3	0,00
	02.2021	90	119	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	SGD 10	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 39	SGD 52	1	0	1	0,00
	02.2021	SGD 13	\$ 10	0	0	0	0,00
	02.2021	\$ 28	SGD 37	0	0	0	0,00
				\$ 139	\$ (38)	\$ 101	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 63.342	1,18
Summe Anlagen						\$ 5.408.110	100,09
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (4.567)	(0,09)
Nettovermögen						\$ 5.403.543	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
Associated Materials Group, Inc.	24.08.2020	\$ 10.293	\$ 10.926	0,20
Bibby Offshore Services PLC	15.01.2018 - 17.01.2018	1.701	1.186	0,02
Noble Corp. PLC	23.12.2020	0	653	0,01
Occidental Petroleum Corp. 6,125 % 01.01.2031	08.12.2020	1.250	1.341	0,02
		\$ 13.244	\$ 14.106	0,25

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 11.776 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 310 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 15.985 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 11.020 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	0	70.096	0	70.096
Summen	\$ 471.018	\$ 4.923.437	\$ 13.655	\$ 5.408.110

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 3.739.069	\$ 2.962	\$ 3.742.031
Investmentfonds	423.105	0	0	423.105
Pensionsgeschäfte	0	233.300	0	233.300
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	46.206	0	46.206
<b>Summen</b>	<b>\$ 423.105</b>	<b>\$ 4.018.575</b>	<b>\$ 2.962</b>	<b>\$ 4.444.642</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	(0,200) %	14.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (3.476)	\$ (3.475)	(0,06)
	(0,200)	15.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(2.563)	(2.563)	(0,05)
	0,000	02.09.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(661)	(661)	(0,01)
JPS	(0,500)	20.10.2020	21.01.2021	(779)	(779)	(0,02)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (7.478)</b>	<b>(0,14)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 425	\$ (310)	\$ 115
BPS	13.158	(15.780)	(2.622)
BRC	907	(1.114)	(207)
CBK	5.590	(4.051)	1.539
GLM	1	0	1
GST	21.014	(20.890)	124
HUS	4.287	(2.490)	1.797
MYI	1.440	(1.218)	222
NGF	34	0	34
SCX	16.670	(20.430)	(3.760)
SSB	8.732	(7.330)	1.402
TOR	(8.895)	11.020	2.125
UAG	(21)	0	(21)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	53,83	38,42
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	35,12	47,78
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,12	0,00
Investmentfonds	8,72	9,75
Pensionsgeschäfte	k. A.	5,37
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,12	0,16
Freiverkehrsfinanzderivate	1,18	0,90
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,14)	(0,32)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,32)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Belgien	0,08	k. A.
Bermuda	0,35	0,31
Kanada	3,18	3,39
Cayman-Inseln	0,57	1,37
Dänemark	0,26	0,31
Finnland	0,15	k. A.
Frankreich	2,16	2,25
Deutschland	3,37	1,90
Irland	0,18	0,23
Italien	2,85	1,47

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Jersey, Kanalinseln	0,27	0,35
Liberia	0,06	k. A.
Luxemburg	2,84	2,59
Mauritius	0,13	0,15
Multinational	1,54	1,38
Niederlande	5,14	3,16
Norwegen	0,23	k. A.
Panama	0,15	k. A.
Singapur	k. A.	0,04
Spanien	0,67	0,40
Schweden	0,52	0,35
Schweiz	0,10	0,12
Großbritannien	4,35	3,85
USA	60,20	62,58
Kurzfristige Instrumente	0,72	k. A.
Investmentfonds	8,72	9,75
Pensionsgeschäfte	k. A.	5,37
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,12	0,16
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	0,41	0,07
Devisenterminkontrakte	(0,50)	(0,21)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,27	1,04
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,09)	(2,38)
Nettovermögen	100,00	100,00







# 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
Globalworth Real Estate Investments Ltd.	€ 16.200	\$ 20.447	0,07	State Bank of India	\$ 2.700	\$ 2.779	0,01	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC	\$ 12.900	\$ 13.451	0,05
2,875 % fällig am 20.06.2022	23.200	29.896	0,11	4,000 % fällig am 24.01.2022				3,050 % fällig am 23.01.2025	200	210	0,00
2,950 % fällig am 29.07.2026		9.830	0,04			126.400	0,45	3,949 % fällig am 24.04.2023			
3,000 % fällig am 29.03.2025	7.600							<b>SMBC Aviation Capital Finance DAC</b>			
Summe Guernsey, Kanalinseln		102.983	0,37					2,650 % fällig am 15.07.2021	9.600	9.702	0,03
								3,000 % fällig am 15.07.2022	1.500	1.540	0,01
								3,550 % fällig am 15.04.2024	10.200	10.846	0,04
								4,125 % fällig am 15.07.2023	7.100	7.587	0,03
								Summe Irland		250.235	0,89
								<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
								AWAS Aviation Capital Ltd.			
								4,870 % fällig am 03.10.2021 (j)	24.632	24.910	0,09
								Summe Irland		275.415	0,98
								<b>INSEL MAN</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								NE Property BV			
								1,875 % fällig am 09.10.2026	€ 3.700	4.556	0,02
								2,625 % fällig am 22.05.2023 (k)	10.800	13.763	0,05
								3,375 % fällig am 14.07.2027	13.400	17.796	0,06
								Summe Isle of Man		36.115	0,13
								<b>ISRAEL</b>			
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
								Israel Government International Bond			
								3,375 % fällig am 15.01.2050	\$ 15.000	16.641	0,06
								3,800 % fällig am 13.05.2060	2.200	2.619	0,01
								Summe Israel		19.260	0,07
								<b>ITALIEN</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
								Aeroporti di Roma SpA			
								1,625 % fällig am 02.02.2029	€ 8.200	10.126	0,04
								5,441 % fällig am 20.02.2023	£ 2.700	3.972	0,01
								AMCO - Asset Management Co. SpA			
								1,500 % fällig am 17.07.2023	€ 42.500	53.950	0,19
								Atlantia SpA			
								1,625 % fällig am 03.02.2025	13.600	16.634	0,06
								1,875 % fällig am 13.07.2027	9.520	11.546	0,04
								Banca Monte dei Paschi di Siena SpA			
								1,875 % fällig am 09.01.2026	30.900	37.626	0,13
								2,625 % fällig am 28.04.2025	17.000	21.421	0,08
								3,625 % fällig am 24.09.2024	1.950	2.522	0,01
								Eni SpA			
								4,000 % fällig am 12.09.2023	\$ 17.500	19.066	0,07
								4,750 % fällig am 12.09.2028	10.400	12.618	0,04
								Esercizi Aeroportuali SEA SpA			
								3,500 % fällig am 09.10.2025	€ 3.000	3.891	0,01
								Immobiliare Grande Distribuzione SIQ SpA			
								2,125 % fällig am 28.11.2024	11.600	13.468	0,05
								Intesa Sanpaolo SpA			
								3,375 % fällig am 12.01.2023	\$ 4.100	4.296	0,02
								4,000 % fällig am 23.09.2029	15.800	17.839	0,06
								5,017 % fällig am 26.06.2024	6.300	6.896	0,02
								5,710 % fällig am 15.01.2026	17.429	19.962	0,07
								5,875 % fällig am 01.09.2031 (g)(i)	€ 9.250	12.726	0,05
								6,500 % fällig am 24.02.2021	\$ 7.000	7.056	0,03
								7,000 % fällig am 19.01.2021 (g)(i)	€ 23.800	29.244	0,10
								7,750 % fällig am 11.01.2027 (g)(i)	13.942	20.492	0,07
								UniCredit SpA			
								2,200 % fällig am 22.07.2027	5.450	7.089	0,03
								3,875 % fällig am 03.06.2027 (g)(i)	4.900	5.411	0,02
								4,129 % fällig am 14.01.2022	\$ 10.650	10.952	0,04
								6,750 % fällig am 10.09.2021 (g)(i)	€ 15.100	18.857	0,07
								7,500 % fällig am 03.06.2026 (g)(i)	45.967	65.446	0,23
								7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 71.650	85.069	0,30
								9,250 % fällig am 03.06.2022 (g)(i)	€ 3.900	5.246	0,02
								Unipol Gruppo SpA			
								3,250 % fällig am 23.09.2030	20.000	25.979	0,09
								Summe Italien		549.400	1,95
								<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
								BP Mortgages SRL			
								0,000 % fällig am 20.04.2043	4	5	0,00



# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	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	
<b>MEXIKO</b>												
<b>STAMMIAKTIE</b>												
Desarrolladora Homex S.A.B. de C.V. (d)	427.064	\$	1	0,00				Sigma Bidco BV	3.000	\$	3.617	0,01
								3,500 % fällig am 02.07.2025			3.815	0,01
								<b>NON-AGENCY-MBS</b>				
								EMF-NL Prime BV	902		1.058	0,01
								0,293 % fällig am 17.04.2041				
								Eurosail PLC	574		708	0,00
								0,993 % fällig am 17.10.2040			1.766	0,01
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
								BNG Bank NV	9.900		10.810	0,03
								2,375 % fällig am 16.03.2026 (k)				
								Niederlande Waterschapsbank NV	1.700		2.100	0,01
								0,000 % fällig am 02.10.2034 (e)			12.910	0,04
								Summe Niederlande			823.482	2,92
								<b>NORWEGEN</b>				
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
								Aker BP ASA	9.100		9.568	0,04
								3,000 % fällig am 15.01.2025		800	844	0,00
								3,750 % fällig am 15.01.2030				
								Norwegian Air Shuttle ASA Pass-Through Trust	8.173		7.570	0,03
								4,875 % fällig am 10.11.2029				
								Yara International ASA	26.500		31.463	0,11
								4,750 % fällig am 01.06.2028			49.445	0,18
								Summe Norwegen				
								<b>PANAMA</b>				
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
								Banco General S.A.	6.300		7.144	0,03
								4,125 % fällig am 07.08.2027				
								Intercorp Financial Services, Inc.	9.200		9.798	0,03
								4,125 % fällig am 19.10.2027			16.942	0,06
								<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				
								Carnival Corp.	19.303		24.288	0,09
								7,500 % fällig am 30.06.2025		12.239	12.679	0,04
								8,500 % fällig am 30.06.2025			36.967	0,13
								Summe Panama			53.909	0,19
								<b>PERU</b>				
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
								Banco de Credito del Peru	10.700		11.184	0,04
								2,700 % fällig am 11.01.2025		14.800	4.411	0,02
								4,650 % fällig am 17.09.2024			15.595	0,06
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
								Peru Government International Bond	24.550		7.064	0,03
								5,350 % fällig am 12.08.2040		10.800	3.299	0,01
								5,400 % fällig am 12.08.2034		96.259	33.211	0,12
								5,940 % fällig am 12.02.2029		110.930	37.615	0,13
								6,150 % fällig am 12.08.2032		187.800	65.989	0,23
								6,350 % fällig am 12.08.2028		35.600	12.797	0,05
								6,950 % fällig am 12.08.2031		340.600	127.891	0,45
								8,200 % fällig am 12.08.2026			287.866	1,02
								Summe Peru			303.461	1,08
								<b>PORTUGAL</b>				
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
								Galp Energia SGPS S.A.	3.900		4.931	0,02
								2,000 % fällig am 15.01.2026				
								<b>KATAR</b>				
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
								Qatar Government International Bond	22.800		24.727	0,09
								3,375 % fällig am 14.03.2024				

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
4,400 % fällig am 16.04.2050	\$ 17.800	\$ 23.245	0,08	<b>SLOWENIEN</b>				Spain Government International Bond	€ 2.800	\$ 3.629	0,01
Summe Katar		47.972	0,17	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				0,600 % fällig am 31.10.2029		4.331	0,01
<b>RUMÄNIEN</b>				Slovenia Government International Bond	€ 400	\$ 823	0,00	Summe Spanien		299.735	1,06
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,125 % fällig am 07.08.2045	€	6.292	0,03	<b>SRI LANKA</b>			
RCS & RDS S.A.	€ 2.100	2.576	0,01	5,250 % fällig am 18.02.2024	\$ 5.474			<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Summe Slowenien		7.115	0,03	Sri Lanka Government International Bond	\$ 200	115	0,00
Romania Government International Bond	6.625	8.264	0,03	<b>SÜDAFRIKA</b>				6,200 % fällig am 11.05.2027			
1,375 % fällig am 02.12.2029		31.359	0,11	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ÜBERNATIONAL</b>			
2,625 % fällig am 02.12.2040	24.000	39.623	0,14	AngloGold Ashanti Holdings PLC	8.300	8.939	0,03	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Summe Rumänien		42.199	0,15	3,750 % fällig am 01.10.2030				Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	5.500	5.702	0,02
<b>RUSSLAND</b>				Growthpoint Properties International Pty. Ltd.	3.650	3.876	0,02	1,625 % fällig am 27.09.2024	500	525	0,00
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,872 % fällig am 02.05.2023				Europäische Investitionsbank	£ 16.350	22.914	0,08
ALROSA Finance S.A.	\$ 5.200	5.632	0,02	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				0,750 % fällig am 15.11.2024		29.141	0,10
4,650 % fällig am 09.04.2024		5.618	0,02	South Africa Government International Bond	ZAR 610.600	49.321	0,17	Summe übernational			
MMK International Capital DAC	5.200	11.250	0,04	10,500 % fällig am 21.12.2026		62.136	0,22	<b>SCHWEDEN</b>			
4,375 % fällig am 13.06.2024				Summe Südafrika		25.665	0,09	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>SÜDKOREA</b>				Castellum AB	€ 4.600	5.953	0,02
Russia Government International Bond	RUB 8.424.500	128.584	0,46	Shinhan Bank Co. Ltd.	€ 11.600	14.418	0,05	2,125 % fällig am 20.11.2023			
7,650 % fällig am 10.04.2030		111.363	0,39	0,250 % fällig am 16.10.2024	€	4.800	0,02	Fastighets AB Balder	4.800	5.960	0,02
8,500 % fällig am 17.09.2031	6.863.900	239.947	0,85	1,183 % fällig am 29.09.2025	AUD 4.800	3.745	0,02	1,125 % fällig am 29.01.2027			
Summe Russland		251.197	0,89	4,000 % fällig am 23.04.2029 (i)	\$ 600	683	0,00	Intrum AB	7.000	8.522	0,03
<b>SAUDI-ARABIEN</b>				Shinhan Financial Group Co. Ltd.	3.200	3.399	0,01	3,500 % fällig am 15.07.2026			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,340 % fällig am 05.02.2030 (i)				Molnlycke Holding AB	400	525	0,00
Saudi Arabian Oil Co.	\$ 25.100	25.594	0,09	SK Telecom Co. Ltd.	3.200	3.420	0,01	1,875 % fällig am 28.02.2025			
2,250 % fällig am 24.11.2030				3,750 % fällig am 16.04.2023				Sagax AB	4.500	5.592	0,02
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				2,250 % fällig am 13.03.2025	10.000	13.056	0,05
Saudi Government International Bond	34.800	35.359	0,13	Korea Development Bank	300	311	0,00	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	22.300	27.698	0,10
2,375 % fällig am 26.10.2021	6.200	6.500	0,02	4,625 % fällig am 16.11.2021				1,000 % fällig am 12.08.2027			
2,875 % fällig am 04.03.2023		41.859	0,15	Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.	600	649	0,00	1,125 % fällig am 04.09.2026	4.000	5.051	0,02
Summe Saudi-Arabien		67.453	0,24	3,750 % fällig am 25.07.2023				1,750 % fällig am 14.01.2025	6.867	8.840	0,03
<b>SINGAPUR</b>				Summe Südkorea		26.625	0,09	Svenska Handelsbanken AB	\$ 6.000	6.044	0,02
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>SPANIEN</b>				0,625 % fällig am 30.06.2023			
BOC Aviation Ltd.	2.400	2.415	0,01	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,375 % fällig am 01.03.2027 (g)(i)	4.200	4.402	0,01
2,375 % fällig am 15.09.2021	19.700	20.125	0,07	Abertis Infraestructuras S.A.	€ 15.100	20.314	0,07	4,750 % fällig am 01.03.2021 (g)(i)	10.400	11.115	0,04
2,750 % fällig am 18.09.2022	1.600	1.665	0,01	2,250 % fällig am 29.03.2029	€	1.713	0,01	Summe Schweden		102.758	0,36
3,500 % fällig am 31.01.2023	10.900	11.581	0,04	3,000 % fällig am 27.03.2031	1.200	1.713	0,01	<b>SCHWEIZ</b>			
3,500 % fällig am 10.10.2024	20.800	22.247	0,08	ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A.	15.500	19.497	0,07	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
3,500 % fällig am 18.09.2027	3.400	3.622	0,01	1,375 % fällig am 17.06.2025				Credit Suisse AG	1.397	1.551	0,01
4,000 % fällig am 25.01.2024				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	\$ 30.000	30.231	0,11	3,625 % fällig am 09.09.2024	94.560	106.725	0,38
Flex Ltd.	6.100	6.829	0,03	0,875 % fällig am 18.09.2023	€	5.000	0,02	6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)			
3,750 % fällig am 01.02.2026	14.600	17.269	0,06	5,875 % fällig am 24.09.2023 (g)(i)				Credit Suisse Group AG	€ 7.200	9.183	0,03
4,875 % fällig am 15.06.2029	14.400	14.644	0,05	6,000 % fällig am 29.03.2024 (g)(i)				1,000 % fällig am 24.06.2027	\$ 25.400	26.742	0,10
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.	600	658	0,00	6,000 % fällig am 15.01.2026 (g)(i)				2,593 % fällig am 11.09.2025	\$ 13.000	14.450	0,05
1,832 % fällig am 10.09.2030 (i)				6,875 % fällig am 14.04.2021 (g)(i)				3,750 % fällig am 26.03.2025	20.000	23.567	0,08
4,250 % fällig am 19.06.2024 (i)				Banco de Sabadell S.A.	16.200	20.285	0,07	4,194 % fällig am 01.04.2031	45.350	49.168	0,17
SingTel Group Treasury Pte. Ltd.	1.100	1.288	0,01	1,125 % fällig am 11.03.2027	6.400	8.109	0,03	4,207 % fällig am 12.06.2024	1.300	1.355	0,00
3,875 % fällig am 28.08.2028				Banco Santander S.A.	\$ 9.800	10.470	0,03	5,100 % fällig am 24.01.2030 (g)(i)	17.160	18.821	0,07
SP PowerAssets Ltd.	2.600	2.870	0,01	2,706 % fällig am 27.06.2024				6,375 % fällig am 21.08.2026 (g)(i)	17.400	19.393	0,07
3,000 % fällig am 26.09.2027				3,800 % fällig am 23.02.2028	200	227	0,00	7,125 % fällig am 29.07.2022 (g)(i)	1.900	2.008	0,01
United Overseas Bank Ltd.	3.700	3.736	0,01	4,375 % fällig am 14.01.2026 (g)(i)	€ 9.000	11.067	0,04	7,250 % fällig am 12.09.2025 (g)(i)	1.600	1.802	0,01
1,750 % fällig am 16.03.2031 (i)				6,250 % fällig am 11.09.2021 (g)(i)	22.000	27.610	0,10	7,500 % fällig am 17.07.2023 (g)(i)	26.300	28.733	0,10
Summe Singapur		108.949	0,39	Bankinter S.A.	10.600	13.398	0,05	7,500 % fällig am 11.12.2023 (g)(i)	200	223	0,00
<b>SLOWAKEI</b>				CaixaBank S.A.	20.200	25.921	0,09	<b>UBS AG</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				1,750 % fällig am 24.10.2023	8.800	11.071	0,04	4,750 % fällig am 12.02.2026 (i)	€ 6.894	8.489	0,03
Slovakia Government International Bond	€ 500	809	0,00	5,250 % fällig am 23.03.2026 (g)(i)	33.000	44.637	0,16	5,125 % fällig am 15.05.2024 (i)	\$ 14.400	15.908	0,06
1,875 % fällig am 09.03.2037				5,875 % fällig am 09.10.2027 (g)(i)				7,625 % fällig am 17.08.2022 (i)	82.671	91.530	0,32
Summe Slowakei				Merlin Properties Socimi S.A.	2.100	2.683	0,01	Summe UBS Group AG			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				2,225 % fällig am 25.04.2023				1,171 % fällig am 15.08.2023	47.300	47.770	0,17
Autonomous Community of Madrid	500	702	0,00	Summe Slowakei		295.404	1,05	4,125 % fällig am 24.09.2025	100.550	115.261	0,41
2,146 % fällig am 30.04.2027				<b>TÜRKEI</b>				5,125 % fällig am 29.07.2026 (g)(i)	16.100	17.267	0,06
Summe Türkei				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,125 % fällig am 10.08.2021 (g)(i)	3.500	3.609	0,01
				Turkish Airlines Pass-Through Trust	5.642	4.694	0,02	Summe Schweiz		603.555	2,14
				4,200 % fällig am 15.09.2028				<b>TÜRKEI</b>			
								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade 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
<b>UKRAINE STAATSEMISSIONEN</b>				<b>G45 International Finance PLC</b>				<b>Miller Homes Group Holdings PLC</b>			
Ukraine Government International Bond				1,875 % fällig am 24.05.2025				5,500 % fällig am 15.10.2024			
7,750 % fällig am 01.09.2021	\$ 1.600	\$ 1.661	0,01	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				Mitchells & Butlers Finance PLC			
7,750 % fällig am 01.09.2022	8.700	9.324	0,03	3,000 % fällig am 29.06.2027				0,493 % fällig am 15.12.2030			
				3,250 % fällig am 25.02.2030				6,013 % fällig am 15.12.2030			
Summe Ukraine		10.985	0,04	Grainger PLC				Mondi Finance PLC			
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				1,750 % fällig am 24.04.2028				1,500 % fällig am 15.04.2024			
DAE Sukuk Dfc Ltd.				Greene King Finance PLC				National Express Group PLC			
3,750 % fällig am 15.02.2026	9.500	9.785	0,04	2,123 % fällig am 15.03.2036				2,375 % fällig am 20.11.2028			
Dolphin Energy Ltd. LLC				4,064 % fällig am 15.03.2035				2,500 % fällig am 11.11.2023			
5,500 % fällig am 15.12.2021	1.100	1.151	0,00	5,106 % fällig am 15.03.2034				3,900 % fällig am 21.07.2025			
First Abu Dhabi Bank PJSC				5,318 % fällig am 15.09.2031				4,302 % fällig am 08.03.2029			
1,180 % fällig am 16.04.2022	26.200	26.357	0,09	Hammeron PLC				4,363 % fällig am 01.08.2024			
		37.293	0,13	1,750 % fällig am 15.03.2023 (k)				5,750 % fällig am 20.06.2027 (g)(i)			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				HSBC Holdings PLC				5,875 % fällig am 20.12.2024 (g)(i)			
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond				1,451 % fällig am 11.03.2025				Natwest Group PLC			
3,125 % fällig am 30.09.2049	20.000	21.478	0,08	1,645 % fällig am 18.04.2026				0,750 % fällig am 15.11.2025			
Summe Vereinigte Arabische Emirate		58.771	0,21	2,013 % fällig am 22.09.2028				1,691 % fällig am 15.05.2023			
<b>GROSSBRITANNIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,099 % fällig am 04.06.2026				1,750 % fällig am 02.03.2026			
Amcor UK Finance PLC				2,357 % fällig am 18.08.2031				3,900 % fällig am 21.07.2025			
1,125 % fällig am 23.06.2027	€ 1.600	2.070	0,01	2,633 % fällig am 07.11.2025				1,700 % fällig am 08.03.2026			
Assura Financing PLC				2,848 % fällig am 04.06.2031				1,801 % fällig am 25.06.2024			
3,000 % fällig am 19.07.2028	€ 4.800	7.593	0,03	3,000 % fällig am 22.05.2030				2,000 % fällig am 04.03.2025			
Babcock International Group PLC				4,041 % fällig am 13.03.2028				2,500 % fällig am 22.03.2023			
1,375 % fällig am 13.09.2027	€ 3.300	4.182	0,01	4,292 % fällig am 12.09.2026				4,269 % fällig am 22.03.2025			
Barclays Bank PLC				4,600 % fällig am 17.12.2030 (g)(i)				4,800 % fällig am 05.04.2026			
10,000 % fällig am 21.05.2021	€ 6.010	8.490	0,03	5,875 % fällig am 28.09.2026 (g)(i)				4,892 % fällig am 18.05.2029			
Barclays PLC				6,000 % fällig am 29.09.2023 (g)(i)				5,076 % fällig am 27.01.2030			
1,007 % fällig am 10.12.2024	\$ 3.600	3.628	0,01	6,000 % fällig am 22.05.2027 (g)(i)				6,000 % fällig am 19.12.2023			
2,645 % fällig am 24.06.2031	13.100	13.664	0,05	6,500 % fällig am 23.03.2028 (g)(i)				6,000 % fällig am 29.12.2025 (g)(i)			
3,125 % fällig am 17.01.2024	€ 14.400	20.961	0,07	Imperial Brands Finance PLC				8,625 % fällig am 15.08.2021 (g)(i)			
3,250 % fällig am 12.02.2027	19.103	29.125	0,10	1,125 % fällig am 14.08.2023				Peabody Capital No. 2 PLC			
3,375 % fällig am 02.04.2025	€ 15.700	21.211	0,07	3,125 % fällig am 26.07.2024				3,250 % fällig am 14.09.2048			
4,375 % fällig am 12.01.2026	\$ 19.400	22.386	0,08	3,500 % fällig am 26.07.2026				Places For People Treasury PLC			
4,836 % fällig am 09.05.2028	4.800	5.535	0,02	3,750 % fällig am 21.07.2022				2,875 % fällig am 17.08.2026			
5,200 % fällig am 12.05.2026	4.000	4.668	0,02	3,875 % fällig am 26.07.2029				Reckitt Benckiser Treasury Services PLC			
6,125 % fällig am 15.12.2025 (g)(i)	2.900	3.132	0,01	Informa PLC				0,798 % fällig am 24.06.2022			
7,125 % fällig am 15.06.2025 (g)(i)	€ 14.500	22.157	0,08	1,250 % fällig am 22.04.2028				1,750 % fällig am 19.05.2032			
7,250 % fällig am 15.03.2023 (g)(i)	23.850	34.660	0,12	1,500 % fällig am 05.07.2023				Rolls-Royce PLC			
8,000 % fällig am 15.06.2024 (g)(i)	\$ 4.600	5.131	0,02	2,125 % fällig am 06.10.2025				1,625 % fällig am 09.05.2028			
BAT International Finance PLC				InterContinental Hotels Group PLC				3,625 % fällig am 14.10.2025			
1,668 % fällig am 25.03.2026	15.400	15.775	0,06	1,625 % fällig am 08.10.2024				4,625 % fällig am 16.02.2026			
3,950 % fällig am 15.06.2025	1.445	1.627	0,01	2,125 % fällig am 15.05.2027				5,750 % fällig am 15.10.2027			
BG Energy Capital PLC				3,375 % fällig am 08.10.2028				Royalty Pharma PLC			
5,125 % fällig am 15.10.2041	1.630	2.150	0,01	3,875 % fällig am 28.11.2022				0,750 % fällig am 02.09.2023			
Broadgate Financing PLC				ITV PLC				Santander UK Group Holdings PLC			
4,851 % fällig am 05.04.2033	€ 60	106	0,00	1,375 % fällig am 26.09.2026				0,309 % fällig am 27.03.2024			
Bunzl Finance PLC				Jaguar Land Rover Automotive PLC				0,391 % fällig am 28.02.2025			
2,250 % fällig am 11.06.2025	100	146	0,00	7,750 % fällig am 15.10.2025				2,875 % fällig am 05.08.2021			
Cadent Finance PLC				John Lewis PLC				2,920 % fällig am 08.05.2026			
2,125 % fällig am 22.09.2028	4.900	7.258	0,03	6,125 % fällig am 21.01.2025				3,625 % fällig am 14.01.2026			
2,625 % fällig am 22.09.2038	300	469	0,00	Liberty Living Finance PLC				4,750 % fällig am 15.09.2025			
2,750 % fällig am 22.09.2046	3.400	5.421	0,02	2,625 % fällig am 28.11.2024				4,796 % fällig am 15.11.2024			
Chanel Ceres PLC				Lloyds Bank PLC				6,750 % fällig am 24.06.2024 (g)(i)			
0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 13.000	16.149	0,06	7,500 % fällig am 02.04.2032				7,375 % fällig am 24.06.2022 (g)(i)			
1,000 % fällig am 31.07.2031	8.100	10.233	0,04	Lloyds Banking Group PLC				Santander UK PLC			
Connect Plus M25 Issuer PLC				1,875 % fällig am 15.01.2026				0,600 % fällig am 12.02.2027			
2,607 % fällig am 31.03.2039	€ 7.030	11.177	0,04	2,250 % fällig am 16.10.2024				2,875 % fällig am 18.06.2024			
Direct Line Insurance Group PLC				2,707 % fällig am 03.12.2035				4,000 % fällig am 13.03.2024			
4,000 % fällig am 05.06.2032	1.400	2.245	0,01	3,500 % fällig am 01.04.2026				Scottish Power UK PLC			
Drax Finco PLC				4,375 % fällig am 22.03.2028				6,750 % fällig am 29.05.2023			
6,625 % fällig am 01.11.2025	\$ 3.200	3.358	0,01	4,550 % fällig am 16.08.2028				Smith & Nephew PLC			
DWR Cymru Financing UK PLC				4,947 % fällig am 27.06.2025 (g)(i)				2,032 % fällig am 14.10.2030			
3,514 % fällig am 31.03.2030	€ 26	53	0,00	5,125 % fällig am 27.12.2024 (g)(i)				Society of Lloyd's			
FCE Bank PLC				7,500 % fällig am 27.09.2025 (g)(i)				4,750 % fällig am 30.10.2024			
0,869 % fällig am 13.09.2021	€ 9.900	12.107	0,04	7,625 % fällig am 27.06.2023 (g)(i)				SSE PLC			
1,615 % fällig am 11.05.2023	1.900	2.336	0,01	7,875 % fällig am 27.06.2029 (g)(i)				1,750 % fällig am 16.04.2030			
1,875 % fällig am 24.06.2021	1.600	1.964	0,01	M&G PLC				Standard Chartered PLC			
Ferguson Finance PLC				6,340 % fällig am 19.12.2063				0,900 % fällig am 02.07.2027			
3,250 % fällig am 02.06.2030	\$ 5.800	6.481	0,02	Marks & Spencer PLC				1,319 % fällig am 14.10.2023			
				3,750 % fällig am 19.05.2026				1,335 % fällig am 14.10.2023			
				4,250 % fällig am 08.12.2023				1,430 % fällig am 10.09.2022			
				4,500 % fällig am 10.07.2027				2,819 % fällig am 30.01.2026			
				6,000 % fällig am 12.06.2025				3,265 % fällig am 18.02.2036			
				7,375 % fällig am 06.12.2021				4,644 % fällig am 01.04.2031			
								Telereal Secured Finance PLC			
								4,010 % fällig am 10.12.2033			



# 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- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
Anthem, Inc. 3,350 % fällig am 01.12.2024	\$ 15.600	\$ 17.198	0,06	BGC Partners, Inc. 5,125 % fällig am 27.05.2021 5,375 % fällig am 24.07.2023	\$ 37.450 700	\$ 37.879 758	0,13 0,00	CF Industries, Inc. 5,150 % fällig am 15.03.2034	\$ 5.200	\$ 6.402	0,02
Apple, Inc. 2,550 % fällig am 20.08.2060	20.700	21.343	0,08	Black Hills Corp. 2,500 % fällig am 15.06.2030	13.800	14.524	0,05	Charter Communications Operating LLC 1,864 % fällig am 01.02.2024 2,300 % fällig am 01.02.2032	9.100 29.800	9.336 29.863	0,03 0,11
Ares Finance Co. LLC 3,250 % fällig am 15.06.2030	18.000	19.093	0,07	Blackstone Holdings Finance Co. LLC 1,500 % fällig am 10.04.2029 1,600 % fällig am 30.03.2031	€ 12.300 \$ 6.700	16.614 6.678	0,06 0,02	2,800 % fällig am 01.04.2031 3,700 % fällig am 01.04.2051 3,750 % fällig am 15.02.2028	4.900 7.000 24.700	5.189 7.296 27.737	0,02 0,03 0,10
Arizona Public Service Co. 2,650 % fällig am 15.09.2050	10.060	10.475	0,04	BlueScope Finance Americas LLC 4,625 % fällig am 25.05.2023	29.000	30.947	0,11	3,850 % fällig am 01.04.2061 4,464 % fällig am 23.07.2022	9.400 4.400	9.496 4.640	0,03 0,02
Arrow Electronics, Inc. 3,250 % fällig am 08.09.2024 3,875 % fällig am 12.01.2028	2.900 1.500	3.140 1.692	0,01 0,01	BMW U.S. Capital LLC 2,000 % fällig am 11.04.2021 3,400 % fällig am 13.08.2021	23.000 7.250	23.070 7.387	0,08 0,03	4,500 % fällig am 01.02.2024 4,800 % fällig am 01.03.2050 4,908 % fällig am 23.07.2025	700 21.800 2.613	777 26.081 3.037	0,00 0,09 0,01
Ashtead Capital, Inc. 4,000 % fällig am 01.05.2028 4,250 % fällig am 01.11.2029	8.741 3.300	9.306 3.621	0,03 0,01	Boardwalk Pipelines LP 3,400 % fällig am 15.02.2031	18.900	19.762	0,07	5,125 % fällig am 01.07.2049 5,375 % fällig am 01.04.2038	9.900 19.700	12.103 24.633	0,04 0,09
Assurant, Inc. 1,501 % fällig am 26.03.2021 4,200 % fällig am 27.09.2023	2.051 3.100	2.051 3.394	0,01 0,01	Boeing Co. 3,250 % fällig am 01.02.2028 5,150 % fällig am 01.05.2030	20.000 73.000	21.484 88.480	0,08 0,31	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 3,700 % fällig am 15.11.2029 5,125 % fällig am 30.06.2027	17.100 24.962	19.071 29.568	0,07 0,11
AT&T, Inc. 1,600 % fällig am 19.05.2028 2,250 % fällig am 01.02.2032 2,550 % fällig am 01.12.2033	€ 10.300 \$ 300 35.836	13.768 305 36.816	0,05 0,00 0,13	5,705 % fällig am 11.04.2021 5,805 % fällig am 01.05.2050 5,930 % fällig am 01.05.2060	7.300 26.900 10.800	9.491 26.900 15.349	0,03 0,13 0,05	Chobani LLC 4,625 % fällig am 15.11.2028	1.100	1.119	0,00
2,750 % fällig am 01.06.2031 2,850 % fällig am 25.05.2024 (j) 3,100 % fällig am 01.02.2043	13.200 CAD 2.900 \$ 23.900	14.118 2.415 24.334	0,05 0,01 0,09	Boston Scientific Corp. 0,625 % fällig am 01.12.2027 2,650 % fällig am 01.06.2030 3,450 % fällig am 01.03.2024	€ 7.560 \$ 19.400 10.600	9.358 20.805 11.494	0,03 0,07 0,04	Choice Hotels International, Inc. 3,700 % fällig am 01.12.2029	700	766	0,00
3,150 % fällig am 04.09.2036 3,300 % fällig am 01.02.2052 3,500 % fällig am 01.06.2041	€ 10.500 \$ 23.700 18.250	16.300 23.543 19.733	0,06 0,08 0,07	Brandywine Operating Partnership LP 3,950 % fällig am 15.02.2023 3,950 % fällig am 15.11.2027	2.317 4.000	2.415 4.281	0,01 0,02	Chubb INA Holdings, Inc. 0,300 % fällig am 15.12.2024 0,875 % fällig am 15.12.2029	€ 1.600 200	1.987 260	0,01 0,00
3,500 % fällig am 15.09.2053 3,550 % fällig am 15.09.2055 3,650 % fällig am 01.06.2051	6.617 30.508 13.100	6.652 30.465 13.742	0,02 0,11 0,05	British Airways Pass-Through Trust 3,350 % fällig am 15.12.2030 3,800 % fällig am 20.03.2033	14.391	14.423	0,05	Churchill Downs, Inc. 4,750 % fällig am 15.01.2028	\$ 2.000	2.110	0,01
3,650 % fällig am 15.09.2059 3,850 % fällig am 01.06.2060 4,850 % fällig am 25.05.2047 (j)	39.753 20.000 CAD 7.800	40.223 21.051 7.177	0,14 0,07 0,03	4,250 % fällig am 15.05.2034 4,625 % fällig am 20.12.2025	1.400 1.250	1.502 1.245	0,01 0,00	CIT Group, Inc. 5,250 % fällig am 07.03.2025 6,125 % fällig am 09.03.2028	\$ 2.100 1.900	2.387 2.320	0,01 0,01
Athene Global Funding 2,500 % fällig am 14.01.2025 3,000 % fällig am 01.07.2022 4,000 % fällig am 25.01.2022	\$ 1.300 2.525 4.310	1.363 2.612 4.464	0,00 0,01 0,02	5,705 % fällig am 15.06.2034 3,300 % fällig am 15.06.2034 3,350 % fällig am 15.12.2030	5.000 5.100 8.200	4.995 5.404 9.449	0,02 0,02 0,03	Citibank N.A. 0,824 % fällig am 20.05.2022 2,850 % fällig am 12.02.2021	14.000 2.900	14.027 2.901	0,05 0,01
AutoNation, Inc. 3,350 % fällig am 15.01.2021	7.716	7.720	0,03	4,250 % fällig am 20.03.2033 4,250 % fällig am 20.03.2033 4,250 % fällig am 20.12.2025	87 87 1.400	83 83 1.502	0,00 0,01 0,01	Citigroup, Inc. 1,165 % fällig am 24.07.2023 1,248 % fällig am 01.06.2024	2.900	2.901	0,01
Aviation Capital Group LLC 1,175 % fällig am 01.06.2021 2,875 % fällig am 20.01.2022 3,500 % fällig am 01.11.2027	6.700 2.989 8.802	6.659 3.027 8.823	0,02 0,01 0,03	3,250 % fällig am 15.09.2023 4,125 % fällig am 15.05.2029	5.000 8.200	4.995 9.449	0,02 0,03	2,312 % fällig am 04.11.2022 2,572 % fällig am 03.06.2031 (j) 2,876 % fällig am 24.07.2023	18.800 11.200 49.900	18.975 11.330 53.231	0,07 0,04 0,19
3,875 % fällig am 01.05.2023 4,375 % fällig am 30.01.2024 6,750 % fällig am 06.04.2021	3.443 16.099 9.369	3.590 17.005 9.499	0,01 0,06 0,03	Brookfield Property REIT, Inc. 5,750 % fällig am 15.05.2026	200	197	0,00	8,125 % fällig am 15.07.2039	580	1.038	0,00
Baker Hughes a GE Co. LLC 3,138 % fällig am 07.11.2029	400	440	0,00	Broadcom, Inc. 3,459 % fällig am 15.09.2026 4,110 % fällig am 15.09.2028	1.437 30.446	1.596 34.902	0,01 0,12	Citizens Bank N.A. 1,043 % fällig am 26.05.2022 3,750 % fällig am 18.02.2026	8.500 2.800	8.570 3.184	0,03 0,01
Bank of America Corp. 0,580 % fällig am 08.08.2029 1,015 % fällig am 05.03.2024 1,169 % fällig am 23.07.2024	€ 18.300 \$ 1.600 53.000	22.956 1.612 53.718	0,08 0,01 0,19	4,250 % fällig am 15.04.2026 4,300 % fällig am 15.01.2032 4,750 % fällig am 15.04.2029	4.000 23.049 8.800	4.640 26.415 10.457	0,02 0,09 0,04	Cleco Corporate Holdings LLC 3,743 % fällig am 01.05.2026	8.500 2.800	8.570 3.184	0,03 0,01
Bank of America N.A. 6,000 % fällig am 15.10.2036	7.650	11.462	0,04	4,750 % fällig am 15.04.2029 5,000 % fällig am 15.04.2030	35.731 17.135	42.646 20.853	0,15 0,07	CNA Financial Corp. 2,050 % fällig am 15.08.2030	3.400	3.474	0,01
BAT Capital Corp. 0,000 % fällig am 16.08.2021 2,726 % fällig am 25.03.2031 3,557 % fällig am 15.08.2027	€ 7.500 \$ 8.500 1.050	9.192 8.819 1.170	0,03 0,03 0,00	5,000 % fällig am 15.04.2030 Brookfield Property REIT, Inc. 5,750 % fällig am 15.05.2026	200	216	0,00	CNH Industrial Capital LLC 4,875 % fällig am 01.04.2021	1.200	1.212	0,00
3,540 % fällig am 15.08.2047	3.000	3.337	0,01	Camden Property Trust 3,500 % fällig am 15.09.2024	800	870	0,00	Comcast Corp. 1,950 % fällig am 15.01.2031 2,650 % fällig am 01.02.2030	15.800 17.000	16.240 18.612	0,06 0,07
Bayer U.S. Finance LLC 0,881 % fällig am 25.06.2021 1,227 % fällig am 15.12.2023 3,375 % fällig am 15.07.2024	10.000 12.700 6.100	10.021 12.837 6.601	0,04 0,05 0,02	Cameron LNG LLC 3,402 % fällig am 15.01.2038 3,701 % fällig am 15.01.2039	4.600 12.025	5.028 13.595	0,02 0,05	2,800 % fällig am 15.01.2051 3,750 % fällig am 01.04.2040 3,950 % fällig am 15.10.2025	47.200 51.100 4.500	49.305 61.903 5.173	0,18 0,22 0,02
3,500 % fällig am 25.06.2021 3,875 % fällig am 15.12.2023 4,375 % fällig am 15.12.2028	6.300 14.900 28.600	6.377 16.246 33.662	0,02 0,06 0,12	Campbell Soup Co. 3,950 % fällig am 15.03.2025	900	1.015	0,00	CommonSpirit Health 2,760 % fällig am 01.10.2024	3.400	3.647	0,01
Berry Global, Inc. 1,500 % fällig am 15.01.2027 1,570 % fällig am 15.01.2026 4,875 % fällig am 15.07.2026	€ 2.000 \$ 3.900 4.900	2.502 3.940 5.269	0,01 0,01 0,02	Cantor Fitzgerald LP 4,875 % fällig am 01.05.2024 6,500 % fällig am 17.06.2022	3.700 200	4.123 216	0,01 0,00	Community Health Systems, Inc. 5,625 % fällig am 15.03.2027 6,000 % fällig am 15.01.2029	8.200 1.500	8.827 1.622	0,03 0,01
				CenterPoint Energy, Inc. 2,500 % fällig am 01.09.2024	12.500	13.300	0,05	8,000 % fällig am 15.03.2026 8,625 % fällig am 15.01.2024	5.300 27.800	5.716 29.034	0,02 0,10
				Carrier Global Corp. 2,242 % fällig am 15.02.2025	12.000	12.708	0,05	Conagra Brands, Inc. 4,300 % fällig am 01.05.2024 4,600 % fällig am 01.11.2025	8.800 8.400	9.853 9.903	0,04 0,04
				CCO Holdings LLC 4,250 % fällig am 01.02.2031 4,500 % fällig am 15.08.2030	4.214 5.100	4.446 5.419	0,02 0,02	5,300 % fällig am 01.11.2038	4.300	5.763	0,02
				4,500 % fällig am 01.05.2032 4,750 % fällig am 01.03.2030	2.000 2.100	2.138 2.269	0,01 0,01	Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 5,500 % fällig am 01.12.2039	303	417	0,00
								Constellation Brands, Inc. 3,200 % fällig am 15.02.2023	2.500	2.643	0,01
								Continental Airlines Pass-Through Trust 4,150 % fällig am 11.10.2025 6,703 % fällig am 15.12.2022	2.145 25	2.163 25	0,01 0,00









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
1,625 % fällig am 02.06.2025	€ 400	\$ 522	0,00	Beacon Roofing Supply, Inc.				Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
1,741 % fällig am 04.05.2030	57.500	78.182	0,28	2,397 % fällig am 02.01.2025	3.335	3.317	0,01	6,637 % fällig am 01.04.2057	\$ 197	\$ 300	0,00
2,125 % fällig am 24.09.2031	£ 2.900	4.312	0,02	Caesars Resort Collection LLC				New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured, New York Revenue Bonds, Series 2010			
2,164 % fällig am 11.02.2026	\$ 13.000	13.678	0,05	4,647 % fällig am 21.07.2025	\$ 16.060	\$ 16.109	0,06	5,267 % fällig am 01.05.2027	2.200	2.738	0,01
2,393 % fällig am 02.06.2028	15.800	16.836	0,06	CenturyLink, Inc.				State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020			
2,406 % fällig am 30.10.2025	18.000	19.040	0,07	2,397 % fällig am 15.03.2027	2.333	2.309	0,01	1,258 % fällig am 01.07.2025	25.400	25.993	0,09
2,625 % fällig am 22.07.2022	600	621	0,00	Charter Communications Operating LLC				1,705 % fällig am 01.07.2027	26.200	27.212	0,10
3,196 % fällig am 17.06.2027	6.200	6.879	0,02	1,900 % fällig am 01.02.2027	4.755	4.737	0,02				
3,584 % fällig am 22.05.2028	27.900	31.645	0,11	Chobani LLC							
Wells Fargo Bank N.A.				4,500 % fällig am 20.10.2027	499	499	0,00				
0,726 % fällig am 22.10.2021	500	502	0,00	CommScope, Inc.							
0,853 % fällig am 27.05.2022	10.550	10.572	0,04	3,397 % fällig am 06.04.2026	4.641	4.621	0,02				
2,897 % fällig am 27.05.2022	9.000	9.092	0,03	Core & Main LP							
3,550 % fällig am 22.07.2022	38.100	41.168	0,15	3,750 % fällig am 01.08.2024	10.592	10.575	0,04				
3,625 % fällig am 22.10.2021	2.300	2.355	0,01	CPG International, Inc.							
Welltower, Inc.				4,750 % fällig am 05.05.2024	231	232	0,00				
3,625 % fällig am 15.03.2024	3.400	3.707	0,01	Delta Air Lines, Inc.							
4,250 % fällig am 01.04.2026	2.400	2.798	0,01	4,750 % fällig am 20.10.2027	12.200	12.674	0,04				
4,800 % fällig am 20.11.2028	£ 200	336	0,00	Diamond Resorts International, Inc.							
West Virginia United Health System	Obligated Group			4,750 % fällig am 02.09.2023	2.603	2.475	0,01				
3,129 % fällig am 01.06.2050	\$ 1.600	1.674	0,01	Diamond Sports Group LLC							
Western Digital Corp.				3,400 % fällig am 24.08.2026	6.024	5.391	0,02				
4,750 % fällig am 15.02.2026	3.600	3.983	0,01	E.W. Scripps Co.							
Western Midstream Operating LP				TBD % fällig am 15.12.2027	4.000	4.010	0,01				
4,100 % fällig am 01.02.2025	3.800	3.922	0,01	FinCo LLC							
5,375 % fällig am 01.06.2021	200	202	0,00	2,647 % fällig am 27.06.2025	7.330	7.333	0,03				
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.				HCA, Inc.							
3,200 % fällig am 15.06.2025	4.000	4.320	0,02	1,897 % fällig am 13.03.2025	5.651	5.661	0,02				
4,400 % fällig am 15.03.2024	11.660	12.774	0,05	Hilton Worldwide Finance LLC							
4,950 % fällig am 15.09.2028	12.950	15.384	0,05	1,898 % fällig am 22.06.2026	256	254	0,00				
Weyerhaeuser Co.				INEOS Finance PLC							
4,000 % fällig am 15.11.2029	15.500	18.328	0,07	2,500 % fällig am 01.04.2024	€ 11.349	13.725	0,05				
6,875 % fällig am 15.12.2033	649	932	0,00	Jaguar Holding Co.							
6,950 % fällig am 01.10.2027	3.604	4.698	0,02	3,500 % fällig am 18.08.2022	\$ 1.396	1.397	0,00				
7,125 % fällig am 15.07.2023	7.175	8.284	0,03	Jefferies Finance LLC							
7,375 % fällig am 15.03.2032	17.544	26.342	0,09	4,500 % fällig am 30.09.2027	15.661	15.700	0,06				
7,950 % fällig am 15.03.2025	9.300	11.347	0,04	Level 3 Financing, Inc.							
8,500 % fällig am 15.01.2025	32.027	41.338	0,15	1,897 % fällig am 01.03.2027	13.297	13.117	0,05				
Willamette Industries, Inc.				MH Sub LLC							
7,350 % fällig am 01.07.2026	13.150	16.477	0,06	3,647 % fällig am 13.09.2024	20.704	20.480	0,07				
9,000 % fällig am 01.10.2021	10.150	10.719	0,04	MPH Acquisition Holdings LLC							
Williams Cos., Inc.				3,750 % fällig am 07.06.2023	1.987	1.982	0,01				
8,750 % fällig am 15.03.2032	3.205	4.694	0,02	NCI Building Systems, Inc.							
WP Carey, Inc.				3,904 % fällig am 12.04.2025	33.771	33.771	0,12				
2,000 % fällig am 20.01.2023	€ 2.000	2.540	0,01	Nielsen Finance LLC							
4,000 % fällig am 01.02.2025	\$ 13.350	14.766	0,05	2,146 % fällig am 04.10.2023	2.218	2.214	0,01				
4,250 % fällig am 01.10.2026	1.200	1.383	0,00	Parxel International Corp.							
4,600 % fällig am 01.04.2024	4.700	5.222	0,02	2,897 % fällig am 27.09.2024	10.132	9.978	0,03				
WPX Energy, Inc.				Rackspace Hosting, Inc.							
5,250 % fällig am 15.09.2024	510	557	0,00	4,000 % fällig am 03.11.2023	3.491	3.492	0,01				
5,750 % fällig am 01.06.2026	2.700	2.842	0,01	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.							
WRKCo, Inc.				3,897 % fällig am 16.11.2025	6.144	6.133	0,02				
3,000 % fällig am 15.09.2024	7.300	7.868	0,03	RPI Intermediate Finance Trust							
Wyndham Destinations, Inc.				1,897 % fällig am 11.02.2027	11.126	11.133	0,04				
5,625 % fällig am 01.03.2021	1.000	1.009	0,00	Sotera Health Holdings LLC							
6,000 % fällig am 01.04.2027	550	618	0,00	5,500 % fällig am 11.12.2026	6.750	6.784	0,02				
Yellowstone Energy LP				SS&C Technologies, Inc.							
5,750 % fällig am 31.12.2026	5.792	6.392	0,02	1,897 % fällig am 16.04.2025	6.351	6.297	0,02				
Zimmer Biomet Holdings, Inc.				Univision Communications, Inc.							
1,164 % fällig am 15.11.2027	€ 0.800	10.373	0,04	3,750 % fällig am 15.03.2024	7.917	7.878	0,03				
1,414 % fällig am 13.12.2022	11.700	14.715	0,05	USI, Inc.							
2,425 % fällig am 13.12.2026	5.900	8.082	0,03	4,254 % fällig am 02.12.2026	1.980	1.981	0,01				
3,150 % fällig am 01.04.2022	\$ 2.397	2.466	0,01	Western Digital Corp.							
3,375 % fällig am 30.11.2021	2.300	2.346	0,01	1,647 % fällig am 27.02.2023	2.396	2.388	0,01				
Zoetis, Inc.				White Cap Buyer LLC							
4,500 % fällig am 13.11.2025	1.600	1.870	0,01	4,500 % fällig am 19.10.2027	7.300	7.309	0,03				
		8.860.241	31,44			297.323	1,06				
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>							
Advantage Sales & Marketing, Inc.				Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010				GSR Mortgage Loan Trust			
6,000 % fällig am 28.10.2027	12.200	12.185	0,04	6,725 % fällig am 01.04.2035	100	116	0,00	1,920 % fällig am 25.04.2032	134	120	0,00
Archex Buyer, Inc.				7,350 % fällig am 01.07.2035	500	597	0,00	3,245 % fällig am 25.09.2035	1	1	0,00
4,500 % fällig am 06.12.2027	24.500	24.555	0,09	Metropolitan Transportation Authority, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				HarborView Mortgage Loan Trust			
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				6,814 % fällig am 15.11.2040	8.700	11.652	0,04	0,342 % fällig am 19.08.2037	6.882	6.381	0,02
3,250 % fällig am 01.12.2027	14.600	14.627	0,05					0,357 % fällig am 19.12.2036	4.031	3.627	0,01
								0,832 % fällig am 20.06.2035	2.216	2.126	0,01
								2,551 % fällig am 19.04.2034	7	7	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade 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
HomeBanc Mortgage Trust 0,648 % fällig am 25.03.2035 \$	494	\$ 445	0,00	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				U.S. Treasury STRIPS			
Impac CMB Trust 0,848 % fällig am 25.03.2035	339	330	0,00	Fannie Mae	3	3	0,00	0,000 % fällig am 15.05.2043 (e)	25	18	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust 3,256 % fällig am 25.03.2036	1.104	982	0,01	0,191 % fällig am 25.07.2037	8	8	0,00	0,000 % fällig am 15.08.2050 (e)	9.500	5.754	0,02
JPMorgan Alternative Loan Trust 5,692 % fällig am 26.05.2037	342	297	0,00	0,498 % fällig am 25.05.2042	27	27	0,00				
JPMorgan Mortgage Trust 2,890 % fällig am 25.07.2035	37	38	0,00	0,500 % fällig am 25.09.2042	1	1	0,00				
Lehman Mortgage Trust 5,750 % fällig am 25.02.2037 ^	1.958	1.673	0,01	1,048 % fällig am 25.04.2032	800	906	0,01				
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 3,176 % fällig am 21.11.2034	11	11	0,00	2,959 % fällig am 25.09.2027	455	530	0,00				
MASTR Alternative Loan Trust 5,500 % fällig am 25.02.2034	25	26	0,00	5,500 % fällig am 25.05.2036 \$	18.125	27.465	0,10				
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 0,808 % fällig am 25.06.2028	1	1	0,00	6,625 % fällig am 15.11.2030				<b>AKTIEN</b>			
0,908 % fällig am 25.08.2035	163	164	0,00	Freddie Mac				Stearns Holdings LLC 'B' - Exp. 05.11.2039	1.524.023	0	0,00
0,934 % fällig am 25.01.2029	212	215	0,00	25.08.2029 (a)	3.000	219	0,00	Summe USA		14.145.914	50,20
3,359 % fällig am 25.05.2036	500	464	0,00	1,944 % fällig am 25.02.2045	27	27	0,00	<b>URUGUAY</b>			
3,640 % fällig am 25.02.2035	30	31	0,00	2,258 % fällig am 01.10.2038	0	1	0,00	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
3,868 % fällig am 25.05.2033	4	4	0,00	3,801 % fällig am 01.06.2037	1	1	0,00	Uruguay Government International Bond			
6,000 % fällig am 25.04.2036 ^	49	36	0,00	3,815 % fällig am 01.03.2036	2	2	0,00	4,975 % fällig am 20.04.2055 \$	800	1.113	0,00
MortgageIT Trust 0,888 % fällig am 25.12.2034	180	181	0,00	3,893 % fällig am 01.03.2037	3	3	0,00				
NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates 0,598 % fällig am 25.02.2035 ^	329	279	0,00	3,910 % fällig am 01.03.2036	1	1	0,00	<b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>			
Residential Accredit Loans, Inc. Trust 0,568 % fällig am 25.04.2046	6.333	2.655	0,01	4,500 % fällig am 01.01.2040	64	72	0,00	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
2,109 % fällig am 25.08.2035	286	259	0,00	5,992 % fällig am 25.11.2055	6.507	3.952	0,02	CLP Power Hong Kong Financing Ltd. 2,125 % fällig am 30.06.2030	20.400	20.671	0,07
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	4.045	3.871	0,02	Ginnie Mae, TBA				Global Switch Holdings Ltd. 2,250 % fällig am 31.05.2027 €	3.000	4.043	0,02
Residential Asset Securitization Trust 6,500 % fällig am 25.04.2037 ^	2.175	864	0,00	4,720 % fällig am 01.02.2024	37	39	0,00	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd. 6,125 % fällig am 15.09.2029 \$	7.200	8.766	0,03
Sequoia Mortgage Trust 0,552 % fällig am 20.05.2035	226	227	0,00	5,240 % fällig am 01.08.2023	33	34	0,00	Studio City Finance Ltd. 6,000 % fällig am 15.07.2023	10.800	11.427	0,04
0,778 % fällig am 20.05.2034	863	866	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security				6,500 % fällig am 15.01.2028	1.430	1.537	0,01
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 3,024 % fällig am 25.04.2035	289	286	0,00	1,719 % fällig am 01.12.2034	48	49	0,00	TSMC Global Ltd. 0,750 % fällig am 28.09.2025	800	797	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,338 % fällig am 25.07.2046 ^	243	195	0,00	1,944 % fällig am 01.06.2043 - 01.10.2044	22	22	0,00	1,375 % fällig am 28.09.2030	5.400	5.308	0,02
0,568 % fällig am 25.05.2036	16	13	0,00	2,527 % fällig am 01.09.2037	3	3	0,00	Summe Jungfernseln (Britisch)		52.549	0,19
0,652 % fällig am 19.07.2035	2	2	0,00	2,856 % fällig am 01.09.2037	1	1	0,00	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
0,708 % fällig am 25.02.2036 ^	34	32	0,00	3,000 % fällig am 01.06.2042 - 01.10.2046	64.046	68.225	0,24	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
2,069 % fällig am 25.03.2046	247	244	0,00	3,062 % fällig am 01.03.2037	43	44	0,00	Pacific Gas & Electric Co. 1,600 % fällig am 15.11.2021	22.400	22.415	0,08
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates 2,475 % fällig am 25.06.2033	4	4	0,00	3,500 % fällig am 01.10.2045	5.853	6.430	0,02				
2,873 % fällig am 25.07.2033	279	285	0,00	3,588 % fällig am 01.02.2037	1	1	0,00	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	27.439.093	97,38
Thornburg Mortgage Securities Trust 2,316 % fällig am 25.09.2037	685	702	0,00	4,000 % fällig am 01.05.2030 - 01.11.2041	422	457	0,00	<b>AKTIEN</b>			
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,518 % fällig am 25.05.2034	2.277	1.955	0,01	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
0,688 % fällig am 25.12.2045	7	7	0,00	2,000 % fällig am 01.03.2051	65.000	67.306	0,24	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
0,768 % fällig am 25.01.2045	29	29	0,00	2,500 % fällig am 01.03.2051	191.770	201.546	0,72	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (h)	3.787.451	38.215	0,14
1,609 % fällig am 25.08.2046	11	10	0,00	3,000 % fällig am 01.01.2051	401.420	420.738	1,49	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)	11.973.716	139.973	0,50
1,773 % fällig am 25.11.2041	213	205	0,00	3,500 % fällig am 01.01.2051	1.212.991	1.282.481	4,55	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (h)	3.637.652	46.778	0,17
3,596 % fällig am 25.03.2035	92	95	0,00	4,000 % fällig am 01.01.2051	443.700	474.151	1,68	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	223.520.262	2.226.709	7,90
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,338 % fällig am 25.06.2037	4.629	4.393	0,02	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)				PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h)	329.257	4.277	0,01
1,449 % fällig am 25.11.2046 ^	2.986	2.520	0,01	0,250 % fällig am 15.07.2029	163.880	185.654	0,66				
3,195 % fällig am 25.06.2033	145	149	0,00	0,375 % fällig am 15.07.2025	187	205	0,00	Summe Investmentfonds	\$	2.719.020	9,65
Wells Fargo Alternative Loan Trust 0,688 % fällig am 25.03.2037 ^	2.189	1.887	0,01	0,375 % fällig am 15.01.2027	1.940	2.166	0,01				
3,327 % fällig am 25.07.2037 ^	274	253	0,00	0,500 % fällig am 15.01.2028	42.478	48.195	0,17				
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 3,169 % fällig am 25.08.2036 ^	486	467	0,00	0,625 % fällig am 15.04.2023	5.661	5.962	0,02				
		82.914	0,29	0,875 % fällig am 15.01.2029	4.640	5.457	0,02				
				1,000 % fällig am 15.02.2048	211	295	0,00	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
				1,000 % fällig am 15.02.2049	849	1.197	0,01	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)	2.587.040	263.068	0,93
				2,000 % fällig am 15.01.2026	656	780	0,00				
				2,500 % fällig am 15.01.2029	21.224	27.898	0,10				
				U.S. Treasury Notes							
				0,625 % fällig am 15.05.2030	204.190	199.660	0,71				
				0,875 % fällig am 15.11.2030	190.100	189.491	0,67				

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 802	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (818)	\$ 802	\$ 802	0,00
SAL	0,070	31.12.2020	04.01.2021	30.000	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 31.12.2022	(30.612)	30.000	30.000	0,11
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (31.430)</b>	<b>\$ 30.802</b>	<b>\$ 30.802</b>	<b>0,11</b>

<sup>(1)</sup> 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
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	76	\$ 34	0,00
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2021	80	13	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	1.535	1.480	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	8.374	(913)	(0,01)
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2021	5.212	(196)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	4.001	(99)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	600	(516)	0,00
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2021	574	1.200	0,00
				<b>\$ 1.003</b>	<b>0,00</b>

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens	
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	\$ 169,000	22.01.2021	361	\$ (279)	\$ (113)	0,00	
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	170,000	22.01.2021	74	(49)	(36)	0,00	
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	171,000	22.01.2021	360	(376)	(259)	0,00	
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	177,000	22.01.2021	74	(46)	(22)	0,00	
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	178,000	22.01.2021	361	(292)	(67)	0,00	
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	179,000	22.01.2021	360	(236)	(45)	0,00	
				<b>\$ (1.278)</b>	<b>\$ (542)</b>	<b>0,00</b>	
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>						<b>\$ 461</b>	<b>0,00</b>

## 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Kraft Heinz Foods Co.	(1,000) %	20.06.2022	\$ 6.300	\$ 16	0,00
Toll Brothers Finance Corp.	(1,000)	20.06.2024	23.500	(35)	0,00
				<b>\$ (19)</b>	<b>0,00</b>

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

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Group Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 10.300	\$ 100	0,00
Anadarko Petroleum Corp.	1,000	20.06.2021	\$ 1.800	41	0,00
Anadarko Petroleum Corp.	1,000	20.12.2021	24.050	878	0,00
Anadarko Petroleum Corp.	1,000	20.06.2022	300	(9)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2024	11.200	(5)	0,00
Atlantia SpA	1,000	20.06.2025	€ 15.200	440	0,00
Auchan Holding S.A.	1,000	20.12.2027	2.900	90	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2021	\$ 48.500	163	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.06.2022	29.900	(277)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2022	63.800	(265)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.06.2023	7.100	196	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 6.800	36	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	23.900	177	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	6.000	18	0,00
Canadian Natural Resources Ltd.	1,000	20.06.2022	\$ 3.900	(11)	0,00
DISH DBS Corp.	5,000	20.12.2022	12.650	56	0,00
DISH DBS Corp.	5,000	20.06.2023	8.600	431	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Enbridge, Inc.	1,000 %	20.12.2021	\$ 2.500	\$ 127	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.06.2022	26.500	(115)	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.06.2022	15.000	164	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2021	1.700	(194)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2022	200	(26)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2023	5.400	(428)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2023	8.100	(777)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2021	18.200	(2.503)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2021	5.800	(793)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2022	1.500	(203)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2023	1.300	(115)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2023	33.100	205	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	42.850	2.389	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	32.050	420	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	27.900	583	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2021	9.300	(124)	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.06.2022	6.700	(69)	0,00
Hess Corp.	1,000	20.12.2021	1.300	1	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20.12.2023	6.100	(136)	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2023	€ 21.500	(16)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.09.2021	\$ 7.200	55	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2021	23.750	482	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2022	6.200	(72)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2022	15.800	(106)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2023	11.000	545	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2023	€ 13.300	(745)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	25.300	(1.926)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	55.700	(4.864)	(0,02)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	800	49	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	1.900	(30)	0,00
Ryder System, Inc.	1,000	20.06.2022	\$ 9.400	(125)	0,00
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.06.2022	5.900	(50)	0,00
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.12.2022	17.800	(59)	0,00
Simon Property Group LP	1,000	20.06.2022	6.300	(70)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.12.2024	€ 17.000	(114)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	63.700	1.426	0,01
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2022	\$ 3.000	(14)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	€ 26.100	342	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	12.700	157	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2024	4.100	20	0,00
				\$ (4.650)	(0,02)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 105.200	\$ (2.834)	(0,01)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 55.000	\$ 2.263	0,01
CDX.IG-34 5-Year Index	1,000	20.06.2025	32.800	290	0,00
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	227.100	291	0,00
iTraxx Asia ex-Japan IG-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	74.000	599	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 2.228.400	10.339	0,04
				\$ 13.782	0,05

### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,840 %	03.01.2022	BRL 562.890	\$ (19)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,850	03.01.2022	220.500	(4)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,859	03.01.2022	308.410	(22)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,865	03.01.2022	473.400	(38)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,870	03.01.2022	569.800	(39)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,871	03.01.2022	375.000	(29)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,880	03.01.2022	147.200	(17)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,883	03.01.2022	266.100	(32)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,300	03.01.2022	446.700	560	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,360	03.01.2022	2.536.000	3.549	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		1,235	04.03.2025	CAD 49.900	821	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		1,270	03.03.2022	286.300	2.681	0,01

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,275 %	03.03.2025	CAD 40.800	\$ 812	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	52.500	1.047	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2022	129.700	992	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	334.800	20.489	0,07
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	60.400	3.442	0,01
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2025	1.000	38	0,00
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,588	16.12.2025	CNY 93.610	(39)	0,00
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,605	07.08.2025	77.050	(14)	0,00
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,605	16.12.2025	140.470	(41)	0,00
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,611	04.08.2025	77.000	(11)	0,00
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,620	16.07.2025	182.400	(7)	0,00
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,625	07.08.2025	77.050	(3)	0,00
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,633	10.08.2025	85.600	(2)	0,00
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,640	15.07.2025	308.900	37	0,00
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,640	16.07.2025	51.600	5	0,00
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,650	21.08.2025	80.500	9	0,00
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,671	16.12.2025	280.940	52	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,790	17.03.2026	112.000	91	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,810	17.03.2026	44.400	42	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,828	17.03.2026	175.100	189	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,848	17.03.2026	50.000	61	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,873	17.03.2026	75.200	105	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,883	17.03.2026	145.600	214	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,895	17.03.2026	100.000	156	0,00
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	0,970	10.09.2050	\$ 33.300	(3.387)	(0,01)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	0,984	14.09.2050	38.800	(3.792)	(0,01)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	0,990	01.09.2050	36.800	(3.574)	(0,01)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,185	23.10.2050	38.700	(1.838)	(0,01)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,214	13.10.2050	33.900	(1.281)	0,00
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,250	27.10.2050	41.100	(1.327)	0,00
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,250	04.11.2050	43.400	(1.372)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>		3-Month USD-LIBOR	1,400	04.01.2051	39.600	604	0,00
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	3,100	16.09.2029	39.000	(943)	0,00
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	4,848	17.12.2025	ZAR 96.000	36	0,00
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	5,025	04.12.2025	3.724.600	3.278	0,01
Zahlung		6-Month CLP-CHILIBOR	2,410	31.01.2025	CLP 20.848.000	1.473	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>		6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	£ 90.300	(55)	0,00
Zahlung		6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.09.2025	50.200	1.742	0,01
Zahlung		6-Month HUF-BBR	1,000	19.09.2023	HUF 37.770.400	2.271	0,01
Zahlung		6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	16.157.700	618	0,00
Zahlung		6-Month JPY-LIBOR	0,000	18.12.2029	¥ 6.555.000	(596)	0,00
Erhalt		6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	7.992.900	(1.742)	(0,01)
Erhalt		6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	1.507.100	(480)	0,00
Erhalt		6-Month JPY-LIBOR	1,000	18.09.2023	890.000	130	0,00
Erhalt		6-Month JPY-LIBOR	1,000	20.09.2024	1.829.900	(97)	0,00
Zahlung		UKRPI	3,530	15.10.2031	£ 60.800	5.878	0,02
						\$ 30.621	0,11
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 36.900</b>	<b>0,13</b>

(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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### 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 <sup>(1)</sup>	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	\$ 5.879	0,02
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	35.260	3.891	3.892	0,01
							\$ 9.955	\$ 9.771	0,03

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

## VERKAUFSoPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONEN AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.01.2021	59.600	\$ (101)	\$ (8)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	33.500	(61)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	27.200	(42)	(3)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450	20.01.2021	113.800	(103)	(78)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	167.800	(266)	(25)	0,00
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	26.700	(39)	(35)	0,00
	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	16.100	(117)	(11)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	78.900	(221)	(14)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	27.500	(36)	(3)	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	51.300	(24)	(19)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	23.600	(31)	(20)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	51.300	(52)	(41)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	11.000	(13)	(9)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	50.000	(56)	(69)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	43.600	(81)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	50.000	(89)	(8)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	55.100	(104)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	47.000	(57)	(37)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	142.100	(112)	(82)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	48.600	(41)	(49)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	82.500	(110)	(110)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	142.100	(139)	(159)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	48.600	(58)	(47)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	52.400	(32)	(26)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	52.400	(77)	(89)	0,00
	BRC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	109.100	(228)	(11)
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,700	17.02.2021	51.700	(67)	(41)	0,00
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,700	17.03.2021	48.300	(67)	(64)	0,00
Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Kauf	0,375	21.04.2021	109.800	(52)	(53)	0,00
Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index		Verkauf	0,750	21.04.2021	109.800	(194)	(187)	(0,01)
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	26.400	(43)	(39)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,950	20.01.2021	32.200	(49)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	24.400	(30)	(8)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	11.000	(13)	(9)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	58.900	(94)	(8)	0,00
FBF	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	59.500	(39)	(41)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	59.500	(70)	(32)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	25.800	(34)	(9)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	17.02.2021	24.300	(59)	(6)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	53.400	(82)	(42)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	21.100	(15)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	53.500	(37)	(6)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	27.500	(32)	(4)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	11.800	(15)	(9)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	31.300	(24)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	48.100	(37)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	56.700	(40)	(39)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	56.700	(61)	(31)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	97.700	(64)	(56)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	55.300	(38)	(55)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	97.700	(107)	(110)	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	55.300	(69)	(46)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	50.400	(91)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	61.600	(125)	(7)	0,00
MYC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	28.400	(55)	(2)	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	62.600	(34)	(30)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	62.600	(63)	(32)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	51.300	(69)	(41)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	59.300	(74)	(41)	0,00
						\$ (4.233)	\$ (2.027)	(0,01)

## DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
HUS	Put - OTC USD versus CNH	CNH 6,420	26.02.2021	60.040	\$ (266)	\$ (210)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6,660	26.02.2021	59.840	(266)	(209)	0,00
					\$ (532)	\$ (419)	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175 %	15.03.2023	159.840	\$ (5.929)	\$ (5.865)	(0,02)
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,012	14.01.2021	32.800	(261)	(50)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,015	14.01.2021	32.800	(261)	(130)	0,00
DUB	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,298	11.01.2021	51.400	(437)	(111)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,598	11.01.2021	51.400	(437)	(27)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,830 %	22.01.2021	58.100	\$ (236)	\$ (118)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,070	22.01.2021	58.100	(235)	(102)	0,00
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	105.770	(3.823)	(3.881)	(0,02)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,100	19.01.2021	39.200	(451)	(18)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,460	19.01.2021	39.200	(451)	(389)	0,00
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,210	04.01.2021	36.800	(228)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,510	04.01.2021	36.800	(228)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,165	11.01.2021	53.700	(400)	(9)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,280	11.01.2021	18.800	(94)	(30)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,485	11.01.2021	53.700	(400)	(205)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,580	11.01.2021	18.800	(94)	(14)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,110	15.01.2021	36.800	(342)	(14)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,450	15.01.2021	36.800	(342)	(370)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,131	19.01.2021	37.100	(417)	(26)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,491	19.01.2021	37.100	(417)	(271)	0,00
NGF	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,270	07.01.2021	40.400	(335)	(18)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,570	07.01.2021	40.400	(335)	(10)	0,00
							\$ (16.153)	\$ (11.659)	(0,04)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 101,563	07.01.2021	13.000	\$ (44)	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	101,672	07.01.2021	20.750	(70)	0	0,00
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2050	103,367	14.01.2021	21.000	(92)	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2051	103,594	14.01.2021	20.500	(79)	(2)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	25.600	(42)	(23)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	19.000	(45)	(86)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	12.100	(31)	(31)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	99,688	04.02.2021	21.000	(125)	(106)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,188	04.02.2021	25.000	(62)	(56)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,266	04.02.2021	25.000	(61)	(57)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	2.600	(8)	(3)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,141	04.03.2021	9.000	(24)	(9)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	104,141	04.03.2021	9.000	(10)	(11)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,367	04.02.2021	5.800	(17)	(23)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,406	04.02.2021	29.500	(92)	(118)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,703	04.02.2021	12.000	(30)	(51)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,750	04.02.2021	8.000	(25)	(22)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	103,750	04.02.2021	8.000	(19)	(36)	0,00
					\$ (876)	\$ (635)	0,00

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 14.500	\$ (304)	\$ 559	\$ 255	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	31.900	(562)	928	366	0,00
	New York State General Obligation Bonds, Series 2005	1,850	20.03.2021	1.800	0	7	7	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	4.600	(470)	485	15	0,00
BPS	BHP Billiton Finance USA Ltd.	1,000	20.06.2021	5.100	(156)	180	24	0,00
	CNAC HK Finbridge Co. Ltd.	1,000	20.12.2024	27.400	(204)	(186)	(390)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	4.400	(85)	168	83	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	4.200	(68)	145	77	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	4.200	(8)	69	61	0,00
BRC	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20.12.2024	800	12	9	21	0,00
	Huarong Finance Co. Ltd.	1,000	20.12.2024	23.000	(471)	502	31	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2023	900	(12)	28	16	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.500	(294)	532	238	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	19.100	54	288	342	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	68.500	(1.393)	1.941	548	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	3.600	6	46	52	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	31.400	(1.185)	342	(843)	0,00
CBK	AXA Equitable Holdings, Inc.	1,000	20.06.2023	8.700	(237)	354	117	0,00
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	3.000	286	(22)	264	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	\$ 11.100	(270)	321	51	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2022	500	(3)	11	8	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	9.200	(151)	319	168	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	7.900	(762)	788	26	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	7.900	(659)	690	31	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	5.700	(6)	111	105	0,00
FBF	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.000	7	47	54	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	37.000	(443)	1.004	561	0,00
GLM	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	44.900	(502)	1.266	764	0,01
GST	American Tower Corp.	1,000	20.06.2021	17.500	(826)	872	46	0,00
	Enterprise Products Operating LLC	1,000	20.06.2021	7.000	(361)	392	31	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2023	2.500	(34)	79	45	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
	Intrum AB	5,000 %	20.12.2024	€ 43.500	\$ 5.273	\$ (1.452)	\$ 3.821	0,02
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	\$ 2.900	(22)	72	50	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	8.000	(67)	207	140	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	23.500	(2.523)	2.600	77	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	5.700	(7)	112	105	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	10.700	(430)	142	(288)	0,00
HUS	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.200	(16)	37	21	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2022	2.500	(37)	67	30	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	34.150	(538)	1.184	646	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	4.400	(59)	139	80	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	2.400	(269)	277	8	0,00
JLN	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 10.000	1.189	(310)	879	0,01
JPM	AP Moller - Maersk A/S	1,000	20.06.2022	12.800	(72)	181	109	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2022	\$ 21.200	(306)	561	255	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	10.600	(201)	402	201	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.500	(24)	51	27	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2024	16.300	223	126	349	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2024	8.100	112	66	178	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	14.200	(1.347)	1.393	46	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	7.600	(1)	141	140	0,00
	Southern Co.	1,000	20.12.2022	23.000	285	139	424	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.12.2021	200	(8)	17	9	0,00
MYC	Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2021	€ 33.800	237	89	326	0,00
	Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	1,000	20.12.2024	\$ 16.500	322	70	392	0,00
	Enterprise Products Operating LLC	1,000	20.06.2021	33.200	(1.141)	1.286	145	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	27.100	(176)	651	475	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	18.000	(248)	420	172	0,00
	Pioneer Natural Resources Co.	1,000	20.06.2025	8.400	(408)	492	84	0,00
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 2.700	311	(74)	237	0,00
NGF	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	\$ 24.100	23	326	349	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	7.900	(651)	682	31	0,00
					\$ (9.677)	\$ 22.369	\$ 12.692	0,05

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2021	\$ 7.100	\$ 1.079	\$ (740)	\$ 339	0,00
BPS	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	5.800	676	(71)	605	0,00
BRC	iTraxx Japan 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	¥ 4.269.600	676	341	1.017	0,00
CBK	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	\$ 29.550	2.782	(1.371)	1.411	0,01
	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	8.000	828	7	835	0,00
	iTraxx Japan 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	¥ 5.095.590	770	444	1.214	0,01
GST	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	\$ 13.500	1.141	(496)	645	0,00
	CDX.HY-29 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2022	6.000	833	(322)	511	0,00
	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	24.000	2.849	(344)	2.505	0,01
	iTraxx Japan 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	¥ 10.852.297	1.663	923	2.586	0,01
JPM	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	\$ 3.550	304	(134)	170	0,00
	CDX.HY-29 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2022	4.900	779	(362)	417	0,00
	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	44.300	5.450	(826)	4.624	0,02
	iTraxx Japan 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	¥ 8.678.720	1.385	683	2.068	0,01
MYC	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	\$ 6.600	784	(95)	689	0,00
					\$ 21.999	\$ (2.363)	\$ 19.636	0,07

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	01.2021	AUD	\$ 26.319	\$ 19.434	\$ 0	\$ (876)	0,00	
	01.2021	CAD	\$ 75.439	\$ 58.177	0	(1.039)	0,00	
	01.2021	\$	\$ 32.538	€ 26.551	0	(49)	0,00	
	01.2021		111.895	¥ 11.636.991	822	0	822	0,00
	01.2021		21.053	PLN 81.420	802	0	802	0,00
	03.2021	HKD	\$ 12.729	\$ 1.642	0	0	0	0,00
	03.2021	\$	148	THB 4.486	2	0	2	0,00
BPS	01.2021	BRL	\$ 2.259	\$ 435	0	0	0	0,00
	01.2021	£	4.686	6.259	0	(147)	(147)	0,00
	01.2021	PEN	\$ 29.769	8.304	73	0	73	0,00
	01.2021	\$	446	BRL 2.259	0	(11)	(11)	0,00
	01.2021		43.718	€ 35.967	302	(9)	293	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens					
	01.2021	\$	3.036	£	2.258	\$	51	\$	0	\$	51	0,00
	01.2021		3.531	MXN	70.027		0		(23)		(23)	0,00
	01.2021		7.127	PLN	27.626		288		0		288	0,00
	01.2021		8.825	ZAR	134.294		295		0		295	0,00
	01.2021	ZAR	92.232	\$	6.304		26		0		26	0,00
	02.2021	RUB	4.524.899		61.336		432		(36)		396	0,00
	03.2021	KRW	382.630		346		0		(6)		(6)	0,00
	03.2021	SGD	1.067		791		0		(17)		(17)	0,00
	03.2021	\$	110	INR	8.277		2		0		2	0,00
BRC	01.2021	€	834.557	\$	999.460		0	(21.662)		(21.662)	(0,07)	
	01.2021	\$	1.785	£	1.329		32		0		32	0,00
	01.2021		2.384	TRY	18.718		120		0		120	0,00
	01.2021	ZAR	83.279	\$	5.699		31		0		31	0,00
	01.2021	£	5.257		7.026		0	(160)		(160)	0,00	
CBK	01.2021	PEN	731.509		202.895		636		0		636	0,00
	01.2021	RUB	335.879		4.365		0	(171)		(171)	0,00	
	01.2021	\$	10.892	¥	1.134.501		97		0		97	0,00
	01.2021		355	PLN	1.339		5		0		5	0,00
	01.2021		11	TRY	87		0		0		0	0,00
	02.2021	PEN	55.083	\$	15.330		98		0		98	0,00
	02.2021	RUB	1.716.859		22.889		45	(276)		(231)	0,00	
	02.2021	\$	2.412	MXN	55.406		357		0		357	0,00
	03.2021	CNH	31.606	\$	4.766		0	(76)		(76)	0,00	
	03.2021	\$	53.143	MXN	1.085.614		845		0		845	0,01
	04.2021	PEN	10.849	\$	3.018		18		0		18	0,00
	06.2021	\$	3.057	MXN	64.581		127		0		127	0,00
DUB	01.2021	PEN	125.589	\$	34.894		175		0		175	0,00
GLM	01.2021	BRL	134.925		25.964		0	(13)		(13)	0,00	
	01.2021	¥	27.437.923		265.099		0	(668)		(668)	0,00	
	01.2021	PEN	9.089		2.522		9		0		9	0,00
	01.2021	RUB	418.126		5.458		0	(189)		(189)	0,00	
	01.2021	\$	26.697	BRL	134.925		0	(721)		(721)	0,00	
	01.2021		234	MXN	4.643		0	(1)		(1)	0,00	
	01.2021		15.327	NZD	21.823		386		0		386	0,00
	01.2021		192	TRY	1.489		8		0		8	0,00
	01.2021		2.020	ZAR	30.778		70		0		70	0,00
	02.2021	PEN	25.941	\$	7.182		8		0		8	0,00
	02.2021	RUB	1.180.722		15.486		0	(416)		(416)	0,00	
	02.2021	\$	265.173	¥	27.437.923		674		0		674	0,00
	02.2021		828	RUB	61.325		0	(2)		(2)	0,00	
	03.2021	PEN	2.586	\$	717		2		0		2	0,00
HUS	01.2021	AUD	25.649		19.307		0	(486)		(486)	0,00	
	01.2021	BRL	333.608		65.805		1.578		0		1.578	0,01
	01.2021	€	152.184		184.698		0	(1.522)		(1.522)	(0,01)	
	01.2021	£	87.497		116.834		0	(2.774)		(2.774)	(0,01)	
	01.2021	\$	64.196	BRL	333.608		31		0		31	0,00
	01.2021		98.973	€	81.040		296	(105)		(105)	0,00	
	01.2021		21.511	£	16.138		549		0		549	0,00
	01.2021		20.111	¥	2.095.878		190		0		190	0,00
	01.2021		4.005	MXN	82.424		124		0		124	0,00
	01.2021		17.934	PLN	68.430		434		0		434	0,00
	01.2021	ZAR	153.784	\$	10.490		23		0		23	0,00
	02.2021	RUB	1.318.375		17.692		34	(93)		(93)	0,00	
	02.2021	\$	65.769	BRL	333.608		0	(1.563)		(1.563)	(0,01)	
	03.2021	PEN	12.711	\$	3.542		28		0		28	0,00
	03.2021	\$	23.954	IDR	342.880.050		552		0		552	0,00
JPM	01.2021	AUD	19.895	\$	14.638		0	(714)		(714)	0,00	
	01.2021	BRL	68.413		13.165		0	(6)		(6)	0,00	
	01.2021	CAD	7.947		6.214		0	(24)		(24)	0,00	
	01.2021	€	2.485.063		2.981.447		0	(59.396)		(59.396)	(0,21)	
	01.2021	\$	13.510	BRL	68.413		0	(339)		(339)	0,00	
	01.2021		13.382	ZAR	203.731		453		0		453	0,00
	01.2021	ZAR	106.079	\$	7.188		17	(32)		(15)	0,00	
	03.2021	\$	35.143	COP	128.746.400		2.453		0		2.453	0,01
	03.2021		19.845	INR	1.477.974		238		0		238	0,00
MYI	01.2021	CHF	47	\$	53		0		0		0	0,00
	01.2021	€	3.353		4.111		9		0		9	0,00
	01.2021	£	4.345		5.916		0	(22)		(22)	0,00	
	01.2021	SGD	305		230		0		0		0	0,00
	01.2021	\$	1.499	CAD	1.910		1		0		1	0,00
	01.2021		8.926	CHF	8.084		220		0		220	0,00
	01.2021		117	€	96		0		0		0	0,00
	01.2021		36.930	£	27.152		189		0		189	0,00
	01.2021		34.311	¥	3.575.300		320		0		320	0,00
	01.2021		1.338	PLN	5.093		29		0		29	0,00
	01.2021		72	SGD	96		0		0		0	0,00
RBC	01.2021	SGD	28	\$	21		0		0		0	0,00
	01.2021	\$	1.005	CHF	894		6		0		6	0,00
	01.2021	ZAR	142.884	\$	9.697		0	(6)		(6)	0,00	
	03.2021	TWD	3.372		120		0	(2)		(2)	0,00	
SCX	01.2021	AUD	11.617		8.558		0	(407)		(407)	0,00	
	01.2021	BRL	70.153		13.500		0	(7)		(7)	0,00	
	01.2021	£	69.601		93.037		0	(2.107)		(2.107)	(0,01)	

## 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	
	01.2021	\$	13.274 BRL	70.153	\$ 304	\$ (72)	0,00	
	01.2021		1.741 €	1.421	0	(3)	0,00	
	01.2021		2.607 £	1.930	31	0	0,00	
	01.2021		1.855 HUF	567.014	58	0	0,00	
	02.2021		108 ILS	371	8	0	0,00	
	03.2021		31.595 INR	2.351.446	358	0	0,00	
SSB	01.2021	CAD	13.948 \$	10.727	0	(222)	0,00	
	01.2021	£	623.122	831.759	0	(20.044)	(0,07)	
TOR	01.2021	BRL	57.857	11.133	0	(5)	0,00	
	01.2021	CAD	162.347	125.314	0	(2.118)	(0,01)	
	01.2021	\$	11.413 BRL	57.857	0	(275)	0,00	
	01.2021		127.431 CAD	162.347	1	0	0,00	
	01.2021		86.227 ¥	8.995.253	902	0	0,01	
	01.2021	ZAR	143.280 \$	9.746	0	(6)	0,00	
	02.2021	CAD	162.347	127.443	0	(2)	0,00	
	02.2021	€	834.540	1.021.788	0	(9)	0,00	
UAG	01.2021	AUD	39.093	28.743	0	(1.425)	(0,01)	
	01.2021	\$	21.912 MXN	438.980	77	0	0,00	
	01.2021		4.611 ZAR	70.236	159	0	0,00	
	02.2021	RUB	3.705.819 \$	49.048	44	(901)	0,00	
					\$ 16.554	\$ (121.255)	\$ (104.701)	(0,37)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	AUD	2.038 \$	1.527	\$ 0	\$ (46)	(0,01)	
	01.2021	\$	49.946 AUD	67.619	2.235	0	0,01	
BPS	01.2021		3.028	4.117	149	0	0,00	
CBK	01.2021		312	409	3	0	0,00	
HUS	01.2021	AUD	803 \$	602	0	(17)	0,00	
	01.2021	\$	37.963 AUD	51.395	1.698	0	0,01	
MYI	01.2021	AUD	64 \$	47	0	(2)	0,00	
	01.2021	\$	169 AUD	225	4	0	0,00	
SCX	01.2021	AUD	1.236 \$	955	1	0	0,00	
	01.2021	\$	11.290 AUD	15.305	520	0	0,00	
UAG	01.2021		48.741	66.183	2.331	0	0,01	
					\$ 6.941	\$ (65)	\$ 6.876	0,02

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$	510 CAD	662	\$ 9	\$ 0	0,00	
BPS	01.2021		75	97	1	0	0,00	
CBK	01.2021		805	1.047	16	0	0,00	
GLM	01.2021	CAD	16 \$	13	0	0	0,00	
HUS	01.2021	\$	197 CAD	255	3	0	0,00	
MYI	01.2021	CAD	16 \$	13	0	0	0,00	
SSB	01.2021	\$	136 CAD	177	3	0	0,00	
UAG	01.2021		806	1.047	16	0	0,00	
					\$ 48	\$ 0	\$ 48	0,00

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen 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) 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	01.2021	\$	373.990 CHF	337.795	\$ 8.192	\$ (1)	0,03	
BPS	01.2021	CHF	453	515	2	0	0,00	
	01.2021	\$	2.815 CHF	2.499	12	0	0,00	
BRC	01.2021		3.841	3.456	69	0	0,00	
CBK	01.2021	CHF	966	1.092	0	(1)	0,00	
GLM	01.2021	\$	181.855 CHF	164.164	3.880	0	0,01	
MYI	01.2021	CHF	537	605	0	(3)	0,00	
	01.2021	\$	361.934 CHF	327.795	8.934	0	0,03	
SCX	01.2021		29.330	26.505	660	(2)	0,00	
SSB	01.2021	CHF	1.734	1.953	0	(9)	0,00	
	01.2021	\$	410.022 CHF	369.486	8.015	0	0,03	
UAG	01.2021	CHF	143	161	0	(1)	0,00	
	01.2021	\$	3.490 CHF	3.083	2	(3)	(1)	
					\$ 29.766	\$ (20)	\$ 29.746	0,10

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse 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
BPS	01.2021	\$ 34.173	CZK 745.945	\$ 582	\$ 0	\$ 582	0,00
CBK	01.2021	2.092	45.784	41	0	41	0,00
HUS	01.2021	35.011	767.633	753	0	753	0,01
UAG	01.2021	CZK 8.233	\$ 385	1	0	1	0,00
	01.2021	\$ 34.176	CZK 745.945	578	0	578	0,00
				\$ 1.955	\$ 0	\$ 1.955	0,01

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend und Class E EUR (Currency Exposure) 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	01.2021	€ 84	\$ 103	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 688	¥ 71.523	5	0	5	0,00
BPS	01.2021	€ 209	\$ 256	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 1.388	AUD 1.887	68	0	68	0,00
	01.2021	456	€ 373	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	€ 134	\$ 161	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 39	€ 33	0	0	0	0,00
	01.2021	67	¥ 6.973	1	0	1	0,00
	01.2021	116	NZD 165	3	0	3	0,00
	01.2021	78	SEK 669	3	0	3	0,00
GLM	01.2021	¥ 146.665	\$ 1.417	0	(4)	(4)	0,00
	02.2021	\$ 1.417	¥ 146.665	4	0	4	0,00
HUS	01.2021	€ 60	\$ 73	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 519	€ 427	4	0	4	0,00
	01.2021	10.421	£ 7.792	230	0	230	0,00
	01.2021	124	¥ 12.882	1	0	1	0,00
JPM	01.2021	€ 16	\$ 20	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	\$ 730	CHF 661	18	0	18	0,00
	01.2021	154	€ 126	1	0	1	0,00
SCX	01.2021	52.664	43.975	1.141	0	1.141	0,01
	02.2021	53.842	43.975	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	CAD 7.093	\$ 5.567	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 5.475	CAD 7.093	92	0	92	0,00
	01.2021	530	¥ 55.287	6	0	6	0,00
	02.2021	5.568	CAD 7.093	0	0	0	0,00
				\$ 1.578	\$ (8)	\$ 1.570	0,01

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen 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) thesaurierend, 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	01.2021	€ 4.290	\$ 5.269	\$ 20	\$ 0	\$ 20	0,00
BPS	01.2021	8.619	10.497	2	(52)	(50)	0,00
	01.2021	\$ 61.737	€ 50.453	75	(75)	0	0,00
BRC	01.2021	526.937	439.956	11.371	0	11.371	0,04
CBK	01.2021	19.728	16.352	281	0	281	0,00
HUS	01.2021	€ 15.835	\$ 19.257	0	(118)	(118)	0,00
	01.2021	\$ 156.754	€ 130.155	2.548	(38)	2.510	0,01
JPM	01.2021	€ 1.338	\$ 1.633	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	\$ 1.550.178	€ 1.292.088	30.883	0	30.883	0,11
MYI	01.2021	42.181	34.584	138	0	138	0,00
SCX	01.2021	2.424.529	2.024.475	52.517	0	52.517	0,19
	02.2021	3.764.211	3.074.359	0	(16)	(16)	0,00
TOR	01.2021	2.285.984	1.908.791	49.517	0	49.517	0,17
	02.2021	1.588.183	1.297.123	0	(7)	(7)	0,00
				\$ 147.352	\$ (310)	\$ 147.042	0,52

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend, Class R GBP (Hedged) ausschüttend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W 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	01.2021	\$ 8.216	£ 6.112	\$ 139	\$ 0	\$ 139	0,00
BRC	01.2021	£ 23.823	\$ 31.884	0	(682)	(682)	0,00
CBK	01.2021	22.666	30.949	0	(36)	(36)	0,00
	01.2021	\$ 1.790.976	£ 1.339.816	40.542	0	40.542	0,14
HUS	01.2021	£ 12.349	\$ 16.473	0	(408)	(408)	0,00
	01.2021	\$ 1.976.419	£ 1.477.784	43.700	0	43.700	0,15

## 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
MYI	01.2021	£ 1.619	\$ 2.198	\$ 0	\$ (15)	\$ (15)	0,00
	01.2021	\$ 121.330	£ 90.902	2.933	0	2.933	0,01
SCX	01.2021	£ 14.208	\$ 18.985	0	(437)	(437)	0,00
SSB	01.2021	\$ 2.095.141	£ 1.569.600	50.491	0	50.491	0,18
				\$ 137.805	\$ (1.578)	\$ 136.227	0,48

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse Institutional HUF (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	01.2021	\$ 10.785	HUF 3.276.634	\$ 269	\$ 0	\$ 269	0,00
BRC	01.2021	689	205.927	5	0	5	0,00
MYI	01.2021	10.586	3.175.520	127	0	127	0,00
SSB	01.2021	10.578	3.175.520	135	0	135	0,00
				\$ 536	\$ 0	\$ 536	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 21.740	ILS 71.862	\$ 642	\$ 0	\$ 642	0,00
HUS	01.2021	23.057	76.420	745	0	745	0,00
JPM	01.2021	ILS 102	\$ 31	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2021	64	20	0	0	0	0,00
RBC	01.2021	\$ 466	ILS 1.508	4	0	4	0,00
SCX	01.2021	28	90	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	24.409	80.957	806	0	806	0,01
				\$ 2.197	\$ (1)	\$ 2.196	0,01

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 16.731	NOK 147.891	\$ 542	\$ 0	\$ 542	0,00
BRC	01.2021	15.766	138.439	403	0	403	0,00
CBK	01.2021	17	150	1	0	1	0,00
GLM	01.2021	63	558	2	0	2	0,00
MYI	01.2021	17.855	158.014	601	0	601	0,01
RYL	01.2021	108	938	2	0	2	0,00
SCX	01.2021	4	37	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	259	2.249	3	0	3	0,00
				\$ 1.554	\$ 0	\$ 1.554	0,01

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse Institutional PLN (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
BRC	01.2021	\$ 2.589	PLN 9.643	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	01.2021	169	633	1	0	1	0,00
JPM	01.2021	2.754	10.292	9	0	9	0,00
MYI	01.2021	2.732	10.281	27	0	27	0,00
SCX	01.2021	PLN 157	\$ 42	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	6.089	1.662	28	0	28	0,00
				\$ 65	\$ 0	\$ 65	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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
BOA	01.2021	\$ 221	CNH 1.458	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
BPS	01.2021	CNH 3.063	\$ 469	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 460	CNH 3.017	5	0	5	0,00
	02.2021	CNH 32	\$ 5	0	0	0	0,00
	02.2021	\$ 469	CNH 3.069	2	0	2	0,00
GLM	01.2021	CNH 3.067	\$ 471	0	(2)	(2)	0,00
	02.2021	\$ 471	CNH 3.073	2	0	2	0,00
HUS	01.2021	CNH 1.481	\$ 227	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 456	CNH 3.005	7	0	7	0,00
	02.2021	227	1.484	1	0	1	0,00
SSB	01.2021	20	132	0	0	0	0,00
UAG	02.2021	8	53	0	0	0	0,00
				\$ 20	\$ (5)	\$ 15	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 18.976	SEK 159.743	\$ 476	\$ 0	\$ 476	0,00
BPS	01.2021	SEK 46.366	\$ 5.583	\$ 0	\$ (63)	\$ (63)	0,00
	01.2021	\$ 394	SEK 3.245	3	(2)	1	0,00
BRC	01.2021	146.430	1.235.307	3.995	0	3.995	0,01
CBK	01.2021	12.191	103.968	469	0	469	0,00
GLM	01.2021	199.373	1.697.838	7.375	0	7.375	0,03
MYI	01.2021	175.448	1.486.979	5.623	0	5.623	0,02
SCX	01.2021	SEK 4.877	\$ 584	0	(10)	(10)	0,00
	01.2021	\$ 72.114	SEK 611.886	2.396	0	2.396	0,01
SSB	01.2021	816	6.869	21	0	21	0,00
UAG	01.2021	SEK 59.618	\$ 7.216	0	(44)	(44)	0,00
				\$ 20.358	\$ (119)	\$ 20.239	0,07

Zum 31. Dezember 2020 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	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2021	SGD 82.948	\$ 62.527	\$ 0	\$ (234)	\$ (234)	0,00
	02.2021	\$ 62.530	SGD 82.948	233	0	233	0,00
BRC	01.2021	SGD 530	\$ 396	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	\$ 1.444	SGD 1.937	21	0	21	0,00
CBK	01.2021	61.162	82.352	1.148	0	1.148	0,01
GLM	02.2021	SGD 753	\$ 570	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	1.148	857	0	(12)	(12)	0,00
	01.2021	\$ 823	SGD 1.106	14	0	14	0,00
	02.2021	SGD 1.113	\$ 838	0	(4)	(4)	0,00
	02.2021	\$ 637	SGD 845	2	0	2	0,00
MYI	01.2021	SGD 40.088	\$ 30.125	0	(206)	(206)	0,00
	02.2021	\$ 30.126	SGD 40.088	206	0	206	0,00
NGF	01.2021	SGD 83.167	\$ 62.414	0	(512)	(512)	0,00
	01.2021	\$ 61.058	SGD 81.847	870	0	870	0,00
	02.2021	62.416	83.167	512	0	512	0,00
SCX	01.2021	28.281	37.950	434	0	434	0,00
SSB	01.2021	SGD 1.047	\$ 783	0	(10)	(10)	0,00
	01.2021	\$ 3.701	SGD 4.964	54	0	54	0,00
UAG	01.2021	SGD 2.574	\$ 1.924	0	(23)	(23)	0,00
	01.2021	\$ 1.005	SGD 1.347	14	0	14	0,00
	02.2021	86	115	1	0	1	0,00
				\$ 3.509	\$ (1.006)	\$ 2.503	0,01

Summe Freiverkehrsfinauzderivate

\$ 273.230 0,97

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	\$ 13.100	\$ (13.586)	(0,05)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (13.586)	(0,05)
Summe Anlagen		\$ 30.485.920	108,19
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (2.307.750)	(8,19)
Nettovermögen		\$ 28.178.170	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

^ 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 Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

- (h) Mit dem Fonds verbunden.  
 (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (j) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	2,850 %	25.05.2024	23.06.2020	\$ 2.226	\$ 2.415	0,01
AT&T, Inc.	4,850	25.05.2047	17.05.2017 - 09.04.2019	5.745	7.177	0,03
AWAS Aviation Capital Ltd.	4,870	03.10.2021	02.10.2014	24.632	24.910	0,09
Citigroup, Inc.	2,572	03.06.2031	26.05.2020 - 09.07.2020	50.332	53.231	0,19
Deutsche Bank AG	2,129	24.11.2026	17.11.2020	8.150	8.345	0,03
Export-Import Bank of India	1,271	28.03.2022	19.12.2019	19.112	19.260	0,07
Morgan Stanley	7,500	02.04.2032	11.02.2020	42.735	43.072	0,15
				\$ 152.932	\$ 158.410	0,57

(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 70.686 und Barmittel in Höhe von USD 1.430 als Sicherheiten verpfändet.

(l) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 65.604 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 10 und Barmittel in Höhe von USD 1.570 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 324.932 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 31.090 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	461	310.161	(31)	310.591
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(13.586)	0	(13.586)
<b>Summen</b>	<b>\$ 2.456.414</b>	<b>\$ 27.978.583</b>	<b>\$ 50.923</b>	<b>\$ 30.485.920</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 24.558.696	\$ 100.294	\$ 24.658.992
Investmentfonds	971.503	0	0	971.503
Pensionsgeschäfte	0	448.225	0	448.225
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(30.136)	225.480	165	195.509
<b>Summen</b>	<b>\$ 941.369</b>	<b>\$ 25.232.401</b>	<b>\$ 100.459</b>	<b>\$ 26.274.229</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	(2,500) %	23.04.2020	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.837)	\$ (2.211)	(0,01)
	(0,450)	12.11.2020	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (528)	(528)	0,00
	(0,400)	09.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(2.946)	(2.945)	(0,01)
	(0,300)	19.11.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.114)	(1.114)	0,00
	(0,150)	07.08.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(2.374)	(2.373)	(0,01)
BRC	(2,500)	30.04.2020	TBD <sup>(1)</sup>	€ (1.196)	(1.439)	(0,01)
	(2,500)	15.09.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(2.436)	(2.959)	(0,01)
	(1,000)	05.11.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(2.204)	(2.693)	(0,01)
	(0,400)	29.10.2020	TBD <sup>(1)</sup>	£ (1.176)	(1.606)	(0,01)
CFR	(0,950)	12.11.2020	TBD <sup>(1)</sup>	€ (2.540)	(3.104)	(0,01)
	(0,900)	01.04.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(4.865)	(5.914)	(0,02)
	(0,900)	13.08.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(3.060)	(3.731)	(0,01)
	(0,900)	22.09.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.030)	(1.257)	0,00
	(0,900)	22.10.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.840)	(2.251)	(0,01)
	(0,750)	11.06.2020	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (1.884)	(1.876)	(0,01)

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	
					Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
JPS	0,025 %	20.10.2020	21.01.2021	\$ (1.356)	\$ (1.356)	(0,01)
	0,120	23.11.2020	11.01.2021	(30.886)	(30.890)	(0,11)
TDM	(0,150)	01.05.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.163)	(1.162)	0,00
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (69.409)</b>	<b>(0,25)</b>

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

#### Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte <sup>(1)</sup>	
					Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	0,110 %	01.12.2020	11.01.2021	\$ (66.734)	\$ (66.740)	(0,24)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (66.740)</b>	<b>(0,24)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 12.837	\$ (13.440)	\$ (603)
BPS	1.736	(2.630)	(894)
BRC	(5.275)	6.810	1.535
CBK	47.958	(40.380)	7.578
DUB	40	(1.250)	(1.210)
FAR	0	110	110
FBF	558	(600)	(42)
GLM	10.949	(11.870)	(921)
GST	9.918	(9.920)	(2)
HUS	46.769	(38.970)	7.799
JLN	863	0	863
JPM	(18.227)	23.850	5.623
MYC	1.199	(2.615)	(1.416)
MYI	19.369	(19.770)	(401)
NGF	1.222	(1.080)	142
RBC	2	0	2
RYL	2	0	2
SAL	(250)	70	(180)
SCX	55.367	(68.280)	(12.913)
SSB	38.437	(33.940)	4.497
TOR	48.096	(60.210)	(12.114)
UAG	1.660	(2.060)	(400)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	65,07	74,08
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	31,23	38,31
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,08	k. A.
Investmentfonds	9,65	4,44
Pensionsgeschäfte	0,11	2,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	(0,14)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,13	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate	0,97	1,02
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,05)	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,25)	(5,95)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,24)	(2,32)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Argentinien	0,01	k. A.
Australien	1,04	0,79
Österreich	0,35	0,05
Belgien	0,19	0,30
Bermuda	0,55	0,66
Brasilien	0,96	0,68
Kanada	1,65	1,64
Cayman-Inseln	4,65	4,18

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Chile	0,06	0,17
China	1,59	1,11
Kolumbien	0,05	0,03
Curacao	0,07	0,08
Dänemark	0,23	0,16
Finnland	0,15	0,14
Frankreich	2,46	2,18
Deutschland	2,08	2,04
Guernsey, Kanalinseln	0,37	0,54
Hongkong	0,88	1,02
Indien	0,52	1,01
Indonesien	0,28	0,29
Irak	k. A.	0,01
Irland	0,98	1,15
Insel Man	0,13	0,06
Israel	0,07	k. A.
Italien	2,00	1,20
Japan	2,54	2,54
Jersey, Kanalinseln	0,51	0,74
Kuwait	0,16	0,27
Luxemburg	3,37	3,75
Mauritius	0,25	0,27
Mexiko	0,95	1,10
Multinational	0,10	0,00
Niederlande	2,92	3,96
Neuseeland	k. A.	0,04
Norwegen	0,18	0,17
Panama	0,19	0,07
Peru	1,08	1,15
Portugal	0,02	k. A.
Katar	0,17	0,40
Rumänien	0,15	k. A.
Russland	0,89	0,94
Saudi-Arabien	0,24	0,45
Singapur	0,39	0,38
Slowakei	0,00	0,00
Slowenien	0,03	0,03
Südafrika	0,22	0,02
Südkorea	0,09	0,19
Spanien	1,06	0,85
Sri Lanka	0,00	0,00
Supranational	0,10	0,10
Schweden	0,36	0,31
Schweiz	2,14	2,62
Thailand	k. A.	0,01
Türkei	0,02	0,03
Ukraine	0,04	0,07
Vereinigte Arabische Emirate	0,21	0,23
Großbritannien	7,21	7,36
USA	50,20	64,77
Uruguay	0,00	0,00
Jungferinseln (Britisch)	0,19	0,02
Kurzfristige Instrumente	0,08	0,06
Investmentfonds	9,65	4,44
Pensionsgeschäfte	0,11	2,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,00	(0,14)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	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)	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzkauf	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,05	0,10
Zinsswaps	0,11	(0,11)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,03	0,05
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Inflation-Capped Options	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,04)	(0,05)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,05	0,04
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,07	0,14
Devisenterminkontrakte	(0,37)	(0,31)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,24	1,16
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,05)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(8,19)	(19,76)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
<b>AUSTRALIEN</b>					<b>STAATSEMISSIONEN</b>					<b>FRANKREICH</b>				
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Boral Finance Pty. Ltd. 3,000 % fällig am 01.11.2022	\$ 150	\$ 153	0,04		Canada Housing Trust 2,650 % fällig am 15.12.2028	CAD 1.000	\$ 890	0,27		SATO Oyj 1,375 % fällig am 24.02.2028	€ 1.200	\$ 1.509	0,45	
3,750 % fällig am 01.05.2028	200	211	0,06		Ontario Teachers' Finance Trust 0,050 % fällig am 25.11.2030	€ 600	737	0,22		Stora Enso Oyj 0,625 % fällig am 02.12.2030	500	623	0,19	
Commonwealth Bank of Australia 3,743 % fällig am 12.09.2039 (e)	200	236	0,07		Province of Quebec 1,850 % fällig am 13.02.2027	CAD 500	417	0,12		2,500 % fällig am 21.03.2028	200	280	0,08	
Lendlease Finance Ltd. 3,400 % fällig am 27.10.2027	AUD 1.370	1.117	0,34		Summe Kanada		2.044	0,61		Tornator Oyj 1,250 % fällig am 14.10.2026	200	252	0,08	
Macquarie University 2,250 % fällig am 22.05.2030	750	596	0,18				4.125	1,24		Summe Finnland		5.333	1,61	
Optus Finance Pty. Ltd. 1,000 % fällig am 20.06.2029	€ 300	387	0,12		<b>CAYMAN INSELN</b>					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,375 % fällig am 30.04.2025	\$ 150	162	0,05		<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 1,750 % fällig am 19.12.2024				
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 2,450 % fällig am 16.03.2031	1.300	1.367	0,41		MAF Sukuk Ltd. 3,933 % fällig am 28.02.2030	\$ 400	431	0,13		BNP Paribas S.A. 1,000 % fällig am 17.04.2024	€ 1.000	1.268	0,38	
		4.229	1,27		Tencent Holdings Ltd. 3,975 % fällig am 11.04.2029	500	570	0,17		1,125 % fällig am 28.08.2024	600	765	0,23	
					Summe Cayman Inseln		1.001	0,30		2,219 % fällig am 09.06.2026	\$ 1.200	1.257	0,38	
					<b>CHILE</b>					3,375 % fällig am 23.01.2026				
					<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					Bureau Veritas S.A. 3,125 % fällig am 21.01.2021				
					Banco Santander Chile 2,700 % fällig am 10.01.2025	1.100	1.166	0,35		Ceetrus S.A. 2,750 % fällig am 26.11.2026	200	265	0,08	
					Corp. Nacional del Cobre de Chile 3,625 % fällig am 01.08.2027	200	224	0,07		Credit Agricole S.A. 0,125 % fällig am 09.12.2027	700	856	0,26	
					Latam Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.08.2029	230	214	0,06		0,375 % fällig am 21.10.2025	400	499	0,15	
										0,750 % fällig am 05.12.2023	200	252	0,08	
										Danone S.A. 2,947 % fällig am 02.11.2026	\$ 200	220	0,07	
										Electricite de France S.A. 3,625 % fällig am 13.10.2025	600	673	0,20	
										Engie S.A. 0,375 % fällig am 21.06.2027	€ 500	626	0,19	
										Societe Generale S.A. 0,875 % fällig am 22.09.2028	200	253	0,08	
										4,000 % fällig am 12.01.2027	\$ 500	564	0,17	
										6,750 % fällig am 06.04.2028 (d)(e)	300	337	0,10	
												8.899	2,68	
										<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
										<b>SNCF Reseau</b>				
										0,750 % fällig am 25.05.2036				
										€ 500 663 0,20				
										2,250 % fällig am 20.12.2047				
										300 515 0,16				
										<b>Societe Du Grand Paris EPIC</b>				
										0,000 % fällig am 25.11.2030 (b)				
										500 618 0,19				
										1,000 % fällig am 18.02.2070				
										900 1.244 0,37				
										<b>UNEDIC ASSEO</b>				
										0,000 % fällig am 19.11.2030 (b)				
										300 375 0,11				
										0,250 % fällig am 16.07.2035				
										500 632 0,19				
										4.047 1,22				
										Summe Frankreich				
										12.946 3,90				
										<b>DEUTSCHLAND</b>				
										<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
										adidas AG 0,625 % fällig am 10.09.2035				
										1.000 1.284 0,39				
										Continental AG 0,375 % fällig am 27.06.2025				
										800 988 0,30				
										Deutsche Bahn Finance GmbH 0,625 % fällig am 08.12.2050				
										750 924 0,28				
										Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 10.06.2026				
										500 647 0,20				
										2,129 % fällig am 24.11.2026 (f)				
										\$ 1.000 1.024 0,31				
										2,222 % fällig am 18.09.2024				
										100 103 0,03				
										3,547 % fällig am 18.09.2031				
										900 977 0,29				
										3,961 % fällig am 26.11.2025				
										500 547 0,16				
										Eurogrid GmbH 1,113 % fällig am 15.05.2032				
										€ 300 402 0,12				
										Infineon Technologies AG 2,000 % fällig am 24.06.2032				
										1.000 1.393 0,42				
										Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028 (b)				
										800 1.015 0,31				
										0,750 % fällig am 30.09.2030				
										\$ 1.100 1.077 0,32				
										Schaeffler AG 3,375 % fällig am 12.10.2028				
										€ 500 675 0,20				

# Aufstellung der Wertpapieranlagen 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
Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	€ 400	\$ 499	0,15	<b>IRLAND</b> <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Japan Finance Organization for Municipalities 0,050 % fällig am 12.02.2027	€ 400	\$ 496	0,15
Symrise AG 1,375 % fällig am 01.07.2027	300	387	0,12	Orwell Park CLO Designated Activity Co. 0,780 % fällig am 18.07.2029	€ 76	\$ 93	0,03			1.611	0,49
		11.942	3,60	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Summe Japan		7.367	2,22
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				AIB Group PLC 2,875 % fällig am 30.05.2031	600	784	0,24	<b>JERSEY, KANALINSELN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2030 (b)	7.800	10.124	3,05	GE Capital International Funding Co. Unlimited Co. 3,373 % fällig am 15.11.2025	\$ 100	111	0,03	Aptiv PLC 1,600 % fällig am 15.09.2028	300	398	0,12
Land Nordrhein-Westfalen 0,000 % fällig am 12.10.2035 (b)	700	864	0,26	4,418 % fällig am 15.11.2035	200	239	0,07	<b>LUXEMBURG</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
0,500 % fällig am 25.11.2039	200	267	0,08	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875 % fällig am 15.01.2026	€ 300	407	0,12	CPI Property Group S.A. 1,625 % fällig am 23.04.2027	900	1.133	0,34
		11.255	3,39					2,750 % fällig am 22.01.2028	€ 350	494	0,15
Summe Deutschland		23.197	6,99	Summe Irland		1.634	0,49	Eurofins Scientific SE 3,750 % fällig am 17.07.2026	€ 900	1.294	0,39
<b>GUERNSEY, KANALINSELN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ISRAEL MAN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,875 % fällig am 26.07.2027	400	535	0,16
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	700	902	0,27	NE Property BV 3,375 % fällig am 14.07.2027	600	797	0,24	Medtronic Global Holdings S.C.A. 0,000 % fällig am 12.12.2022 (b)	800	984	0,30
3,000 % fällig am 29.03.2025	300	388	0,12	<b>ITALIEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Prologis International Funding S.A. 0,875 % fällig am 09.07.2029	300	390	0,12
Summe Guernsey, Kanalinseln		1.290	0,39	Assicurazioni Generali SpA 2,124 % fällig am 01.10.2030	200	261	0,08	1,625 % fällig am 17.06.2032	300	415	0,12
<b>HONGKONG</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,429 % fällig am 14.07.2031	500	671	0,20	1,750 % fällig am 15.03.2028	300	411	0,12
AIA Group Ltd. 3,200 % fällig am 16.09.2040	\$ 800	840	0,25	Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % fällig am 04.12.2024	300	377	0,11	1,876 % fällig am 17.04.2025	200	265	0,08
Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030	800	842	0,26	3,875 % fällig am 12.01.2028	\$ 400	442	0,13	SIG Combibloc Purchase Co. SARL 1,875 % fällig am 18.06.2023	300	380	0,11
MTR Corp. Ltd. 1,625 % fällig am 19.08.2030	900	892	0,27	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 1,000 % fällig am 08.09.2027	€ 300	380	0,12	2,125 % fällig am 18.06.2025	300	387	0,12
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3,150 % fällig am 12.05.2025	200	209	0,06	UniCredit SpA 5,459 % fällig am 30.06.2035	\$ 700	772	0,23			6.688	2,01
Summe Hongkong		2.783	0,84	6,750 % fällig am 10.09.2021 (d)(e)	€ 600	749	0,23	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>INDIEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 400	475	0,14	Großherzogtum Luxemburg 0,000 % fällig am 14.09.2032 (b)	700	885	0,27
Adani Green Energy UP Ltd. 6,250 % fällig am 10.12.2024	400	445	0,13	Unipol Gruppo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2030	€ 1.250	1.623	0,49	Summe Luxemburg		7.573	2,28
Axis Bank Ltd. 3,000 % fällig am 08.08.2022	200	204	0,06	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>MALAYSIA</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Bharti Airtel International Netherlands BV 3,375 % fällig am 20.05.2021	€ 200	248	0,08	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1,000 % fällig am 11.02.2030	200	253	0,08	Axiata SPV2 Bhd. 2,163 % fällig am 19.08.2030	\$ 700	708	0,21
Bharti Airtel Ltd. 4,375 % fällig am 10.06.2025	\$ 200	218	0,07	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,650 % fällig am 01.12.2030	1.300	1.765	0,53	<b>MAURITIUS</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	650	691	0,21	Summe Italien		7.768	2,34	Azure Power Solar Energy Pvt Ltd. 5,650 % fällig am 24.12.2024	600	642	0,19
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,100 % fällig am 16.07.2023	200	206	0,06	<b>JAPAN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025	400	416	0,13
5,950 % fällig am 24.10.2022	200	204	0,06	Central Japan Railway Co. 2,200 % fällig am 02.10.2024	\$ 500	525	0,16	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	250	265	0,08
		2.216	0,67	0,774 % fällig am 02.11.2021	400	428	0,13	Summe Mauritius		1.323	0,40
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Central Nippon Expressway Co. Ltd. 0,774 % fällig am 02.11.2021	200	201	0,06	<b>MEXIKO</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
Export-Import Bank of India 1,271 % fällig am 28.03.2022 (f)	200	201	0,06	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,339 % fällig am 19.07.2024	€ 200	248	0,07	BBVA Bancomer S.A. 5,125 % fällig am 18.01.2033 (e)	600	647	0,20
Summe Indien		2.417	0,73	0,680 % fällig am 26.01.2023	500	623	0,19	Cibanco S.A. Ibm 4,962 % fällig am 18.07.2029	200	228	0,07
<b>INDONESIEN</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,978 % fällig am 09.06.2024	200	254	0,08	Coca-Cola Femsa S.A.B. de C.V. 1,850 % fällig am 01.09.2032	1.300	1.304	0,39
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT 4,625 % fällig am 20.07.2023	1.200	1.296	0,39	0,980 % fällig am 09.10.2023	300	379	0,11			2.179	0,66
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Mizuho Financial Group, Inc. 0,214 % fällig am 07.10.2025	100	124	0,04	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Indonesia Government International Bond 0,900 % fällig am 14.02.2027	€ 300	374	0,11	0,956 % fällig am 16.10.2024	100	127	0,04	Mexico Government International Bond 1,350 % fällig am 18.09.2027	€ 1.600	2.026	0,61
2,150 % fällig am 18.07.2024	300	391	0,12	2,201 % fällig am 10.07.2031	\$ 1.500	1.558	0,47	Summe Mexiko		4.205	1,27
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,300 % fällig am 23.06.2025	\$ 500	524	0,16	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 0,465 % fällig am 30.05.2024	€ 400	499	0,15	<b>MULTINATIONAL</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
		1.289	0,39	0,819 % fällig am 23.07.2023	200	251	0,07	NXP BV 3,400 % fällig am 01.05.2030	\$ 900	1.023	0,31
Summe Indonesien		2.585	0,78	1,078 % fällig am 19.07.2023	\$ 100	101	0,03				
				3,202 % fällig am 17.09.2029 (e)	400	438	0,13				
				Summe Japan		5.756	1,73				
				<b>STAATSEMISSIONEN</b>							
				Development Bank of Japan, Inc. 0,010 % fällig am 15.10.2024	€ 900	1.115	0,34				

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			
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>PERU</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
Jubilee CLO BV	€ 196	\$ 238	0,07	Peru Government International Bond	PEN 400	\$ 122	0,04	Adif Alta Velocidad	€ 200	\$ 253	0,08			
0,334 % fällig am 12.07.2028				5,400 % fällig am 12.08.2034				0,550 % fällig am 30.04.2030						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>RUMÄNIEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>						
BMW Finance NV	175	217	0,06	Romania Government International Bond	€ 1.500	1.960	0,59	Autonomous Community of Madrid	100	126	0,04			
0,500 % fällig am 22.11.2022				2,625 % fällig am 02.12.2040				0,419 % fällig am 30.04.2030	500	650	0,19			
Cooperative Rabobank UA	200	250	0,07	<b>SINGAPUR</b>				1,571 % fällig am 30.04.2029	100	138	0,04			
0,250 % fällig am 30.10.2026				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Xunta de Galicia	150	186	0,06			
1,004 % fällig am 24.09.2026	\$ 1.100	1.109	0,33	Clifford Capital Pte. Ltd.	\$ 200	205	0,06	0,084 % fällig am 30.07.2027						
4,375 % fällig am 29.06.2027 (d)(e)	€ 400	543	0,16	3,423 % fällig am 15.11.2021				<b>Summe Spanien</b>			10.003	3,01		
Digital Dutch Finco BV	350	444	0,13	Flex Ltd.	100	114	0,03	<b>ÜBERNATIONAL</b>						
1,000 % fällig am 15.01.2032				4,750 % fällig am 15.06.2025				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
1,250 % fällig am 01.02.2031	200	260	0,08	Temasek Financial Ltd.	750	755	0,23	<b>EUROFIMA</b>						
Enel Finance International NV	€ 600	833	0,25	2,500 % fällig am 06.10.2070				0,000 % fällig am 28.07.2026 (b)				1.000	1.247	0,38
1,000 % fällig am 20.10.2027	€ 200	267	0,08	United Overseas Bank Ltd.	300	303	0,09	Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				\$ 100	104	0,03
1,125 % fällig am 17.10.2034	\$ 1.250	1.334	0,40	1,750 % fällig am 16.03.2031 (e)				1,500 % fällig am 13.02.2025				500	524	0,16
2,650 % fällig am 10.09.2024				<b>Summe Singapur</b>				1,625 % fällig am 27.09.2024						
Enexis Holding NV	€ 200	258	0,08	1.377				Europäische Investitionsbank				€ 650	911	0,27
0,625 % fällig am 17.06.2032				<b>SÜDKOREA</b>				0,750 % fällig am 15.11.2024						
Global Switch Finance BV	900	1.149	0,35	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Europäische Union				€ 800	1.020	0,31
1,375 % fällig am 07.10.2030				Kookmin Bank	700	714	0,22	0,000 % fällig am 04.10.2030 (b)				700	881	0,26
ING Groep NV	100	124	0,04	2,500 % fällig am 04.11.2030 (e)				0,000 % fällig am 04.07.2035 (b)				1.900	2.524	0,76
0,309 % fällig am 20.09.2023	\$ 800	814	0,24	KT Corp.	1.000	1.007	0,30	0,300 % fällig am 04.11.2050						
1,400 % fällig am 01.07.2026	800	821	0,25	1,000 % fällig am 01.09.2025	400	408	0,12	Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				2.100	2.631	0,79
4,875 % fällig am 16.05.2029 (d)(e)	800	821	0,25	NongHyup Bank	1.250	1.250	0,36	0,100 % fällig am 17.09.2035				400	488	0,15
5,750 % fällig am 16.11.2026 (d)(e)	300	326	0,10	1,250 % fällig am 20.07.2025				0,125 % fällig am 03.01.2051						
Koninklijke KPN NV	€ 200	314	0,09	Shinhan Bank Co. Ltd.	€ 100	124	0,04	<b>Summe übernational</b>				10.330	3,11	
5,000 % fällig am 18.11.2026				0,250 % fällig am 16.10.2024	AUD 800	624	0,19	<b>SCHWEDEN</b>						
LeasePlan Corp. NV	€ 100	123	0,04	1,183 % fällig am 29.09.2025	\$ 600	683	0,21	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
0,125 % fällig am 13.09.2023	800	1.020	0,31	4,000 % fällig am 23.04.2029 (e)				Svenska Handelsbanken AB				\$ 400	419	0,13
1,375 % fällig am 07.03.2024				Shinhan Financial Group Co. Ltd.	600	609	0,18	4,375 % fällig am 01.03.2027 (d)(e)				600	642	0,19
Nationale-Niederlanden Bank NV	600	751	0,23	1,350 % fällig am 10.01.2026				4,750 % fällig am 01.03.2031 (d)(e)						
0,375 % fällig am 26.02.2025				<b>Summe Südkorea</b>				<b>Summe Schweden</b>				1.061	0,32	
OI European Group BV	300	374	0,11	5.896				2.172				0,65		
2,875 % fällig am 15.02.2025				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>SCHWEIZ</b>						
Stedin Holding NV	100	126	0,04	Export-Import Bank of Korea	€ 800	985	0,30	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
0,500 % fällig am 14.11.2029				0,000 % fällig am 21.09.2023 (b)				Credit Suisse AG				€ 300	376	0,11
Stichting AK Rabobank Certificaten	200	324	0,10	Korea Housing Finance Corp.	400	494	0,15	0,450 % fällig am 19.05.2025				\$ 1.600	1.806	0,54
6,500 % (d)				0,010 % fällig am 05.02.2025				6,500 % fällig am 08.08.2023 (e)						
Vonovia Finance BV	200	259	0,08	South Korea Government International Bond	200	248	0,07	Credit Suisse Group AG				€ 100	144	0,04
1,125 % fällig am 08.09.2025				0,000 % fällig am 16.09.2025 (b)				2,125 % fällig am 12.09.2025				\$ 250	289	0,09
WPC Eurobond BV	200	256	0,08	<b>Summe Südkorea</b>				7,500 % fällig am 11.12.2023 (d)(e)				200	223	0,07
1,350 % fällig am 15.04.2028				1.727				UBS AG				600	664	0,20
		12.296	3,70	5.896				5,125 % fällig am 29.07.2026 (d)(e)				300	322	0,10
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>SPANIEN</b>				<b>THAILAND</b>						
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
Domi BV	101	124	0,04	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	200	254	0,08	Kasikornbank PCL				300	306	0,09
0,307 % fällig am 15.06.2051				0,750 % fällig am 04.06.2025				2,375 % fällig am 06.04.2022						
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>GROSSBRITANNIEN</b>						
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
BNG Bank NV	100	126	0,04	1,375 % fällig am 14.05.2025	400	520	0,16	Anglian Water Services Financing PLC				€ 200	288	0,09
0,050 % fällig am 20.11.2029				6,000 % fällig am 15.01.2026 (d)(e)	600	813	0,24	1,625 % fällig am 10.08.2025				100	158	0,05
0,500 % fällig am 26.11.2025	500	642	0,20	8,875 % fällig am 14.04.2021 (d)(e)	200	251	0,07	2,750 % fällig am 26.10.2029						
Niederländse Waterschapsbank NV	300	371	0,11	Banco de Sabadell S.A.	400	507	0,15	Barclays PLC				€ 200	248	0,07
0,000 % fällig am 02.10.2034 (b)	1.900	2.384	0,72	1,125 % fällig am 11.03.2027				0,625 % fällig am 14.11.2023				\$ 300	304	0,09
0,125 % fällig am 03.09.2035	200	308	0,09	Banco Santander S.A.	200	260	0,08	1,601 % fällig am 16.05.2024				€ 300	424	0,13
1,500 % fällig am 15.06.2039				1,125 % fällig am 23.06.2027	\$ 400	449	0,13	1,700 % fällig am 03.11.2026				300	457	0,14
		3.831	1,16	3,490 % fällig am 28.05.2030	€ 400	492	0,15	3,250 % fällig am 12.02.2027				\$ 1.000	1.080	0,33
Summe Niederlande		16.489	4,97	4,375 % fällig am 14.01.2026 (d)(e)				6,125 % fällig am 15.12.2025 (d)(e)						
<b>PANAMA</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>Summe Schweden</b>						
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2.172				0,65		
Banco General S.A.	\$ 300	340	0,10	Bankinter S.A.	1.000	1.250	0,38	<b>Summe Schweiz</b>				3.824	1,15	
4,125 % fällig am 07.08.2027				0,625 % fällig am 06.10.2027				<b>THAILAND</b>						
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>						
Panama Government International Bond	300	333	0,10	CaixaBank S.A.	800	983	0,30	Kasikornbank PCL				300	306	0,09
3,750 % fällig am 16.03.2025				0,375 % fällig am 18.11.2026	800	1.006	0,30	2,375 % fällig am 06.04.2022						
Summe Panama		673	0,20	0,750 % fällig am 10.07.2026	400	513	0,15	Anglian Water Services Financing PLC				€ 200	288	0,09
				1,750 % fällig am 24.10.2023	800	1.082	0,33	1,625 % fällig am 10.08.2025				100	158	0,05
				5,875 % fällig am 09.10.2027 (d)(e)				2,750 % fällig am 26.10.2029						
				Telefonica Emisiones S.A.	\$ 200	270	0,08	Barclays PLC				€ 200	248	0,07
				5,520 % fällig am 01.03.2049				0,625 % fällig am 14.11.2023				\$ 300	304	0,09
				<b>Summe Panama</b>				<b>Summe Schweden</b>				€ 300	424	0,13
				8.650				2,60				300	457	0,14
				<b>Summe Südkorea</b>				<b>Summe Schweiz</b>				\$ 1.000	1.080	0,33
				5.896				1,78						

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
British Telecommunications PLC 1,000 % fällig am 23.06.2024 9,625 % fällig am 15.12.2030	€ 283 \$ 40	358 66	0,11 0,02	<b>USA</b> <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> AES Corp. 1,375 % fällig am 15.01.2026 2,450 % fällig am 15.01.2031	\$ 319 \$ 1.400	322 1.420	0,10 0,43	Bush Foundation 2,754 % fällig am 01.10.2050 Campbell Soup Co. 3,950 % fällig am 15.03.2025 4,150 % fällig am 15.03.2028	\$ 250 \$ 150	266 226 177	0,08 0,07 0,05
Burberry Group PLC 1,125 % fällig am 21.09.2025	£ 500	686	0,21	Alcon Finance Corp. 3,000 % fällig am 23.09.2029	400	437	0,13	Celgene Corp. 3,550 % fällig am 15.08.2022	500	522	0,16
Chanel Ceres PLC 1,000 % fällig am 31.07.2031	€ 500	632	0,19	Alexandria Real Estate Equities, Inc. 3,800 % fällig am 15.04.2026 4,000 % fällig am 15.01.2024	400 150	461 165	0,14 0,05	Charles Schwab Corp. 4,000 % fällig am 01.12.2030 (d) 5,375 % fällig am 01.06.2025 (d)	900 1.000	952 1.116	0,29 0,34
Clarion Funding PLC 1,250 % fällig am 13.11.2032 1,875 % fällig am 22.01.2035	£ 700 200	979 296	0,29 0,09	Allegion U.S. Holding Co., Inc. 3,550 % fällig am 01.10.2027	230	252	0,08	Chubb INA Holdings, Inc. 0,875 % fällig am 15.06.2027	€ 200	258	0,08
Direct Line Insurance Group PLC 4,000 % fällig am 05.06.2032	300	481	0,14	Allstate Corp. 1,450 % fällig am 15.12.2030	400	400	0,12	Citigroup, Inc. 0,500 % fällig am 29.01.2022 0,776 % fällig am 30.10.2024	1.200 \$ 500	1.482 504	0,45 0,15
Ferguson Finance PLC 3,250 % fällig am 02.06.2030	\$ 300	335	0,10	Ally Financial, Inc. 3,875 % fällig am 21.05.2024	500	548	0,16	1,678 % fällig am 15.05.2024 2,375 % fällig am 22.05.2024 2,572 % fällig am 03.06.2031 (f)	400 € 100 \$ 2.000	412 133 2.133	0,12 0,04 0,64
Grainger PLC 3,000 % fällig am 03.07.2030 3,375 % fällig am 24.04.2028	£ 460 200	687 305	0,21 0,09	Alphabet, Inc. 1,100 % fällig am 15.08.2030 2,050 % fällig am 15.08.2050	800 200	790 191	0,24 0,06	Citizens Bank N.A. 3,750 % fällig am 18.02.2026	500	569	0,17
HSBC Holdings PLC 1,500 % fällig am 04.12.2024 1,645 % fällig am 18.04.2026 2,357 % fällig am 18.08.2031	€ 100 \$ 200 200	128 205 207	0,04 0,06 0,06	American Campus Communities Operating Partnership LP 3,750 % fällig am 15.04.2023	500	529	0,16	Clearway Energy Operating LLC 4,750 % fällig am 15.03.2028 5,000 % fällig am 15.09.2026	400 700	429 727	0,13 0,22
2,633 % fällig am 07.11.2025 3,000 % fällig am 22.07.2028 3,973 % fällig am 22.05.2030 4,600 % fällig am 17.12.2030 (d)(e)	1.200 £ 100 \$ 1.600 1.000	1.278 153 1.849 1.020	0,38 0,05 0,56 0,31	American Tower Corp. 0,500 % fällig am 15.01.2028 1,000 % fällig am 15.01.2032 1,950 % fällig am 22.05.2026 2,100 % fällig am 15.06.2030	€ 400 100 200 \$ 1.000	493 125 267 1.028	0,15 0,04 0,08 0,31	Community Preservation Corp. 2,867 % fällig am 01.02.2030 Conagra Brands, Inc. 1,375 % fällig am 01.11.2027 5,300 % fällig am 01.11.2038	1.225 600 300	1.282 606 402	0,39 0,18 0,12
Informa PLC 1,500 % fällig am 05.07.2023	€ 400	502	0,15	Amgen, Inc. 2,300 % fällig am 25.02.2031	300	321	0,10	Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 3,350 % fällig am 01.04.2030 3,950 % fällig am 01.04.2050	200 1.100	230 1.344	0,07 0,40
InterContinental Hotels Group PLC 2,125 % fällig am 24.08.2026	£ 100	140	0,04	Andrew W. Mellon Foundation 0,947 % fällig am 01.08.2027	450	450	0,14	Corporate Office Properties LP 2,250 % fällig am 15.03.2026	500	522	0,16
Legal & General Group PLC 5,625 % fällig am 24.03.2031 (d)(e)	600	913	0,28	Apple, Inc. 2,550 % fällig am 20.08.2060 2,950 % fällig am 11.09.2049 3,000 % fällig am 20.06.2027	200 50 355	206 56 398	0,06 0,02 0,12	CRH America, Inc. 5,750 % fällig am 15.01.2021	50	50	0,02
Lloyds Banking Group PLC 2,438 % fällig am 05.02.2026 3,574 % fällig am 07.11.2028 4,550 % fällig am 16.08.2028	\$ 300 200 300	317 226 362	0,10 0,07 0,11	Arizona Public Service Co. 2,650 % fällig am 15.09.2050	750	781	0,24	Crown Castle International Corp. 3,250 % fällig am 15.01.2051 4,300 % fällig am 15.02.2029 5,200 % fällig am 15.02.2049	600 1.000 100	634 1.188 136	0,19 0,36 0,04
Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	£ 1.000	1.399	0,42	AT&T, Inc. 2,600 % fällig am 19.05.2038 3,650 % fällig am 15.09.2059 3,800 % fällig am 01.12.2057 3,850 % fällig am 01.06.2060 5,100 % fällig am 25.11.2048 (f)	€ 500 \$ 9 61 500 CAD 300	728 9 64 526 288	0,22 0,00 0,02 0,16 0,09	CVS Health Corp. 1,750 % fällig am 21.08.2030 4,300 % fällig am 25.03.2028 4,780 % fällig am 25.03.2038 5,300 % fällig am 15.02.2043	200 494 150 400	201 588 190 543	0,06 0,18 0,06 0,16
London Stock Exchange Group PLC 1,750 % fällig am 19.09.2029	€ 600	816	0,25	Autodesk, Inc. 3,500 % fällig am 15.06.2027	30	34	0,01	Dell International LLC 5,300 % fällig am 01.10.2029 6,200 % fällig am 15.07.2030	500 800	613 1.041	0,18 0,31
Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	£ 1.000	1.399	0,42	Avangrid, Inc. 3,200 % fällig am 15.04.2025 3,800 % fällig am 01.06.2029	200 500	219 574	0,07 0,17	Delta Air Lines, Inc. 7,000 % fällig am 01.05.2025	200	231	0,07
National Grid Electricity Transmission PLC 0,190 % fällig am 20.01.2025	€ 300	372	0,11	Aviation Capital Group LLC 3,500 % fällig am 01.11.2027	100	100	0,03	Digital Stout Holding LLC 3,300 % fällig am 19.07.2029 3,750 % fällig am 17.10.2030	€ 100 100	159 167	0,05 0,05
Natwest Group PLC 0,750 % fällig am 15.11.2025 2,359 % fällig am 22.05.2024 4,269 % fällig am 22.03.2025 5,125 % fällig am 12.05.2027 (d)(e)	350 \$ 600 1.500 £ 400	438 625 1.660 573	0,13 0,19 0,50 0,17	Bank of America Corp. 0,981 % fällig am 25.09.2025 1,486 % fällig am 19.05.2024 2,456 % fällig am 22.10.2025	800 600 1.700	809 614 1.813	0,24 0,18 0,56	Doris Duke Charitable Foundation 2,345 % fällig am 01.07.2050 DTE Electric Co. 3,950 % fällig am 01.03.2049	\$ 400 200	388 260	0,12 0,08
Pearson Funding PLC 3,750 % fällig am 04.06.2030	500	790	0,24	Bank of New York Mellon Corp. 3,000 % fällig am 30.10.2028	400	452	0,14	Duke Energy Florida LLC 2,500 % fällig am 01.12.2029	300	328	0,10
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 1,750 % fällig am 19.05.2032	200	298	0,09	Becton Dickinson and Co. 3,794 % fällig am 20.05.2050	75	89	0,03	Duke Realty LP 2,875 % fällig am 15.11.2029	100	111	0,03
Santander UK Group Holdings PLC 3,373 % fällig am 05.01.2024 3,823 % fällig am 03.11.2028 4,750 % fällig am 15.09.2025	\$ 1.200 400 600	1.264 452 677	0,38 0,14 0,20	Blackstone Holdings Finance Co. LLC 3,500 % fällig am 10.09.2049	200	232	0,07	E*TRADE Financial Corp. 3,800 % fällig am 24.08.2027 4,500 % fällig am 20.06.2028	200 1.000	231 1.204	0,07 0,36
Santander UK PLC 4,000 % fällig am 13.03.2024	150	166	0,05	BlueHub Loan Fund, Inc. 3,099 % fällig am 01.01.2030	650	653	0,20	Ecobab, Inc. 2,125 % fällig am 15.08.2050	300	288	0,09
Severn Trent Utilities Finance PLC 2,000 % fällig am 02.06.2040	£ 300	448	0,13	BMW U.S. Capital LLC 0,625 % fällig am 20.04.2022	€ 155	192	0,06	Edwards Lifesciences Corp. 4,300 % fällig am 15.06.2028	155	184	0,06
SSE PLC 1,750 % fällig am 16.04.2030 8,375 % fällig am 20.11.2028	€ 100 £ 400	137 849	0,04 0,26	Boise Cascade Co. 4,875 % fällig am 01.07.2030	\$ 600	651	0,20	Entergy Louisiana LLC 2,900 % fällig am 15.03.2051	900	963	0,29
Swiss Re Finance UK PLC 2,714 % fällig am 04.06.2052	€ 200	274	0,08	Boston Properties LP 3,400 % fällig am 21.06.2029	200	224	0,07	Equinix, Inc. 1,550 % fällig am 15.03.2028	900	916	0,28
Tesco Corporate Treasury Services PLC 1,375 % fällig am 24.10.2023 2,500 % fällig am 01.07.2024 2,750 % fällig am 27.04.2030	300 200 £ 500	381 265 760	0,11 0,08 0,23	Brambles USA, Inc. 4,125 % fällig am 23.10.2025	50	56	0,02	Equitable Holdings, Inc. 4,350 % fällig am 20.04.2028	1.100	1.301	0,39
Travis Perkins PLC 3,750 % fällig am 17.02.2026	500	712	0,21	Brandywine Operating Partnership LP 4,550 % fällig am 01.10.2029	100	113	0,03	ERP Operating LP 4,150 % fällig am 01.12.2028	100	119	0,04
Tritax Big Box REIT PLC 1,500 % fällig am 27.11.2033	400	567	0,17	Bristol-Myers Squibb Co. 2,550 % fällig am 13.11.2050	900	922	0,28				
Vodafone Group PLC 2,500 % fällig am 24.05.2039	€ 300	448	0,13								
<b>Summe Großbritannien</b>		<b>29.455</b>	<b>8,87</b>								



# Aufstellung der Wertpapieranlagen 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
4,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 4.800	\$ 5.127	1,54	U.S. Treasury Notes			
		23.053	6,94	0,375 % fällig am 30.11.2025 (h)	\$ 21.200	\$ 21.231	6,40
				0,625 % fällig am 15.05.2030	1.300	1.271	0,38
				0,625 % fällig am 15.08.2030	7.500	7.314	2,20
				1,500 % fällig am 15.02.2030 (h)	3.100	3.280	0,99
				U.S. Treasury STRIPS			
				0,000 % fällig am 15.05.2049 (b)	300	187	0,06
						46.371	13,97
				Summe USA		175.606	52,90
				Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 366.476	110,39

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
SSB	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 111	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021	\$ (113)	\$ 111	\$ 111	0,03
Total Repurchase Agreements						\$ (113)	\$ 111	\$ 111	0,03

<sup>(1)</sup> 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 March Futures	Short	03.2021	1	\$ (1)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	3	2	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	118	(8)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	28	(15)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2021	25	(6)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	138	33	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	267	(81)	(0,02)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	6	(8)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2021	3	6	0,00
				\$ (78)	(0,03)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	\$ 169,000	22.01.2021	4	\$ (3)	\$ (1)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	170,000	22.01.2021	1	(1)	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	171,000	22.01.2021	4	(4)	(3)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	177,000	22.01.2021	1	(1)	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	178,000	22.01.2021	4	(3)	(1)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	179,000	22.01.2021	4	(2)	(1)	0,00
				\$ (14)	\$ (6)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (84)	(0,03)

## 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Koninklijke KPN NV	(1,000) %	20.12.2023	€ 200	\$ (8)	0,00

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

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.06.2024	\$ 300	\$ 9	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	800	21	0,01
				\$ 30	0,01

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,865 %	03.01.2022	BRL 100	\$ 0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	900	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,880	03.01.2022	2.700	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,883	03.01.2022	3.100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,300	03.01.2022	6.800	8	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 600	11	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	1.100	19	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,270	03.03.2022	1.300	12	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,273	03.03.2022	200	2	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025	600	12	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	300	6	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,290	03.03.2025	200	4	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2022	400	3	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	500	31	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,970	10.09.2050	\$ 300	(31)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,990	01.09.2050	200	(19)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,185	23.10.2050	400	(19)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,214	13.10.2050	300	(11)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	27.10.2050	400	(13)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,400	04.01.2051	400	6	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,465	03.03.2030	400	(24)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,520	05.02.2025	100	(5)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,620	25.02.2030	200	(14)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,660	12.02.2030	100	(8)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,660	18.02.2030	200	(15)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,760	03.02.2030	300	(26)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,860	21.08.2029	200	(19)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,873	27.08.2029	200	(19)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,940	20.08.2029	200	(20)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,960	14.08.2029	100	(10)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,050	19.06.2024	200	(12)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,060	21.06.2024	200	(12)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,080	20.06.2024	200	(12)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,100	18.06.2024	200	(13)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,160	12.06.2024	200	(13)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,190	11.06.2024	200	(13)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,210	04.06.2024	200	(13)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,220	30.05.2024	200	(13)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	30.05.2024	200	(14)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,270	06.06.2024	200	(14)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,290	05.06.2024	200	(14)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,320	21.05.2024	200	(14)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,330	20.05.2024	100	(7)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2029	1.350	(228)	(0,07)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,600	15.12.2050	€ 1.600	11	0,00
					\$ (520)	(0,16)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (498)	(0,15)

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit ESG 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

### VERKAUFSOPTIONEN

### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,012 %	14.01.2021	400	\$ (3)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,015	14.01.2021	400	(3)	(2)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,830	22.01.2021	700	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,070	22.01.2021	700	(3)	(1)	0,00
JPM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,100	19.01.2021	400	(5)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,460	19.01.2021	400	(5)	(4)	(0,01)
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,210	04.01.2021	400	(2)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,510	04.01.2021	400	(2)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,280	11.01.2021	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,580	11.01.2021	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,110	15.01.2021	400	(4)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,450	15.01.2021	400	(4)	(4)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,131	19.01.2021	400	(4)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,491	19.01.2021	400	(5)	(3)	0,00
NGF	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,270	07.01.2021	500	(4)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,570	07.01.2021	500	(4)	0	0,00
							\$ (53)	\$ (17)	(0,01)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens	
CBK	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 400	\$ (17)	\$ 9	\$ (8)	0,00	
GST	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	125	(6)	4	(2)	0,00	
						\$ (23)	\$ 13	\$ (10)	0,00

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	02.2021	£ 4.503	\$ 5.940	\$ 0	\$ (217)	\$ (217)	(0,06)
	02.2021	SEK 9.035	1.043	0	(58)	(58)	(0,02)
BPS	01.2021	€ 2.891	3.514	1	(25)	(24)	(0,01)
	01.2021	\$ 1.081	€ 887	4	0	4	0,00
BRC	02.2021	AUD 6.052	\$ 4.386	0	(286)	(286)	(0,09)
	02.2021	£ 361	482	0	(11)	(11)	0,00
CBK	01.2021	€ 688	826	0	(16)	(16)	0,00
	01.2021	\$ 265	€ 220	4	0	4	0,00
GLM	02.2021	PEN 167	\$ 46	0	0	0	0,00
	05.2021	224	61	0	0	0	0,00
	02.2021	AUD 2.215	1.622	0	(88)	(88)	(0,03)
HUS	01.2021	€ 7.001	8.473	0	(94)	(94)	(0,03)
	02.2021	CAD 2.041	1.558	0	(44)	(44)	(0,01)
	02.2021	£ 989	1.315	0	(38)	(38)	(0,01)
MYI	02.2021	\$ 1.778	¥ 186.580	30	0	30	0,01
	01.2021	CHF 236	\$ 268	0	0	0	0,00
	01.2021	€ 309	379	1	0	1	0,00
	01.2021	£ 465	632	0	(4)	(4)	0,00
SCX	01.2021	\$ 50	£ 36	0	0	0	0,00
	01.2021	€ 75.271	\$ 90.144	0	(1.954)	(1.954)	(0,59)
	02.2021	75.271	92.160	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	£ 5.348	7.143	0	(170)	(170)	(0,05)
				\$ 40	\$ (3.006)	\$ (2.966)	(0,89)

## ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilklassen 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	01.2021	\$ 17.925	CHF 16.180	\$ 381	\$ (1)	\$ 380	0,12
BPS	01.2021	210	185	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01.2021	78	69	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	108	96	0	0	0	0,00
GLM	01.2021	4	4	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	19.672	17.807	475	0	475	0,14
SCX	01.2021	4.115	3.718	92	0	92	0,03
SSB	01.2021	19.416	17.496	380	0	380	0,11
UAG	01.2021	726	643	1	0	1	0,00
				\$ 1.329	\$ (2)	\$ 1.327	0,40

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	€ 47	\$ 57	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2021	78	96	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 29.373	€ 24.509	616	(1)	615	0,19
	02.2021	34.081	27.835	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	25.327	21.142	541	0	541	0,16
CBK	01.2021	1.410	1.172	24	0	24	0,01
HUS	01.2021	3.969	3.292	60	0	60	0,02
JPM	01.2021	4.350	3.562	9	0	9	0,00
MYI	01.2021	878	720	3	0	3	0,00
SCX	01.2021	29.841	24.917	647	0	647	0,19
	02.2021	50.722	41.426	0	0	0	0,00
				\$ 1.900	\$ (1)	\$ 1.899	0,57

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilklassen 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 Nettovermögens
BPS	01.2021	\$ 462	£ 345	\$ 10	\$ 0	\$ 10	0,00
BRC	01.2021	162	119	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	6.707	5.014	146	0	146	0,05
HUS	01.2021	8.529	6.369	178	0	178	0,05
MYI	01.2021	10.679	7.934	166	0	166	0,05
SCX	01.2021	202	152	5	0	5	0,00
SSB	01.2021	7.301	5.470	176	0	176	0,05
				\$ 682	\$ 0	\$ 682	0,20

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilklasse 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	01.2021	SEK 338	\$ 40	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2021	\$ 236	SEK 1.983	6	0	6	0,00
BPS	01.2021	SEK 561	\$ 66	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 116	SEK 953	0	0	0	0,00
BRC	01.2021	13.652	115.167	372	0	372	0,11
CBK	01.2021	19	159	1	0	1	0,00
GLM	01.2021	SEK 240	\$ 29	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	\$ 13.486	SEK 114.732	485	0	485	0,15
SCX	01.2021	SEK 2.370	\$ 283	0	(7)	(7)	0,00
	01.2021	\$ 13.610	SEK 115.546	460	0	460	0,14
SSB	01.2021	SEK 44	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 39	SEK 331	1	0	1	0,00
UAG	01.2021	18	153	0	0	0	0,00
				\$ 1.325	\$ (10)	\$ 1.315	0,40

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 2.230 0,67

Summe Anlagen

\$ 368.235 110,91

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (36.225) (10,91)

Nettovermögen

\$ 332.010 100,00

**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) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	5,100 %	25.11.2048	09.04.2019	\$ 230	\$ 288	0,09
Citigroup, Inc.	2,572	03.06.2031	26.05.2020 - 08.09.2020	2.097	2.133	0,64
Deutsche Bank AG	2,129	24.11.2026	17.11.2020	1.000	1.024	0,31
Export-Import Bank of India	1,271	28.03.2022	19.12.2019	199	201	0,06
				<b>\$ 3.526</b>	<b>\$ 3.646</b>	<b>1,10</b>

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.286 als Sicherheiten verpfändet.

(h) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 18.728 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 2.338 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 1.150 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(84)	1.732	0	1.648
<b>Summen</b>	<b>\$ (84)</b>	<b>\$ 368.319</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 368.235</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 88.325	\$ 0	\$ 88.325
Pensionsgeschäfte	0	1.600	0	1.600
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	8	593	0	601
<b>Summen</b>	<b>\$ 8</b>	<b>\$ 90.518</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 90.526</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	0,100 %	30.12.2020	04.01.2021	\$ (1.276)	\$ (1.276)	(0,38)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (1.276)</b>	<b>(0,38)</b>

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOS	0,130 %	30.12.2020	27.01.2021	\$ (505)	\$ (505)	(0,15)
BPG	0,170	02.11.2020	05.01.2021	(2.009)	(2.009)	(0,61)
	0,190	30.10.2020	29.01.2021	(559)	(559)	(0,17)
MSC	0,070	14.12.2020	14.01.2021	(12.294)	(12.295)	(3,70)
	0,140	14.12.2020	15.01.2021	(3.290)	(3.290)	(0,99)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (18.658)</b>	<b>(5,62)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 110	\$ (60)	\$ 50
BPS	316	(240)	76
BRC	903	(1.080)	(177)
CBK	148	0	148
GLM	(91)	0	(91)
GST	(2)	0	(2)
HUS	577	(400)	177
JPM	5	10	15
MYC	(7)	0	(7)
MYI	641	(370)	271
SCX	(928)	1.140	212
SSB	557	(510)	47
UAG	1	0	1

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,03	81,11
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	25,73	24,29
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,63	k. A.
Pensionsgeschäfte	0,03	1,91
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,15)	(0,22)
Freiverkehrfinanzderivate	0,67	0,93
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,38)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(5,62)	(1,52)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Australien	2,29	2,73
Osterreich	0,22	k. A.
Belgien	0,74	0,86
Bermuda	0,07	k. A.
Brasilien	0,54	0,28
Kanada	1,24	1,12
Cayman-Inseln	0,30	0,65
Chile	0,74	0,91
China	0,71	1,68
Kolumbien	k. A.	0,26
Kroatien	0,12	k. A.
Dänemark	0,07	0,25
Dominikanische Republik	0,20	k. A.
Ägypten	0,26	k. A.
Finnland	1,61	k. A.
Frankreich	3,90	3,94
Deutschland	6,99	1,48
Guernsey, Kanalinseln	0,39	0,43
Hongkong	0,84	0,24
Indien	0,73	1,76
Indonesien	0,78	0,81
Irland	0,49	1,84
Insel Man	0,24	k. A.
Italien	2,34	1,91
Japan	2,22	4,01
Jersey, Kanalinseln	0,12	k. A.
Luxemburg	2,28	1,82
Malaysia	0,21	k. A.
Mauritius	0,40	0,97
Mexiko	1,27	0,50
Multinational	0,31	k. A.
Niederlande	4,97	9,10
Panama	0,20	0,76
Peru	0,04	0,15
Rumänien	0,59	k. A.
Singapur	0,41	0,93
Südkorea	1,78	0,64
Spanien	3,01	2,88
Supranational	3,11	1,61
Schweden	0,65	k. A.
Schweiz	1,15	2,71
Thailand	0,09	0,36
Großbritannien	8,87	7,04

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
USA	52,90	50,77
Pensionsgeschäfte	0,03	1,91
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,03)	0,01
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,03
Zinsswaps	(0,16)	(0,24)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,89)	(0,52)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,57	1,47
Sonstige Aktiva und Passiva	(10,91)	(8,03)
Nettovermögen	100,00	100,00



# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Libor Plus 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
3,250 % fällig am 13.11.2028	€ 2.000	\$ 2.885	0,11	SL Green Operating Partnership LP	\$ 1.000	\$ 998	0,04	AutoNation, Inc.	\$ 400	\$ 400	0,02
Mid-America Apartments LP				1,201 % fällig am 16.08.2021				3,350 % fällig am 15.01.2021			
3,600 % fällig am 01.06.2027	\$ 600	680	0,03	Stichting AK Rabobank Certificaten	€ 683	1.110	0,04	B.C. Unlimited Liability Co.	362	370	0,01
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				6,500 % (f)				4,250 % fällig am 15.05.2024			
0,339 % fällig am 19.07.2024	€ 1.600	1.986	0,08	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 3.100	3.237	0,12	Bacardi Ltd.	€ 2.400	3.091	0,12
Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd.				2,130 % fällig am 08.07.2030				2,750 % fällig am 03.07.2023			
2,652 % fällig am 19.09.2022	\$ 2.500	2.578	0,10	TP ICAP PLC	£ 700	1.050	0,04	Bayer U.S. Finance LLC	\$ 300	305	0,01
3,406 % fällig am 28.02.2022	1.900	1.955	0,07	5,250 % fällig am 26.01.2024	£ 1.400	2.175	0,08	3,000 % fällig am 08.10.2021			
3,960 % fällig am 19.09.2023	1.600	1.729	0,07	5,250 % fällig am 29.05.2026				BMW U.S. Capital LLC	1.300	1.312	0,05
Mizuho Financial Group, Inc.				U.S. Bank N.A.	\$ 2.400	2.580	0,10	1,850 % fällig am 15.09.2021	1.000	1.019	0,04
1,360 % fällig am 13.09.2021	400	403	0,02	3,400 % fällig am 24.07.2023				3,400 % fällig am 13.08.2021			
3,477 % fällig am 12.04.2026	6.100	6.841	0,26	UBS AG	€ 900	1.108	0,04	Boeing Co.	4.100	4.314	0,16
Morgan Stanley				4,750 % fällig am 12.02.2026 (h)	€ 100	110	0,00	2,750 % fällig am 01.02.2026			
0,919 % fällig am 10.06.2022	2.500	2.507	0,09	5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)	\$ 100	110	0,00	Boral Finance Pty. Ltd.	100	102	0,00
1,615 % fällig am 24.10.2023	300	306	0,01	7,625 % fällig am 17.08.2022 (h)	\$ 1.550	1.716	0,06	3,000 % fällig am 01.11.2022			
Nationwide Building Society				UBS Group AG	2.800	2.904	0,11	Boston Scientific Corp.	1.200	1.301	0,05
1,000 % fällig am 24.01.2023	£ 2.900	4.022	0,15	2,859 % fällig am 15.08.2023				3,450 % fällig am 01.03.2024			
3,766 % fällig am 08.03.2024	\$ 1.100	1.171	0,04	Unicredit SpA	2.200	2.262	0,09	British Airways Pass-Through Trust	300	322	0,01
4,302 % fällig am 08.03.2029	2.000	2.327	0,09	4,129 % fällig am 14.01.2022	€ 700	903	0,03	4,250 % fällig am 15.05.2034			
NatWest Group PLC				6,625 % fällig am 03.06.2023 (f)(h)	€ 1.800	2.563	0,10	Campbell Soup Co.	400	402	0,02
1,691 % fällig am 15.05.2023	200	202	0,01	7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h)	\$ 1.800	2.563	0,10	3,300 % fällig am 15.03.2021			
1,801 % fällig am 25.06.2024	400	407	0,02	7,830 % fällig am 04.12.2023	€ 3.150	3.740	0,14	Cargo Aircraft Management, Inc.	600	620	0,02
2,000 % fällig am 04.03.2025	€ 4.300	5.562	0,21	9,250 % fällig am 03.06.2022 (f)(h)	€ 1.400	1.883	0,07	Central Japan Railway Co.	400	428	0,02
4,519 % fällig am 25.06.2024	\$ 200	218	0,01	Unipol Gruppo SpA	2.400	3.114	0,12	3,400 % fällig am 06.09.2023			
4,800 % fällig am 05.04.2026	700	828	0,03	3,250 % fällig am 23.09.2030				Central Nippon Expressway Co. Ltd.	600	616	0,02
4,892 % fällig am 18.05.2029	700	842	0,03	UNIQA Insurance Group AG	1.700	2.270	0,09	2,849 % fällig am 03.03.2022			
8,000 % fällig am 10.08.2025 (f)(h)	300	350	0,01	1,375 % fällig am 09.07.2030	£ 57	82	0,00	Chanel Ceres PLC	€ 1.300	1.615	0,06
8,625 % fällig am 15.08.2021 (f)(h)	2.900	3.016	0,11	VEREIT Operating Partnership LP	\$ 3.000	3.405	0,13	1,000 % fällig am 31.07.2026	2.100	2.653	0,10
8,625 % fällig am 15.08.2021 (f)	200	208	0,01	3,950 % fällig am 15.08.2027				Cheniere Corpus Christi Holdings LLC	\$ 20	23	0,00
NatWest Markets PLC				VICI Properties LP	1.200	1.230	0,05	5,875 % fällig am 31.03.2025			
0,625 % fällig am 02.03.2022	€ 300	370	0,01	3,500 % fällig am 15.02.2025				Cigna Corp.	300	304	0,01
1,000 % fällig am 28.05.2024	3.300	4.177	0,16	Virgin Money UK PLC	£ 300	449	0,02	1,127 % fällig am 15.07.2023			
NE Property BV				4,000 % fällig am 25.09.2026	£ 300	449	0,02	Constellation Brands, Inc.	1.000	1.040	0,04
1,875 % fällig am 09.10.2026	3.100	3.817	0,14	Volkswagen Financial Services NV	3.100	4.281	0,16	2,650 % fällig am 07.11.2022			
Next SpA				1,125 % fällig am 18.09.2023	1.200	1.674	0,06	Constellation Oil Services Holding S.A. (10,000 % PIK)	1.393	358	0,01
1,750 % fällig am 31.10.2024	800	994	0,04	1,625 % fällig am 30.11.2022	1.100	1.544	0,06	10,000 % fällig am 09.11.2024 (b)			
Nissan Motor Acceptance Corp.				1,875 % fällig am 03.12.2024	2.000	2.840	0,11	Cornerstone Building Brands, Inc.	700	738	0,03
0,869 % fällig am 21.09.2021	\$ 700	698	0,03	Wells Fargo & Co.	\$ 100	100	0,00	8,000 % fällig am 15.04.2026			
1,900 % fällig am 14.09.2021	300	302	0,01	1,144 % fällig am 11.02.2022	2.600	2.642	0,10	D.R. Horton, Inc.	300	317	0,01
2,600 % fällig am 28.09.2022	800	821	0,03	1,444 % fällig am 31.10.2023				DAE Funding LLC	650	667	0,03
2,650 % fällig am 13.07.2022	1.200	1.229	0,05	Wells Fargo Bank N.A.	2.500	2.701	0,10	5,000 % fällig am 01.08.2024			
2,650 % fällig am 13.07.2022	1.200	1.229	0,05	3,550 % fällig am 14.08.2023				Danone S.A.	3.800	3.847	0,15
3,150 % fällig am 15.03.2021	1.400	1.406	0,05					2,077 % fällig am 02.11.2021			
Nova Ljubljanska Banka d.d.								Dell International LLC	2.300	2.545	0,10
3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 2.400	2.665	0,10					5,450 % fällig am 15.06.2023	700	841	0,03
3,650 % fällig am 19.11.2029	1.400	1.584	0,06					5,850 % fällig am 15.07.2025			
OneMain Finance Corp.								Delta Air Lines Pass-Through Trust	110	113	0,00
5,625 % fällig am 15.03.2023	\$ 50	54	0,00					6,821 % fällig am 10.02.2024			
6,125 % fällig am 15.03.2024	1.150	1.258	0,05					Discovery Communications LLC	€ 100	144	0,01
Oxford Finance LLC								2,500 % fällig am 20.09.2024			
6,375 % fällig am 15.12.2022	400	400	0,02					eBay, Inc.	\$ 600	629	0,02
Park Aerospace Holdings Ltd.								2,750 % fällig am 30.01.2023			
3,625 % fällig am 15.03.2021	500	501	0,02					Enbridge, Inc.	6.000	6.004	0,23
5,250 % fällig am 15.08.2022	151	159	0,01					0,720 % fällig am 18.02.2022			
Piper Sandler Cos.								Energy Transfer Partners LP	200	212	0,01
5,200 % fällig am 15.10.2023	1.600	1.600	0,06					5,875 % fällig am 01.03.2022	60	63	0,00
Places For People Treasury PLC								EQT Corp.	1.800	2.052	0,08
2,875 % fällig am 17.08.2026	£ 100	150	0,01					7,875 % fällig am 01.02.2025			
Protective Life Global Funding								Equifax, Inc.	700	702	0,03
3,104 % fällig am 15.04.2024	\$ 5.000	5.396	0,20					ERAC USA Finance LLC	100	102	0,00
QNB Finance Ltd.								2,600 % fällig am 01.12.2021	200	205	0,01
1,310 % fällig am 12.02.2022	10.000	10.038	0,37					4,500 % fällig am 16.08.2021			
Sagax AB								Exela Intermedate LLC	300	92	0,00
1,125 % fällig am 30.01.2027	€ 1.700	2.112	0,08					10,000 % fällig am 15.07.2023			
2,250 % fällig am 13.03.2025	2.900	3.786	0,14					Expedia Group, Inc.	1.200	1.392	0,05
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB								7,000 % fällig am 01.05.2025	3.200	3.529	0,13
1,125 % fällig am 04.09.2026	1.500	1.894	0,07					Gap, Inc.	1.200	1.340	0,05
1,750 % fällig am 14.01.2025	1.300	1.674	0,06					8,625 % fällig am 15.05.2025	1.000	1.161	0,04
Santander Holdings USA, Inc.								8,875 % fällig am 15.05.2027			
3,244 % fällig am 05.10.2026	\$ 100	109	0,00								
Santander UK Group Holdings PLC											
0,309 % fällig am 27.03.2024	€ 2.600	3.200	0,12								
2,875 % fällig am 05.08.2021	\$ 2.700	2.739	0,10								
3,625 % fällig am 14.01.2026	£ 300	461	0,02								
3,823 % fällig am 03.11.2028	\$ 300	339	0,01								
4,796 % fällig am 15.11.2024	5.000	5.563	0,21								
7,375 % fällig am 24.06.2022 (f)(h)	£ 400	573	0,02								
SBA Communications Corp.											
3,875 % fällig am 15.02.2027	\$ 1.400	1.472	0,06								

### INDUSTRIEWERTE

419.759 15,86

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
GATX Corp. 0,945 % fällig am 05.11.2021	\$	3.000	0,11	Ryder System, Inc. 2,500 % fällig am 01.09.2022	\$	500	0,02	YPF S.A. 36,259 % fällig am 04.03.2021	ARS	3.240	0,00
4,850 % fällig am 01.06.2021		650	0,03	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,000 % fällig am 15.03.2027		500	0,02	Ziggo BV 4,875 % fällig am 15.01.2030	\$	4.700	0,19
General Electric Co. 3,450 % fällig am 01.05.2027		600	0,03	5,750 % fällig am 15.05.2024		200	0,01				
5,625 % fällig am 16.09.2031	£	200	0,01	5,875 % fällig am 30.06.2026		2.500	0,11			181.191	6,85
Greene King Finance PLC 1,843 % fällig am 15.12.2034		100	0,00	Sands China Ltd. 4,600 % fällig am 08.08.2023		1.900	0,08	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
5,318 % fällig am 15.09.2031		383	0,02	Sarens Finance Co. NV 5,750 % fällig am 21.02.2027	€	3.100	0,13	AT&T, Inc. 2,875 % fällig am 02.03.2025 (f)	€	1.600	0,07
Hasbro, Inc. 2,600 % fällig am 19.11.2022	\$	2.800	0,11	Scripps Escrow, Inc. 3,875 % fällig am 15.01.2029	\$	1.000	0,04	3,650 % fällig am 15.09.2059	\$	185	0,01
Hewlett Packard Enterprise Co. 0,958 % fällig am 05.10.2021		700	0,03	Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	€	1.300	0,06	Baltimore Gas & Electric Co. 3,500 % fällig am 15.11.2021		200	0,01
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,750 % fällig am 01.05.2029		6.500	0,26	Southern Co. 3,700 % fällig am 30.04.2030	\$	800	0,04	BG Energy Capital PLC 4,000 % fällig am 15.10.2021		300	0,01
5,125 % fällig am 01.05.2026		1.400	0,05	Southwest Airlines Co. 5,250 % fällig am 15.05.2025		1.200	0,05	British Telecommunications PLC 4,500 % fällig am 04.12.2023		200	0,01
Huntsman International LLC 5,125 % fällig am 15.11.2022		700	0,03	Spirit AeroSystems, Inc. 4,600 % fällig am 15.06.2028		1.100	0,04	British Transco International Finance BV 0,000 % fällig am 04.11.2021 (c)		300	0,01
Imperial Brands Finance PLC 3,750 % fällig am 21.07.2022		2.800	0,11	Sprint Spectrum Co. LLC 3,360 % fällig am 20.03.2023		131	0,01	CenturyLink, Inc. 4,000 % fällig am 15.02.2027		300	0,01
4,250 % fällig am 21.07.2025		200	0,01	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€	2.200	0,10	DTE Electric Co. 2,625 % fällig am 01.03.2031		1.200	0,05
5,500 % fällig am 28.09.2026	£	600	0,04	Sunoco Logistics Partners Operations LP 5,300 % fällig am 01.04.2044	\$	500	0,02	Electricite de France S.A. 3,000 % fällig am 03.09.2027 (f)	€	800	0,04
INEOS Styrolution Group GmbH 2,250 % fällig am 16.01.2027	€	4.500	0,20	Syngenta Finance NV 3,125 % fällig am 28.03.2022		200	0,01	Emera U.S. Finance LP 2,700 % fällig am 15.06.2021	\$	500	0,02
Informa PLC 1,250 % fällig am 22.04.2028		3.000	0,14	3,375 % fällig am 16.04.2026	€	1.800	0,09	Enel Finance International NV 3,625 % fällig am 25.05.2027		200	0,01
1,500 % fällig am 05.07.2023		400	0,02	T-Mobile USA, Inc. 2,250 % fällig am 15.11.2031	\$	2.500	0,10	Eutelsat S.A. 2,250 % fällig am 13.07.2027	€	3.000	0,15
InterContinental Hotels Group PLC 1,625 % fällig am 08.10.2024		2.300	0,11	2,875 % fällig am 15.04.2030		2.100	0,09	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 3,250 % fällig am 25.02.2030	\$	2.500	0,10
2,125 % fällig am 24.08.2026	£	200	0,01	Teleperformance 1,500 % fällig am 03.04.2024	€	1.000	0,05	London Power Networks PLC 2,625 % fällig am 01.03.2029	£	1.500	0,09
2,125 % fällig am 15.05.2027	€	700	0,03	Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,875 % fällig am 29.05.2026		2.000	0,10	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 0,927 % fällig am 25.02.2022	\$	400	0,02
3,375 % fällig am 08.10.2028	£	1.300	0,07	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 3,650 % fällig am 10.11.2021	\$	100	0,00	1,950 % fällig am 01.09.2022		400	0,02
John Lewis PLC 6,125 % fällig am 21.01.2025		350	0,02	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 2,200 % fällig am 21.07.2021		208	0,01	2,750 % fällig am 01.11.2029		800	0,03
Kansas City Southern 3,125 % fällig am 01.06.2026	\$	200	0,01	Time Warner Cable LLC 4,000 % fällig am 01.09.2021		300	0,04	3,625 % fällig am 15.06.2023		1.300	0,05
Kinder Morgan, Inc. 5,000 % fällig am 15.02.2021		100	0,00	Toyota Industries Corp. 3,110 % fällig am 12.03.2022		2.200	0,09	ONEOK, Inc. 4,000 % fällig am 13.07.2027		3.000	0,13
Komatsu Finance America, Inc. 2,437 % fällig am 11.09.2022		1.000	0,04	Toyota Tsusho Corp. 3,625 % fällig am 13.09.2023		1.000	0,04	4,350 % fällig am 15.03.2029		2.000	0,09
Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	£	2.000	0,11	TransCanada PipeLines Ltd. 9,875 % fällig am 01.01.2021		300	0,01	Pacific Gas & Electric Co. 3,150 % fällig am 01.01.2026		1.300	0,05
4,250 % fällig am 08.12.2023		100	0,01	Transocean, Inc. 7,250 % fällig am 01.11.2025		700	0,03	3,450 % fällig am 01.07.2025		200	0,01
Marriott International, Inc. 3,500 % fällig am 15.10.2032	\$	1.100	0,05	Travis Perkins PLC 3,750 % fällig am 17.02.2026	£	400	0,02	3,500 % fällig am 15.06.2025 ^		600	0,02
Microchip Technology, Inc. 3,922 % fällig am 01.06.2021		600	0,02	Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	€	1.000	0,05	3,950 % fällig am 01.12.2047 ^		200	0,01
Mitchells & Butlers Finance PLC 0,667 % fällig am 15.12.2030		161	0,01	UCB S.A. 1,875 % fällig am 02.04.2022		700	0,03	4,000 % fällig am 01.12.2046 ^		300	0,01
6,013 % fällig am 15.12.2030	£	1.597	0,09	Unigel Luxembourg S.A. 8,750 % fällig am 01.10.2026	\$	200	0,01	PECO Energy Co. 1,700 % fällig am 15.09.2021		900	0,03
6,469 % fällig am 15.09.2032		400	0,02	United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.04.2029		2.000	0,08	Petrobras Global Finance BV 5,299 % fällig am 27.01.2025		106	0,00
National Express Group PLC 2,375 % fällig am 20.11.2028		1.000	0,05	ViaSat, Inc. 5,625 % fällig am 15.09.2025		300	0,01	5,375 % fällig am 01.10.2029	£	3.300	0,20
Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	€	1.000	0,05	Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£	3.300	0,18	6,250 % fällig am 14.12.2026		1.323	0,08
4,345 % fällig am 17.09.2027	\$	4.500	0,19	VMware, Inc. 3,900 % fällig am 21.08.2027	\$	900	0,04	6,850 % fällig am 05.06.2115	\$	300	0,01
Pan American Energy LLC 38,606 % fällig am 26.02.2021	ARS	6.957	0,00	Volkswagen Group of America Finance LLC 3,350 % fällig am 13.05.2025		1.500	0,06	Public Service Enterprise Group, Inc. 2,650 % fällig am 15.11.2022		800	0,03
Penske Truck Leasing Co. LP 3,300 % fällig am 01.04.2021	\$	500	0,02	4,000 % fällig am 12.11.2021		700	0,03	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028		490	0,02
3,375 % fällig am 01.02.2022		1.400	0,05	Vulcan Materials Co. 0,875 % fällig am 01.03.2021		200	0,01	9,250 % fällig am 06.07.2024		463	0,02
3,950 % fällig am 10.03.2025		800	0,03	West Street Merger Sub, Inc. 6,375 % fällig am 01.09.2025		250	0,01	9,750 % fällig am 06.01.2027		156	0,01
Petroleos Mexicanos 5,950 % fällig am 28.01.2031		200	0,01	Western Digital Corp. 4,750 % fällig am 15.02.2026		700	0,03	Sempra Energy 0,667 % fällig am 15.03.2021		650	0,02
6,840 % fällig am 23.01.2030		1.700	0,07					2,900 % fällig am 01.02.2023		700	0,03
Petronas Capital Ltd. 3,500 % fällig am 21.04.2030		2.400	0,10					Sprint Corp. 7,250 % fällig am 15.09.2021		200	0,01
RAC Bond Co. PLC 4,565 % fällig am 06.05.2046	£	100	0,01					7,625 % fällig am 01.03.2026		800	0,04
RCS & RDS S.A. 2,500 % fällig am 05.02.2025	€	700	0,03					Systems Energy Resources, Inc. 2,140 % fällig am 09.12.2025		700	0,03
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 0,798 % fällig am 24.06.2022	\$	800	0,03					Telstra Corp. Ltd. 4,800 % fällig am 12.10.2021		100	0,00
Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€	1.000	0,05							41.225	1,56
5,750 % fällig am 15.10.2027	£	700	0,04					Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		642.175	24,27



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
RESIMAC Bastille Trust 1,003 % fällig am 05.12.2059	\$ 306	\$ 305	0,01	Babson Euro CLO BV 0,309 % fällig am 25.10.2029	€ 2.720	\$ 3.305	0,13	GE-WMC Mortgage Securities Trust 0,298 % fällig am 25.08.2036	\$ 6.117	\$ 3.872	0,15
Ribbon Finance PLC 0,828 % fällig am 20.04.2028	£ 240	319	0,01	Barings Euro CLO BV 0,680 % fällig am 27.07.2030	569	696	0,03	Greystone Commercial Real Estate Notes 1,339 % fällig am 15.09.2037	5.000	4.963	0,19
Ripon Mortgages PLC 0,851 % fällig am 20.08.2056	2.149	2.936	0,11	Bayview Financial Acquisition Trust 6,096 % fällig am 28.12.2036	1.953	2.047	0,08	GSAA Home Equity Trust 5,772 % fällig am 25.11.2036 ^	557	238	0,01
RMAC PLC 0,741 % fällig am 12.06.2046	217	294	0,01	BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	€ 2.754	3.375	0,13	5,985 % fällig am 25.06.2036	1.549	634	0,02
1,011 % fällig am 12.06.2046	301	411	0,02	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 0,378 % fällig am 25.02.2037	\$ 2.756	2.466	0,09	GSAMP Trust 0,288 % fällig am 25.11.2036	2.339	1.446	0,05
RMAC Securities PLC 0,191 % fällig am 12.06.2044	60	79	0,00	0,778 % fällig am 25.02.2036	2.372	2.348	0,09	0,408 % fällig am 25.02.2046	813	776	0,03
Rochester Financing PLC 1,337 % fällig am 18.06.2045	137	188	0,01	0,793 % fällig am 25.12.2035	415	415	0,02	Halcyon Loan Advisors Funding Ltd. 1,138 % fällig am 20.04.2027	261	260	0,01
Silverstone Master Issuer PLC 0,779 % fällig am 21.01.2070	\$ 576	577	0,02	1,003 % fällig am 25.07.2034	2.000	1.965	0,07	HSI Asset Securitization Corp. Trust 0,928 % fällig am 25.01.2036	2.200	2.043	0,08
0,806 % fällig am 21.01.2070	£ 2.046	2.824	0,11	1,168 % fällig am 25.10.2035	679	670	0,03	Jamestown CLO Ltd. 0,927 % fällig am 15.07.2026	46	47	0,00
Stanington PLC 1,041 % fällig am 12.06.2046	236	323	0,01	1,198 % fällig am 25.08.2037	1.148	1.051	0,04	1,045 % fällig am 25.07.2027	367	365	0,01
Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,368 % fällig am 25.09.2047	\$ 1.055	940	0,04	Benefit Street Partners CLO Ltd. 0,998 % fällig am 18.07.2027	499	497	0,02	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,288 % fällig am 25.07.2036	14	14	0,00
Towd Point Mortgage Funding PLC 0,851 % fällig am 20.02.2045	£ 443	603	0,02	Black Diamond CLO Designated Activity Co. 0,650 % fällig am 03.10.2029	€ 1.641	2.006	0,08	Jubilee CLO BV 0,257 % fällig am 15.12.2029	€ 3.300	4.019	0,15
0,956 % fällig am 20.07.2045	1.907	2.607	0,10	Brookside Mill CLO Ltd. 1,038 % fällig am 17.01.2028	\$ 1.050	1.044	0,04	0,334 % fällig am 12.07.2028	5.740	6.975	0,26
1,073 % fällig am 20.10.2051	7.415	10.177	0,38	Cairn CLO BV 0,650 % fällig am 20.10.2028	€ 253	309	0,01	LCM LP 1,258 % fällig am 20.10.2027	\$ 1.000	1.000	0,04
1,255 % fällig am 20.02.2054	1.339	1.835	0,07	0,670 % fällig am 31.01.2030	700	856	0,03	Lehman XS Trust 0,757 % fällig am 25.03.2037	3.577	3.552	0,13
Trinidad Mortgage Securities PLC 0,846 % fällig am 24.01.2059	120	164	0,01	0,790 % fällig am 25.07.2029	291	356	0,01	Long Beach Mortgage Loan Trust 0,588 % fällig am 25.02.2036	675	660	0,03
Trinity Square PLC 1,196 % fällig am 15.07.2051	323	442	0,02	Catamaran CLO Ltd. 1,067 % fällig am 27.01.2028	\$ 1.509	1.502	0,06	1,063 % fällig am 25.08.2035	4.270	3.710	0,14
Twin Bridges PLC 0,821 % fällig am 12.09.2044	117	159	0,01	CIT Mortgage Loan Trust 1,648 % fällig am 25.10.2037	5.500	5.488	0,21	Man GLG Euro CLO DAC 0,870 % fällig am 15.01.2030	€ 1.000	1.220	0,05
0,921 % fällig am 12.09.2050	351	479	0,02	Citigroup Mortgage Loan Trust 0,208 % fällig am 25.07.2045	509	430	0,02	Marathon CLO Ltd. 1,083 % fällig am 21.11.2027	\$ 743	738	0,03
0,991 % fällig am 12.12.2052	1.664	2.277	0,09	0,298 % fällig am 25.12.2036	119	62	0,00	Monarch Grove CLO Ltd. 1,095 % fällig am 25.01.2028	1.840	1.828	0,07
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,451 % fällig am 25.02.2037 ^	\$ 140	138	0,01	6,750 % fällig am 25.05.2036	1.100	789	0,03	Monroe Capital BSL CLO Ltd. 1,333 % fällig am 22.05.2027	84	84	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,748 % fällig am 25.07.2036 ^	131	68	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,093 % fällig am 25.10.2034	90	90	0,00	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,218 % fällig am 25.10.2036	1.712	1.039	0,04
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 2,990 % fällig am 25.07.2034	20	19	0,00	Columbia Cent CLO Ltd. 1,365 % fällig am 25.10.2028	3.700	3.696	0,14	0,278 % fällig am 25.11.2036	1.919	1.090	0,04
		149.964	5,67	Contego CLO BV 0,397 % fällig am 15.11.2026	€ 98	119	0,00	0,288 % fällig am 25.05.2037	1.942	1.701	0,06
				Countrywide Asset-Backed Certificates 0,288 % fällig am 25.06.2035	\$ 4.795	4.452	0,17	0,298 % fällig am 25.09.2036	17.068	8.404	0,32
				0,308 % fällig am 25.09.2046 ^	12	12	0,00	0,378 % fällig am 25.10.2036	1.404	931	0,04
				0,328 % fällig am 25.11.2047 ^	2.819	2.782	0,11	0,378 % fällig am 25.11.2036	6.407	4.786	0,18
				0,348 % fällig am 25.06.2047 ^	3.628	3.328	0,13	0,398 % fällig am 25.07.2036	624	558	0,02
				0,358 % fällig am 25.05.2047 ^	105	99	0,00	0,648 % fällig am 25.04.2036	143	131	0,01
				0,368 % fällig am 25.09.2037 ^	698	669	0,03	0,688 % fällig am 25.12.2034	1.362	1.327	0,05
				1,198 % fällig am 25.08.2035	76	76	0,00	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 0,658 % fällig am 25.02.2036	1.800	1.662	0,06
				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 0,338 % fällig am 25.06.2047	14	14	0,00	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 5,726 % fällig am 25.10.2036 ^	319	136	0,01
				0,628 % fällig am 25.05.2036	4.700	4.600	0,17	Mountain Hawk CLO Ltd. 1,418 % fällig am 18.04.2025	63	63	0,00
				0,808 % fällig am 25.08.2035	700	689	0,03	Mountain View CLO Ltd. 1,044 % fällig am 13.10.2027	1.350	1.340	0,05
				Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 1,063 % fällig am 25.01.2034	662	646	0,02	Newhaven CLO DAC 0,990 % fällig am 15.02.2030	€ 900	1.100	0,04
				3,177 % fällig am 25.12.2036 ^	192	189	0,01	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 0,548 % fällig am 25.02.2037 ^	\$ 3.534	1.305	0,05
				Crown Point CLO Ltd. 1,388 % fällig am 20.10.2028	3.798	3.788	0,14	NovaStar Mortgage Funding Trust 0,308 % fällig am 25.09.2037	62	61	0,00
				CVC Cordatus Loan Fund DAC 0,650 % fällig am 21.07.2030	€ 4.300	5.237	0,20	0,468 % fällig am 25.05.2036	96	95	0,00
				CVC Cordatus Loan Fund Ltd. 0,970 % fällig am 22.04.2030	2.200	2.692	0,10	OAK Hill European Credit Partners Designated Activity Co. 0,720 % fällig am 21.02.2030	€ 2.500	3.052	0,12
				Dartry Park CLO DAC 0,830 % fällig am 28.04.2029	1.122	1.374	0,05	OCF CLO Ltd. 1,035 % fällig am 26.10.2027	\$ 760	759	0,03
				Dryden Senior Loan Fund 1,137 % fällig am 15.10.2027	\$ 673	671	0,03	1,037 % fällig am 15.07.2027	586	584	0,02
				Ellington Loan Acquisition Trust 1,248 % fällig am 25.05.2037	4.643	4.647	0,18	1,068 % fällig am 17.04.2027	184	184	0,01
				Elm Park CLO DAC 0,620 % fällig am 16.04.2029	€ 1.434	1.757	0,07	Option One Mortgage Loan Trust 0,288 % fällig am 25.01.2037	64	45	0,00
				Euro-Galaxy CLO BV 0,750 % fällig am 17.01.2031	1.000	1.223	0,05	0,288 % fällig am 25.02.2037	803	612	0,02
				Fieldstone Mortgage Investment Trust 0,488 % fällig am 25.04.2047	\$ 2.673	2.216	0,08	0,288 % fällig am 25.03.2037	1.050	973	0,04
				Fremont Home Loan Trust 0,248 % fällig am 25.08.2036	243	104	0,00	0,368 % fällig am 25.04.2037	755	602	0,02
				0,283 % fällig am 25.10.2036	201	184	0,01	0,368 % fällig am 25.05.2037	823	604	0,02
				1,018 % fällig am 25.05.2034	2.091	2.052	0,08	Orwell Park CLO Designated Activity Co. 0,780 % fällig am 18.07.2029	€ 304	372	0,01

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Libor Plus 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
<b>OZLM Ltd.</b> 1,294 % fällig am 30.07.2027	\$ 1.579	\$ 1.577	0,06	<b>Voya CLO Ltd.</b> 0,935 % fällig am 25.07.2026	\$ 267	\$ 267	0,01	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>			
<b>OZLME BV</b> 0,820 % fällig am 18.01.2030	€ 2.000	2.446	0,09	<b>WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust</b> 0,373 % fällig am 25.05.2037	727	679	0,03	Nationwide Building Society 10,250 %	2.850	\$ 690	0,02
<b>Palmer Square Loan Funding Ltd.</b> 1,121 % fällig am 15.11.2026	\$ 1.447	1.445	0,05	<b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b> 0,448 % fällig am 25.04.2037	6.701	5.529	0,21				
<b>Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust</b> 0,478 % fällig am 25.07.2036	1.000	955	0,04	<b>Z Capital Credit Partners CLO Ltd.</b> 1,180 % fällig am 16.07.2027	1.222	1.216	0,05	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
<b>RAAC Trust</b> 0,908 % fällig am 25.10.2046	137	134	0,01					<b>KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>			
<b>Residential Asset Securities Corp. Trust</b> 0,398 % fällig am 25.04.2037	21	21	0,00	<b>STAAITSEMISSIONEN</b>				<b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b> 1,600 % fällig am 15.11.2021	\$ 4.900	4.903	0,19
<b>0,488 % fällig am 25.11.2036</b>	73	69	0,00	<b>Angolan Government International Bond</b> 0,125 % fällig am 09.07.2030	86	34	0,00	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b> (3,480) % fällig am 13.09.2021 (c)(d)	ARS 82.062	598	0,02
<b>0,733 % fällig am 25.03.2036</b>	2.525	2.505	0,09	<b>0,125 % fällig am 09.07.2035</b>	57	21	0,00	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b> (0,084) % fällig am 29.03.2021 (c)(d)	¥ 25.950.000	251.404	9,51
<b>0,763 % fällig am 25.01.2036</b>	21	21	0,00	<b>Argentina Government International Bond</b> 0,125 % fällig am 09.07.2035	2.447	902	0,03	<b>(0,087) % fällig am</b> 22.03.2021 (c)(d)	14.590.000	141.345	5,34
<b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b> 0,808 % fällig am 25.08.2035 ^	78	61	0,00	<b>1,000 % fällig am 09.07.2029</b>	150	66	0,00				
<b>Seneca Park CLO Ltd.</b> 1,338 % fällig am 17.07.2026	4	4	0,00	<b>36,174 % fällig am</b> 03.04.2022	ARS 7.790	52	0,00	<b>U.S. TREASURY BILLS</b> 0,086 % fällig am 25.02.2021 (c)(d)(i)	\$ 228.900	228.881	8,66
<b>SG Mortgage Securities Trust</b> 0,358 % fällig am 25.10.2036	3.600	2.785	0,11	<b>Autonomous Community of Catalonia</b> 4,900 % fällig am 15.09.2021	€ 1.350	1.710	0,07	<b>0,178 % fällig am</b> 25.03.2021 (c)(d)(i)	6.900	6.899	0,26
<b>Sierra Madre Funding Ltd.</b> 0,533 % fällig am 07.09.2039	3.384	3.096	0,12	<b>China Development Bank</b> 3,230 % fällig am 10.01.2035	CNY 206.600	31.685	1,20				
<b>SoFi Consumer Loan Program LLC</b> 2,770 % fällig am 25.05.2026	8	8	0,00	<b>3,340 % fällig am 14.07.2025</b>	184.300	28.338	1,07	<b>Summe kurzfristige Instrumente</b>		634.030	23,98
<b>Soundview Home Loan Trust</b> 0,348 % fällig am 25.06.2037	2.922	2.399	0,09	<b>Emirate of Abu Dhabi Government International Bond</b> 2,500 % fällig am 11.10.2022	\$ 700	726	0,03	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>	\$ 2.936.209	111,02	
<b>0,398 % fällig am 25.10.2036</b>	1.770	1.696	0,06	<b>Israel Government International Bond</b> 2,750 % fällig am 03.07.2030	1.900	2.098	0,08				
<b>0,408 % fällig am 25.02.2037</b>	1.119	438	0,02	<b>3,800 % fällig am 13.05.2060</b>	4.100	4.881	0,19	<b>AKTIEN</b>			
<b>Structured Asset Investment Loan Trust</b> 1,123 % fällig am 25.01.2035	1.685	1.598	0,06	<b>Japan Finance Organization for Municipalities</b> 0,050 % fällig am 12.02.2027	€ 1.500	1.860	0,07	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
<b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b> 0,303 % fällig am 25.09.2036	6.216	4.964	0,19	<b>Kuwait International Government Bond</b> 2,750 % fällig am 20.03.2022	\$ 300	309	0,01	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
<b>1,655 % fällig am 25.04.2035</b>	72	71	0,00	<b>Peru Government International Bond</b> 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 53.332	18.401	0,70	<b>PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (g)</b>	1.197.507	12.083	0,46
<b>Sudbury Mill CLO Ltd.</b> 1,368 % fällig am 17.01.2026	93	93	0,00	<b>6,150 % fällig am 12.08.2032</b>	11.700	3.971	0,15	<b>PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)</b>	385.356	4.505	0,17
<b>Symphony CLO Ltd.</b> 1,267 % fällig am 15.10.2025	102	102	0,00	<b>6,350 % fällig am 12.08.2028</b>	26.946	9.469	0,36	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)</b>	3.439.789	34.267	1,30
<b>THL Credit Wind River CLO Ltd.</b> 1,107 % fällig am 15.10.2027	401	401	0,02	<b>Qatar Government International Bond</b> 3,875 % fällig am 23.04.2023	\$ 1.000	1.076	0,04				
<b>TICP CLO Ltd.</b> 1,018 % fällig am 20.07.2027	1.119	1.116	0,04	<b>4,500 % fällig am 23.04.2028</b>	1.600	1.941	0,07	<b>Summe Investmentfonds</b>	\$ 113.341	4,29	
<b>1,058 % fällig am 20.04.2028</b>	272	270	0,01	<b>Saudi Government International Bond</b> 2,875 % fällig am 04.03.2023	600	629	0,02				
<b>Tikehau CLO BV</b> 0,880 % fällig am 07.12.2029	€ 3.300	4.036	0,15	<b>3,625 % fällig am 04.03.2028</b>	1.600	1.796	0,07				
<b>Toro European CLO DAC</b> 0,900 % fällig am 15.10.2030	400	489	0,02	<b>South Africa Government International Bond</b> 4,850 % fällig am 30.09.2029	4.500	4.790	0,18				
<b>Tralee CLO Ltd.</b> 1,248 % fällig am 20.10.2027	\$ 461	460	0,02	<b>Turkey Government International Bond</b> 5,750 % fällig am 22.03.2024	1.000	1.055	0,04				
<b>1,328 % fällig am 20.10.2028</b>	2.400	2.400	0,09	<b>6,350 % fällig am 10.08.2024</b>	4.500	4.840	0,18				
<b>Venture CLO Ltd.</b> 1,057 % fällig am 15.04.2027	728	726	0,03			121.196	4,58				
<b>1,087 % fällig am 15.01.2028</b>	550	548	0,02								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 20.967	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (21.386)	\$ 20.967	\$ 20.967	0,79
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						\$ (21.386)	\$ 20.967	\$ 20.967	0,79

(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-Bobl March Futures	Short	03.2021	105	\$ (18)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	563	833	0,03

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	36	\$ (1)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	20	15	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	1.058	304	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	292	7	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	43	(11)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	702	928	0,04
				\$ 2.057	0,08
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 2.057	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 – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 5.100	\$ 82	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	€ 4.000	61	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	2.500	(194)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	700	(58)	0,00
				\$ (109)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-34 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2025	\$ 47.564	\$ (7.751)	(0,29)
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	(15)	0,00
				\$ (7.764)	(0,29)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-33 5-Year Index	5,000 %	20.12.2024	\$ 1.602	\$ 33	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000	20.12.2025	1.700	10	0,00
				\$ 43	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,850 %	03.01.2022	BRL	158.100	\$ (3)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022		13.280	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,865	03.01.2022		112.620	(9)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022		40.700	(3)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,871	03.01.2022		54.500	(4)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,886	03.01.2022		32.300	(4)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,330	03.01.2022		36.900	47	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022		1.103.500	1.685	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,364	03.01.2022		515.700	699	0,03
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD	4.900	88	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025		7.200	124	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,270	03.03.2022		6.400	60	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,273	03.03.2022		3.800	36	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025		4.500	90	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025		2.700	54	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,290	03.03.2025		1.300	27	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2022		6.300	48	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,755	16.12.2025	CNY	35.900	34	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,622	20.03.2025	\$	15.300	205	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030		5.000	(310)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,400	29.12.2050		23.600	117	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029		15.100	(1.362)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	16.01.2050		5.000	(308)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	03.02.2050		500	(38)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.01.2030		17.100	(1.292)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	18.12.2049		12.000	(1.827)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	22.01.2050		4.200	(377)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.12.2029		5.100	(516)	(0,02)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit ESG 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	2,000 %	12.02.2030	\$ 9.900	\$ (912)	(0,03)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.03.2030	4.900	(528)	(0,02)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.01.2050	2.200	(333)	(0,01)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	39.540	(6.898)	(0,26)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	2.195	(707)	(0,03)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	11.12.2049	4.300	(912)	(0,03)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2027	40.160	(5.544)	(0,21)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031	€ 12.200	12	0,00	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2026	47.300	130	0,00	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	£ 192.300	(71)	0,00	
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,015	17.09.2029	¥ 513.000	(12)	0,00	
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,068	25.09.2029	744.000	(53)	0,00	
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,078	10.09.2029	288.000	(23)	0,00	
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,085	27.09.2029	606.000	(52)	0,00	
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,086	11.09.2029	497.000	(43)	0,00	
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,104	09.09.2029	505.000	(52)	0,00	
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.03.2026	5.150.000	(483)	(0,02)	
Zahlung	UKRPI	3,579	15.10.2033	£ 4.900	663	0,03	
Zahlung	UKRPI	3,596	15.05.2034	6.500	764	0,03	
						\$ (17.794)	(0,67)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ (25.624)</b>	<b>(0,97)</b>

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,306 %	29.10.2021	650	\$ 48	\$ 31	(0,01)
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,306	29.10.2021	650	48	54	0,00
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,370	25.10.2021	2.600	186	139	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,370	25.10.2021	2.600	186	191	0,01
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,365	22.10.2021	3.500	249	185	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,365	22.10.2021	3.500	250	258	0,01
							\$ 967	\$ 858	0,03

### VERKAUFSOPTIONS

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,425 %	17.03.2021	18.300	\$ (9)	\$ (7)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	14.600	(19)	(12)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	18.300	(19)	(15)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	3.400	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	2.500	(2)	0	0,00
MYC	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	14.400	(8)	(7)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	14.400	(14)	(7)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	13.300	(18)	(11)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	12.100	(15)	(8)	0,00
						\$ (106)	\$ (67)	0,00

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,013 %	25.01.2021	24.000	\$ (145)	\$ (203)	(0,01)
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,016	25.01.2021	24.000	(145)	(85)	0,00
							\$ (290)	\$ (288)	(0,01)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 101,563	07.01.2021	3.700	\$ (13)	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	101,672	07.01.2021	6.200	(21)	0	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,406	04.02.2021	12.200	(38)	(49)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,703	04.02.2021	3.400	(8)	(14)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,750	04.02.2021	4.000	(12)	(11)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	103,750	04.02.2021	4.000	(10)	(18)	0,00
					\$ (102)	\$ (92)	0,00

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto-vermögens
BOA	UBS AG	(1,000) %	20.06.2024	\$ 200	\$ 13	\$ (16)	\$ (3)	0,00

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto-vermögens
BOA	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.12.2022	\$ 200	\$ (1)	\$ 4	\$ 3	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2021	100	(3)	3	0	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	200	(26)	15	(11)	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	0	2	2	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)	6	3	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	2.300	(103)	60	(43)	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	37	14	51	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	\$ 500	(16)	20	4	0,00
					\$ (218)	\$ 225	\$ 7	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto-vermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 2.200	\$ (9)	\$ 38	\$ 29	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)	22	19	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	300	(9)	13	4	0,00
					\$ (25)	\$ 78	\$ 53	0,00

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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 Netto-vermögens
BOA	01.2021	¥ 27.035	\$ 260	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	01.2021	\$ 191	MXN 4.024	11	0	11	0,00
	01.2021	16	PLN 60	0	0	0	0,00
	01.2021	6.497	ZAR 99.332	248	0	248	0,01
	02.2021	PEN 14.425	\$ 4.006	18	0	18	0,00
	02.2021	\$ 6.510	RUB 487.013	49	0	49	0,00
	03.2021	¥ 25.950.000	\$ 251.380	0	(200)	(200)	(0,01)
	03.2021	\$ 9.600	COP 35.018.604	628	0	628	0,02
BPS	01.2021	AUD 1.346	\$ 990	0	(49)	(49)	0,00
	01.2021	€ 10.518	12.885	16	(2)	14	0,00
	01.2021	\$ 3.227	€ 2.652	19	0	19	0,00
	01.2021	11.966	MXN 242.462	214	(35)	179	0,01
	01.2021	4	PLN 14	0	0	0	0,00
	03.2021	TWD 3.483	\$ 124	0	(1)	(1)	0,00
BRC	03.2021	¥ 6.245.668	60.166	0	(379)	(379)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Libor Plus Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	01.2021	¥ 2.636	\$ 25	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	02.2021	PEN 11.370	\$ 3.171	27	0	27	0,00
	02.2021	\$ 1.317	PEN 4.739	0	(6)	(6)	0,00
	03.2021	CNH 394.469	\$ 59.066	0	(1.363)	(1.363)	(0,05)
	05.2021	\$ 171	MXN 3.757	14	0	14	0,00
	05.2021	\$ 1.010	PEN 3.680	7	0	7	0,00
GLM	01.2021	BRL 134.425	\$ 26.449	569	0	569	0,02
	01.2021	PEN 29.605	\$ 8.216	31	0	31	0,00
	01.2021	\$ 13.299	BRL 67.212	0	(359)	(359)	(0,01)
	01.2021	¥ 536	¥ 55.438	1	0	1	0,00
	02.2021	¥ 55.438	\$ 536	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$ 13.217	BRL 67.212	0	(281)	(281)	(0,01)
	02.2021	1.520	RUB 115.892	41	0	41	0,00
HUS	01.2021	€ 1.813	\$ 2.202	0	(16)	(16)	0,00
	01.2021	£ 105.461	141.007	0	(3.158)	(3.158)	(0,12)
	01.2021	¥ 4.869	47	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 5	PLN 19	0	0	0	0,00
	02.2021	513	PEN 1.869	4	0	4	0,00
	02.2021	1.032	RUB 77.186	7	0	7	0,00
	03.2021	¥ 8.344.332	\$ 80.361	0	(529)	(529)	(0,02)
MYI	01.2021	€ 96	118	0	0	0	0,00
	01.2021	£ 2.738	3.687	0	(56)	(56)	0,00
	01.2021	\$ 1.920	£ 1.411	9	0	9	0,00
	01.2021	5.812	ZAR 91.722	417	0	417	0,02
SCX	01.2021	€ 257.392	\$ 308.251	0	(6.682)	(6.682)	(0,25)
	01.2021	\$ 1.444	£ 1.069	17	0	17	0,00
	02.2021	€ 257.392	\$ 315.144	0	(3)	(3)	0,00
TOR	01.2021	CAD 11.384	8.787	0	(148)	(148)	(0,01)
	01.2021	¥ 20.898	200	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 8.936	CAD 11.384	0	0	0	0,00
	02.2021	CAD 11.384	\$ 8.937	0	0	0	0,00
UAG	02.2021	\$ 3.352	RUB 255.135	84	0	84	0,00
				\$ 2.431	\$ (13.272)	\$ (10.841)	(0,41)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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
BPS	01.2021	€ 4	\$ 5	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 29.229	€ 24.373	593	(1)	592	0,02
CBK	01.2021	10.320	8.597	200	0	200	0,01
HUS	01.2021	€ 2.107	\$ 2.527	0	(52)	(52)	0,00
	01.2021	\$ 774	€ 634	3	(1)	2	0,00
SCX	01.2021	40.928	34.175	887	0	887	0,03
	02.2021	62.495	51.041	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	38.590	32.222	836	0	836	0,03
	02.2021	46.683	38.128	0	0	0	0,00
				\$ 2.519	\$ (54)	\$ 2.465	0,09

Zum 31. Dezember 2020 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
BOA	01.2021	\$ 62.251	£ 45.697	\$ 216	\$ 0	\$ 216	0,01
BPS	01.2021	£ 610	\$ 816	0	(18)	(18)	0,00
	01.2021	\$ 450	£ 335	8	0	8	0,00
BRC	01.2021	65	49	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	£ 1.946	\$ 2.641	0	(20)	(20)	0,00
	01.2021	\$ 722.864	£ 540.768	16.361	0	16.361	0,62
HUS	01.2021	775.756	579.864	16.914	0	16.914	0,64
MYI	01.2021	539	400	7	0	7	0,00
SCX	01.2021	8.603	6.461	228	0	228	0,01
SSB	01.2021	795.245	595.767	19.164	0	19.164	0,72
				\$ 52.899	\$ (38)	\$ 52.861	2,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 44.953 1,70

Summe Anlagen

\$ 3.091.903 116,91

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (447.302) (16,91)

Nettovermögen

\$ 2.644.601 100,00

## 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) 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 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 7.156 und Barmittel in Höhe von USD 240 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 27.486 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	2.057	19.329	0	21.386
<b>Summen</b>	<b>\$ 52.912</b>	<b>\$ 3.031.538</b>	<b>\$ 7.453</b>	<b>\$ 3.091.903</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 2.347.840	\$ 621	\$ 2.348.462
Investmentfonds	194.207	0	0	194.207
Pensionsgeschäfte	0	14.117	0	14.117
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(884)	32.552	0	31.668
<b>Summen</b>	<b>\$ 193.324</b>	<b>\$ 2.394.509</b>	<b>\$ 621</b>	<b>\$ 2.588.454</b>

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 968	\$ (720)	\$ 248
BPS	795	(920)	(125)
BRC	(389)	202	(187)
CBK	15.552	(12.473)	3.079
GLM	443	(290)	153
GST	(12)	40	28
HUS	13.172	(10.460)	2.712
MYC	(265)	200	(65)
MYI	377	(260)	117
SAL	(73)	0	(73)
SCX	(5.553)	6.954	1.401
SSB	19.164	(15.810)	3.354
TOR	686	(750)	(64)
UAG	88	(10)	78

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	45,13	60,38
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	62,55	56,40
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,34	k. A.
Investmentfonds	4,29	9,65
Pensionsgeschäfte	0,79	0,70
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,08	(0,04)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,97)	(0,10)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,70	1,71
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(1,55)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,49	0,25
Unternehmensanleihen und Wechsel	24,27	27,56
Kommunalanleihen und Wechsel	0,15	0,01
US-Regierungsbehörden	18,44	35,76
US-Schatzobligationen	23,79	32,58
Non-Agency-MBS	5,67	7,06
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,63	10,07
Staatsemissionen	4,58	2,38
Vorzugswertpapiere	0,02	0,02
Kurzfristige Instrumente	23,98	1,09
Investmentfonds	4,29	9,65
Pensionsgeschäfte	0,79	0,70
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,08	(0,04)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,29)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,03
Zinsswaps	(0,67)	(0,13)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswaptionen	0,03	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	k. A.
Zinsswaptionen	(0,01)	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
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	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,41)	(0,35)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	2,09	2,07
Sonstige Aktiva und Passiva	(16,91)	(28,70)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Low Duration Real Return 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
<b>SCHWEDEN</b>				<b>US-SCHATZ ZOBILIGATIONEN</b>				<b>US-SCHATZ ZOBILIGATIONEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates</b>				<b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)</b>			
Sweden Government International Bond				0,808 % fällig am 25.11.2035	\$ 310	\$ 311	0,04	0,125 % fällig am 15.04.2021	\$ 33	\$ 33	0,00
0,125 % fällig am 01.06.2026	SEK 41.705	\$ 5.565	0,71	Renaissance Home Equity Loan Trust				0,125 % fällig am 15.01.2022 (h)	20.880	21.256	2,70
1,000 % fällig am 01.06.2025	18.769	2.551	0,32	1,088 % fällig am 25.05.2034	2.428	2.376	0,30	0,125 % fällig am 15.04.2022 (h)	105.723	107.956	13,70
Summe Schweden		8.116	1,03	Residential Asset Mortgage Products Trust				0,125 % fällig am 15.07.2022	7.303	7.530	0,96
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				<b>Structured Asset Investment Loan Trust</b>				<b>U.S. Treasury Notes</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>1,098 % fällig am 25.10.2033</b>				<b>1,750 % fällig am 31.12.2024</b>			
FCE Bank PLC	€ 1.300	1.590	0,20	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust	1.029	1.017	0,13	0,250 % fällig am 15.07.2029	17.777	20.140	2,56
0,869 % fällig am 13.09.2021				0,358 % fällig am 25.01.2037	1.698	1.699	0,21	0,375 % fällig am 15.07.2023	22.378	23.711	3,01
Lloyds Banking Group PLC	\$ 1.100	1.104	0,14	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,375 % fällig am 15.07.2025	14.494	15.925	2,02
1,039 % fällig am 21.06.2021				<b>Charter Communications Operating LLC</b>				0,500 % fällig am 15.04.2024	805	863	0,11
Natwest Group PLC				4,464 % fällig am 23.07.2022	100	106	0,01	0,625 % fällig am 15.04.2023 (h)	78.841	83.033	10,54
1,801 % fällig am 25.06.2024	1.600	1.630	0,21	Delta Air Lines Pass-Through Trust				0,625 % fällig am 15.01.2024	22.457	24.109	3,06
4,519 % fällig am 25.06.2024	1.000	1.092	0,14	6,821 % fällig am 10.02.2024	73	75	0,01	0,750 % fällig am 15.07.2028	2.282	2.656	0,34
<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>Duke Energy Corp.</b>				<b>U.S. Treasury Bills</b>			
Canada Square Funding PLC	£ 3.293	4.507	0,57	2,400 % fällig am 15.08.2022	100	103	0,01	0,093 % fällig am 04.02.2021			
1,156 % fällig am 17.10.2051				Ford Motor Credit Co. LLC				(a)(b)(i)	9.600	9.599	1,22
Canterbury Finance No. 1 PLC				0,000 % fällig am 01.12.2021	€ 2.200	2.682	0,34	0,096 % fällig am 23.02.2021	3.700	3.700	0,47
1,225 % fällig am 16.05.2056	436	598	0,08	0,000 % fällig am 01.12.2021	700	849	0,11	(a)(b)(i)			
Finsbury Square PLC				GATX Corp.				Summe kurzfristige Instrumente		13.299	1,69
1,084 % fällig am 16.09.2069	2.802	3.841	0,49	0,945 % fällig am 05.11.2021	\$ 5.500	5.513	0,70	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.119.289	142,06	
Great Hall Mortgages PLC				4,850 % fällig am 01.06.2021	500	509	0,07	<b>AKTIEN</b>			
0,167 % fällig am 18.03.2039	63	85	0,01	Nissan Motor Acceptance Corp.				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
0,187 % fällig am 18.06.2038	265	356	0,04	2,800 % fällig am 13.01.2022	2.200	2.238	0,29	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)</b>			
Hawksmoor Mortgages PLC				3,450 % fällig am 15.03.2023	100	104	0,01	4.191.667	41.757	5,30	
1,104 % fällig am 25.05.2053	3.890	5.325	0,68	Oncor Electric Delivery Co. LLC				Summe Investmentfonds	\$ 41.757	5,30	
Precise Mortgage Funding PLC				4,100 % fällig am 01.06.2022	100	104	0,01	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
0,983 % fällig am 16.10.2056	664	905	0,11	Penske Truck Leasing Co. LP				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Towd Point Mortgage Funding PLC				3,375 % fällig am 01.02.2022	600	616	0,08	<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)</b>			
0,956 % fällig am 20.07.2045	1.997	2.731	0,35	Sabine Pass Liquefaction LLC				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
1,255 % fällig am 20.02.2054	893	1.223	0,15	5,750 % fällig am 15.05.2024	200	229	0,03	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Trinity Square PLC				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				<b>PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)</b>			
1,196 % fällig am 15.07.2051	807	1.104	0,14	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Summe Großbritannien		20.675	2,62	0,788 % fällig am 25.10.2028	16	15	0,00	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
United Kingdom Gilt				0,632 % fällig am 19.04.2035	459	459	0,06	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
0,125 % fällig am 22.03.2026 (c)	16.183	25.930	3,29	0,652 % fällig am 19.07.2035	76	73	0,01	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
0,125 % fällig am 22.11.2036 (c)	4.980	10.626	1,35	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
0,125 % fällig am 22.11.2056 (c)	38	117	0,01	0,728 % fällig am 25.07.2045	574	558	0,07	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
1,250 % fällig am 22.11.2027 (c)	4.398	7.971	1,01	0,788 % fällig am 25.07.2045	130	128	0,02	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
2,750 % fällig am 07.09.2024	8.900	13.444	1,71	<b>US-REGIERUNGSBEHORDEN</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Summe Großbritannien		58.088	7,37	<b>Ginnie Mae</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
<b>USA</b>				<b>0,599 % fällig am 20.08.2068</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>0,840 % fällig am 20.08.2066</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates	\$ 1.359	1.348	0,17	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
1,048 % fällig am 25.10.2034				2,000 % fällig am 01.03.2051	25.280	26.177	3,32	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				2,500 % fällig am 01.03.2051	11.480	12.065	1,53	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
0,313 % fällig am 25.03.2036	330	327	0,04	3,000 % fällig am 01.02.2051	3.500	3.670	0,47	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
First Franklin Mortgage Loan Trust				3,500 % fällig am 01.01.2051	21.253	22.494	2,86	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
0,808 % fällig am 25.01.2036	5.500	5.415	0,69	4,000 % fällig am 01.01.2051	40.116	42.895	5,44	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Fremont Home Loan Trust				<b>Summe USA</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
0,883 % fällig am 25.07.2035	65	65	0,01	<b>14.445</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
				<b>1.699</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
				<b>14.445</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
				<b>1.83</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 1.551	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (1.582)	\$ 1.551	\$ 1.551	0,20
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.582)	\$ 1.551	\$ 1.551	0,20

<sup>(1)</sup> 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 March Futures	Short	03.2021	16	\$ (10)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 136,000 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Short	02.2021	98	11	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2021	432	(72)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2021	150	(120)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	104	(83)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	18	(33)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	42	(46)	(0,01)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2021	312	37	0,01
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	4	1	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2021	585	(122)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	1.194	293	0,04
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	431	(78)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	412	154	0,02
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	6	5	0,00
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	75	(142)	(0,02)
				\$ (205)	(0,03)
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ (205)</b>	<b>(0,03)</b>

<sup>(1)</sup> 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.06.2022	\$ 100	\$ (5)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	500	35	0,01
Simon Property Group LP	1,000	20.06.2022	4.000	31	0,00
				\$ 61	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 1.400	\$ (18)	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	(1,000)	20.12.2025	€ 18.000	(123)	(0,02)
				\$ (141)	(0,02)

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,394 %	21.11.2023	\$ 23.900	\$ (23)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 23.400	(4)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051	£ 2.900	(70)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	¥ 133.300	(42)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	1,005	15.02.2025	€ 18.100	(362)	(0,05)
Erhalt	CPTFEMU	1,087	15.02.2030	1.000	(17)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,355	15.02.2050	1.200	(48)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	1,375	15.02.2040	1.600	51	0,01
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	800	265	0,03
Zahlung	CPURNSA	0,860	15.06.2021	\$ 6.000	(71)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	0,900	17.06.2021	7.400	(89)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,030	18.06.2021	6.400	(71)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,690	07.08.2021	18.300	(190)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	1,794	24.08.2027	6.700	222	0,03
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	3.400	111	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,840	14.08.2021	9.000	(74)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,863	26.08.2021	2.200	(14)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,883	20.11.2029	7.400	(184)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	6.500	165	0,02
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	4.700	(62)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	4.300	(30)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,210	05.02.2023	17.550	(308)	(0,04)
Erhalt	CPURNSA	2,220	13.04.2023	7.440	(156)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,263	27.04.2023	60	(1)	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	CPURNSA	2,263 %	09.05.2023	\$ 5.230	\$ (122)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,281	10.05.2023	6.064	(158)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,335	05.02.2028	6.110	207	0,03
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	960	39	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	7.960	331	0,04
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	1.900	82	0,01
Zahlung	FRCPXTOB	1,280	15.11.2034	€ 1.700	73	0,01
Zahlung	FRCPXTOB	1,410	15.11.2039	2.000	96	0,01
Zahlung	UKRPI	3,324	15.08.2025	£ 21.100	149	0,02
Zahlung	UKRPI	3,330	15.01.2025	4.700	162	0,02
Zahlung	UKRPI	3,346	15.05.2030	3.750	59	0,01
Zahlung	UKRPI	3,530	15.10.2031	10.760	1.012	0,13
Zahlung	UKRPI	3,850	15.09.2024	6.500	560	0,07
					<b>\$ 1.488</b>	<b>0,19</b>
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 1.408</b>	<b>0,18</b>

- (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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
HUS	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,315	07.01.2021	11.000	\$ 140	\$ 1	0,00

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,195 %	02.11.2022	2.200	\$ 2	\$ 150	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	2.590	197	177	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	1.400	157	154	0,02
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	1.410	105	96	0,01
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	1.800	198	199	0,03
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,344	17.11.2022	56.100	63	93	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	2.100	153	145	0,02
						<b>\$ 875</b>	<b>\$ 1.014</b>	<b>0,13</b>	

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.02.2051	\$ 62,000	04.02.2021	1.600	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.02.2051	66,000	04.02.2021	31.300	1	0	0,00
					<b>\$ 1</b>	<b>\$ 0</b>	<b>0,00</b>

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700 %	17.03.2021	2.700	\$ (4)	\$ (4)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	400	(3)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	4.800	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	3.100	(4)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	4.800	(5)	(5)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	1.400	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	1.400	(2)	(2)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BRC	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375 %	21.04.2021	16.200	\$ (8)	\$ (8)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	16.200	(28)	(27)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	4.300	(7)	(6)	0,00
GST	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	2.500	(2)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	3.300	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	3.300	(3)	(4)	0,00
						\$ (73)	\$ (66)	(0,01)

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.500	\$ (69)	\$ (1)	0,00
JPM	Cap - OTC CPURNSA	233,916	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	22.04.2024	1.000	(7)	0	0,00
	Cap - OTC CPURNSA	234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	100	(1)	0	0,00
						\$ (77)	\$ (1)	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000 %	02.11.2022	6.600	\$ 0	\$ (139)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	7.740	(192)	(164)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	4.200	(154)	(154)	(0,02)
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	4.160	(102)	(88)	(0,01)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	46.800	(73)	(62)	(0,01)
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	5.400	(194)	(199)	(0,02)
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	6.400	(155)	(135)	(0,02)
						\$ (870)	\$ (941)	(0,12)	

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	\$ 102,906	11.03.2021	300	\$ (1)	\$ (2)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	900	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	1.300	(3)	(6)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	300	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,141	04.03.2021	300	(1)	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	104,141	04.03.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,406	04.02.2021	2.700	(8)	(11)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,750	04.02.2021	400	(1)	(1)	0,00
Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	103,750	04.02.2021	400	(1)	(2)	0,00	
					\$ (20)	\$ (26)	0,00

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 600	\$ (40)	\$ 47	\$ 7	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.400	(3)	15	12	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	900	(80)	92	12	0,00
					\$ (123)	\$ 154	\$ 31	0,00

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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 Global Low Duration Real Return 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	01.2021	¥ 1.072.817	\$ 10.316	\$ 0	\$ (76)	\$ (76)	(0,01)
BPS	01.2021	AUD 4.096	3.013	0	(148)	(148)	(0,02)
	01.2021	€ 979	1.191	0	(7)	(7)	0,00
	01.2021	\$ 102	CAD 130	0	0	0	0,00
	01.2021	€ 973	€ 796	2	(1)	1	0,00
	02.2021	DKK 61.479	\$ 9.812	0	(300)	(300)	(0,04)
BRC	01.2021	BRL 1.421	268	0	(6)	(6)	0,00
	01.2021	\$ 274	BRL 1.421	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	BRL 1.421	\$ 274	0	0	0	0,00
	01.2021	¥ 104.590	1.004	0	(9)	(9)	0,00
	01.2021	NZD 1.348	948	0	(22)	(22)	0,00
	01.2021	\$ 281	BRL 1.421	0	(7)	(7)	0,00
	01.2021	117	MXN 2.493	8	0	8	0,00
	02.2021	BRL 1.421	\$ 281	0	0	7	0,00
	02.2021	DKK 64.507	10.337	7	(274)	(274)	(0,03)
	03.2021	PEN 3.429	968	20	0	20	0,00
GLM	01.2021	\$ 21.255	¥ 2.199.900	53	0	53	0,01
	02.2021	DKK 54.901	\$ 8.821	0	(209)	(209)	(0,03)
	02.2021	¥ 2.199.900	21.261	0	(54)	(54)	(0,01)
	02.2021	\$ 709	DKK 4.295	0	(3)	(3)	0,00
	04.2021	COP 581.610	\$ 158	0	(11)	(11)	0,00
HUS	01.2021	€ 10.598	12.848	0	(121)	(121)	(0,02)
	01.2021	£ 58.736	78.558	0	(1.733)	(1.733)	(0,22)
	01.2021	¥ 193.219	1.854	0	(18)	(18)	0,00
	01.2021	SEK 94.540	11.113	0	(400)	(400)	(0,05)
	02.2021	\$ 2	RUB 167	0	0	0	0,00
	03.2021	PEN 18.501	\$ 5.153	37	0	37	0,00
	03.2021	\$ 116	CNY 770	2	0	2	0,00
	03.2021	112	IDR 1.603.570	3	0	3	0,00
	03.2021	1.045	PEN 3.719	0	(17)	(17)	0,00
JPM	01.2021	AUD 3.147	\$ 2.316	0	(113)	(113)	(0,01)
	01.2021	€ 1.315	1.606	0	(3)	(3)	0,00
MYI	01.2021	90	110	0	0	0	0,00
	01.2021	£ 5	7	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 186	€ 152	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	89	£ 66	0	0	0	0,00
SCX	04.2022	DKK 24.500	\$ 3.951	0	(118)	(118)	(0,01)
	01.2021	AUD 1.838	1.354	0	(64)	(64)	(0,01)
	01.2021	€ 204.438	244.833	0	(5.306)	(5.306)	(0,67)
	01.2021	\$ 3.325	SEK 28.090	96	0	96	0,01
	02.2021	€ 204.438	\$ 250.308	0	(2)	(2)	0,00
	02.2021	ILS 75	22	0	(2)	(2)	0,00
SOG	01.2021	\$ 672	£ 500	12	0	12	0,00
TOR	01.2021	CAD 5.219	\$ 4.029	0	(68)	(68)	(0,01)
	01.2021	¥ 829.274	7.949	0	(83)	(83)	(0,01)
	01.2021	\$ 4.097	CAD 5.219	0	0	0	0,00
	01.2021	101	CHF 90	1	0	1	0,00
	02.2021	CAD 5.219	\$ 4.097	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	AUD 6.184	4.547	0	(225)	(225)	(0,03)
	02.2021	DKK 76.911	12.314	0	(336)	(336)	(0,04)
				\$ 241	\$ (9.737)	\$ (9.496)	(1,20)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 3.940	CHF 3.557	\$ 84	\$ 0	\$ 84	0,01
BRC	01.2021	22	20	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	3.919	3.550	97	0	97	0,01
SCX	01.2021	69	62	2	0	2	0,00
SSB	01.2021	CHF 21	\$ 23	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 3.955	CHF 3.564	77	0	77	0,01
UAG	01.2021	64	56	0	0	0	0,00
				\$ 260	\$ 0	\$ 260	0,03

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	€ 160	\$ 197	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BPS	01.2021	1.043	1.278	2	0	2	0,00
	01.2021	\$ 165.641	€ 138.261	3.530	(2)	3.528	0,45
CBK	01.2021	€ 10	\$ 12	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
	01.2021	\$ 2.896	€ 2.412	\$ 56	\$ 0	\$ 56	0,01
HUS	01.2021	€ 883	\$ 1.075	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	\$ 5.676	€ 4.697	75	(4)	71	0,01
JPM	01.2021	781	639	2	0	2	0,00
MYI	01.2021	305	250	1	0	1	0,00
SCX	01.2021	184.277	153.871	3.992	0	3.992	0,50
	02.2021	285.199	232.932	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2021	173.747	145.079	3.764	0	3.764	0,48
	02.2021	246.989	201.724	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 11.423	\$ (13)	\$ 11.410	1,45

Zum 31. Dezember 2020 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
BOA	01.2021	\$ 7.607	£ 5.695	\$ 178	\$ 0	\$ 178	0,02
BPS	01.2021	£ 18	\$ 25	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 686	£ 514	16	0	16	0,00
BRC	01.2021	£ 38	\$ 51	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 25.984	£ 19.441	592	0	592	0,08
CBK	01.2021	£ 63	\$ 86	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 13.621	£ 10.189	308	0	308	0,04
HUS	01.2021	£ 1.518	\$ 2.032	0	(44)	(44)	(0,01)
	01.2021	\$ 18.545	£ 13.861	404	0	404	0,05
MYI	01.2021	853	633	13	0	13	0,00
SCX	01.2021	£ 2.128	\$ 2.829	0	(81)	(81)	(0,01)
	01.2021	\$ 587	£ 435	7	0	7	0,00
SSB	01.2021	20.919	15.672	504	0	504	0,07
				\$ 2.022	\$ (125)	\$ 1.897	0,24
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ 4.083</b>	<b>0,52</b>

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.01.2051 (g)	\$ 1.741	\$ (1.840)	(0,23)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (1.840)</b>	<b>(0,23)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 1.166.043</b>	<b>148,00</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (378.172)</b>	<b>(48,00)</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 787.871</b>	<b>100,00</b>

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

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

- 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.
- Mit dem Fonds verbunden.
- Bedingt wandelbares Wertpapier.
- Zum 31. Dezember 2020 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 282.249 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.
- Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.541 und Barmittel in Höhe von USD 490 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.650 und Barmittel in Höhe von 550 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 9.032 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(205)	5.492	(1)	5.286
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(1.840)	0	(1.840)
<b>Summen</b>	<b>\$ 41.552</b>	<b>\$ 1.124.492</b>	<b>\$ (1)</b>	<b>\$ 1.166.043</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 1.319.514	\$ 10.043	\$ 1.329.557
Investmentfonds	1.023	0	0	1.023
Pensionsgeschäfte	0	1.884	0	1.884
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	549	9.206	0	9.755
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.572</b>	<b>\$ 1.330.604</b>	<b>\$ 10.043</b>	<b>\$ 1.342.219</b>

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

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

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

### Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	0,180 %	21.10.2020	21.01.2021	\$ (66.194)	\$ (66.218)	(8,40)
	0,180	22.10.2020	21.01.2021	(718)	(718)	(0,09)
TDM	0,180	08.10.2020	07.01.2021	(10.789)	(10.794)	(1,37)
	0,180	19.10.2020	14.01.2021	(12.584)	(12.588)	(1,60)
	0,180	22.10.2020	11.02.2021	(189.376)	(189.443)	(24,05)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (279.761)</b>	<b>(35,51)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 47 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 183	\$ 0	\$ 183
BPS	3.101	(3.840)	(739)
BRC	553	(280)	273
CBK	87	146	233
GLM	(287)	0	(287)
GST	1	0	1
HUS	(1.820)	1.627	(193)
JPM	(126)	0	(126)
MYC	103	(170)	(67)
MYI	(8)	32	24
SAL	(2)	0	(2)
SCX	(1.359)	1.634	275
SOG	12	0	12
SSB	581	(290)	291
TOR	3.613	(4.530)	(917)
UAG	(549)	592	43

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	113,29	76,22
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	27,56	57,07
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,21	k. A.

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Investmentfonds	5,30	0,10
Pensionsgeschäfte	0,20	0,19
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	0,06
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,18	(0,12)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,52	1,04
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,23)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(35,51)	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(23,17)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Argentinien	0,01	k. A.
Australien	1,65	1,76
Brasilien	k. A.	0,03
Kanada	0,52	0,83
Cayman-Inseln	0,03	0,19
Dänemark	5,92	6,36
Frankreich	13,08	9,38
Deutschland	0,40	0,32
Guernsey, Kanalinseln	0,08	0,06
Indien	k. A.	0,48
Irland	2,75	2,01
Italien	10,92	7,51
Japan	3,50	3,94
Luxemburg	0,01	0,01
Multinational	0,06	k. A.
Niederlande	2,34	1,99
Neuseeland	0,13	0,10
Peru	0,57	0,74
Katar	0,23	1,18
Slowenien	0,08	k. A.
Spanien	3,88	4,89
Schweden	1,03	1,03
Schweiz	k. A.	0,10
Großbritannien	10,68	10,77
USA	82,50	79,59
Kurzfristige Instrumente	1,69	0,02
Investmentfonds	5,30	0,10
Pensionsgeschäfte	0,20	0,19
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,03)	0,07
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,02)	(0,08)
Zinsswaps	0,19	(0,05)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	0,13	0,02
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	(0,02)
Inflation-Capped Options	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,12)	(0,02)
Zinsscaps	k. A.	0,00
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,01
Zinsswaps	k. A.	0,07
Devisenterminkontrakte	(1,20)	(0,62)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,72	1,61
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,23)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(48,00)	(34,56)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Real Return 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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>ELM PARK CLO DAC</b>			
<b>ARGENTINIEN</b>				<b>AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD.</b>				0,620 % fällig am 16.04.2029 € 6.874 \$ 8.423 0,33			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,500 % fällig am 15.01.2023 \$ 58 \$ 62 0,00				<b>FAIR OAKS LOAN FUNDING DAC</b>			
Pan American Energy LLC				Park Aerospace Holdings Ltd.				1,900 % fällig am 15.07.2031 5.200 6.406 0,25			
YPF S.A.				5,250 % fällig am 15.08.2022 41 43 0,00				<b>HALCYON LOAN ADVISORS EUROPEAN FUNDING DAC</b>			
38,259 % fällig am 04.03.2021 11.410 78 0,00				Summe Cayman Inseln 31.205 1,21				0,770 % fällig am 18.01.2031 1.000 1.220 0,05			
Summe Argentinien 121 0,00								<b>HARVEST CLO DAC</b>			
								0,630 % fällig am 18.11.2029 4.449 5.435 0,21			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>DÄNEMARK</b>				<b>MAN GLG EURO CLO DAC</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,870 % fällig am 15.01.2030 900 1.098 0,04			
<b>DRIVER AUSTRALIA FOUR TRUST</b>				<b>JYSKE REALKREDIT A/S</b>				<b>ORWELL PARK CLO DESIGNATED ACTIVITY CO.</b>			
0,960 % fällig am 21.08.2025 AUD 591 456 0,02				1,000 % fällig am 01.10.2050 DKK 33.003 5.508 0,21				0,780 % fällig am 18.07.2029 988 1.209 0,05			
				1,000 % fällig am 01.10.2053 40.300 6.722 0,26				<b>PALMER SQUARE EUROPEAN LOAN FUNDING DAC</b>			
				1,500 % fällig am 01.10.2050 6.543 1.106 0,04				0,870 % fällig am 15.02.2030 4.200 5.137 0,20			
				2,500 % fällig am 01.10.2047 7 1 0,00				<b>PURPLE FINANCE CLO DAC</b>			
				<b>NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB</b>				0,800 % fällig am 25.01.2031 1.700 2.077 0,08			
				1,000 % fällig am 01.10.2050 62.205 10.384 0,40				<b>TYMON PARK CLO LTD.</b>			
				2,500 % fällig am 01.10.2047 29 5 0,00				0,590 % fällig am 21.01.2029 756 925 0,03			
				<b>NYKREDIT REALKREDIT A/S</b>				40.529 1,57			
				1,000 % fällig am 01.10.2050 518.173 86.500 3,34							
				1,000 % fällig am 01.10.2053 78.200 13.041 0,51				<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
				1,500 % fällig am 01.10.2050 2.701 456 0,02				<b>EUROPEAN LOAN CONDUIT</b>			
				2,500 % fällig am 01.10.2047 6 1 0,00				1,000 % fällig am 17.02.2030 2.497 3.047 0,12			
Summe Australien 62.753 2,43				<b>REALKREDIT DANMARK A/S</b>				Summe Irland 43.576 1,69			
				2,500 % fällig am 01.04.2047 16 3 0,00							
				123.277 4,78							
<b>BRASILIEN</b>								<b>ITALIEN</b>			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV</b>				<b>DENMARK GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND</b>				<b>ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO</b>			
6,250 % fällig am 14.12.2026 £ 100 163 0,01				0,100 % fällig am 15.11.2023 (a) 96.816 16.619 0,65				0,100 % fällig am 15.05.2023 (a) 11.444 14.309 0,56			
				Summe Dänemark 139.896 5,43				0,400 % fällig am 15.05.2030 (a) 26.301 34.155 1,32			
								0,450 % fällig am 22.05.2023 (a) 15.793 19.655 0,76			
<b>KANADA</b>								1,250 % fällig am 15.09.2032 (a) 7.935 11.315 0,44			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								1,400 % fällig am 26.05.2025 (a) 57.898 75.008 2,91			
<b>TRANSCANADA PIPELINES LTD.</b>								2,550 % fällig am 15.09.2041 (a) 14.536 26.787 1,04			
3,750 % fällig am 16.10.2023 \$ 100 108 0,01								Summe Italien 181.229 7,03			
<b>STAATSEMISSIONEN</b>								<b>JAPAN</b>			
<b>CANADIAN GOVERNMENT REAL RETURN BOND</b>								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
0,500 % fällig am 01.12.2050 (a) CAD 8.145 8.008 0,31								<b>NTT FINANCE CORP.</b>			
1,250 % fällig am 01.12.2047 (a) 10.348 11.644 0,45								1,900 % fällig am 21.07.2021 \$ 200 201 0,01			
1,500 % fällig am 01.12.2044 (a) 2.426 2.743 0,11								<b>TOYOTA TSUSHO CORP.</b>			
4,000 % fällig am 01.12.2031 (a) 11.283 13.588 0,53								3,625 % fällig am 13.09.2023 800 860 0,03			
4,250 % fällig am 01.12.2021 (a) 25.237 20.776 0,80								1.061 0,04			
Summe Kanada 56.867 2,21											
								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
<b>CAYMAN INSELN</b>								<b>JAPAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND</b>			
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>								0,100 % fällig am 10.03.2026 (a) ¥ 3.613.126 35.136 1,36			
<b>CANYON CAPITAL CLO LTD.</b>								0,100 % fällig am 10.03.2027 (a) 588.717 5.728 0,22			
1,487 % fällig am 15.04.2029 \$ 5.500 5.505 0,21								0,100 % fällig am 10.03.2028 (a) 2.857.932 27.764 1,08			
<b>CROWN POINT CLO LTD.</b>								0,100 % fällig am 10.03.2029 (a) 1.457.556 14.188 0,55			
1,158 % fällig am 17.07.2028 2.135 2.132 0,08								Summe Japan 83.877 3,25			
<b>EVANS GROVE CLO LTD.</b>								<b>LUXEMBURG</b>			
1,144 % fällig am 28.05.2028 845 842 0,03								<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
<b>GREYSTONE COMMERCIAL REAL ESTATE NOTES</b>								<b>SES S.A.</b>			
1,339 % fällig am 15.09.2037 10.500 10.422 0,41								3,600 % fällig am 04.04.2023 \$ 500 529 0,02			
<b>HALCYON LOAN ADVISORS FUNDING LTD.</b>								<b>NIEDERLANDE</b>			
1,138 % fällig am 20.04.2027 314 312 0,01								<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
<b>ICG U.S. CLO LTD.</b>								<b>BABSON EURO CLO BV</b>			
1,596 % fällig am 22.10.2031 1.400 1.402 0,06								0,309 % fällig am 25.10.2029 € 244 296 0,01			
<b>OCP CLO LTD.</b>								<b>BARINGS EURO CLO BV</b>			
1,037 % fällig am 15.07.2027 98 97 0,00								0,680 % fällig am 27.07.2030 664 812 0,03			
<b>OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 31 LLC</b>								<b>CAIRM CLO BV</b>			
1,428 % fällig am 20.07.2030 300 300 0,01								0,650 % fällig am 20.10.2028 2.441 2.985 0,11			
<b>SHACKLETON CLO LTD.</b>								<b>CONTEGO CLO BV</b>			
1,348 % fällig am 20.10.2028 2.296 2.296 0,09								0,397 % fällig am 15.11.2026 2.838 3.445 0,13			
<b>STARWOOD COMMERCIAL MORTGAGE TRUST</b>								<b>EURO-GALAXY CLO BV</b>			
1,239 % fällig am 15.07.2038 5.200 5.181 0,20								0,750 % fällig am 17.01.2031 5.500 6.728 0,26			
<b>THL CREDIT WIND RIVER CLO LTD.</b>								0,820 % fällig am 10.11.2030 200 245 0,01			
1,107 % fällig am 15.10.2027 143 143 0,01								<b>GROSVENOR PLACE CLO BV</b>			
<b>TRALEE CLO LTD.</b>								0,720 % fällig am 30.10.2029 2.037 2.489 0,10			
1,248 % fällig am 20.10.2027 666 665 0,03											
<b>VENTURE CLO LTD.</b>											
1,117 % fällig am 15.07.2027 1.608 1.603 0,06											
1,366 % fällig am 22.10.2031 200 200 0,01											
31.100 1,21											

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
Jubilee CLO BV 0,257 % fällig am 15.12.2029	€ 760	\$ 926	0,04	Lloyds Banking Group PLC 1,039 % fällig am 21.06.2021	\$ 1.400	\$ 1.405	0,05	Citigroup Mortgage Loan Trust 0,293 % fällig am 25.09.2036	\$ 810	\$ 780	0,03
Tikehau CLO BV 0,600 % fällig am 04.08.2028	1.188	1.452	0,06	Natwest Group PLC 1,801 % fällig am 25.06.2024	2.200	2.241	0,09	Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates	1.537	1.523	0,06
		19.378	0,75	4,519 % fällig am 25.06.2024	1.400	1.529	0,06	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 0,553 % fällig am 25.08.2036	1.079	1.072	0,04
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				8,625 % fällig am 15.08.2021 (b)(d)	200	208	0,01	0,838 % fällig am 25.10.2035 ^	3.100	2.933	0,11
Cooperative Rabobank UA 6,625 % fällig am 29.06.2021 (b)(d)	1.000	1.259	0,05	NatWest Markets PLC 0,359 % fällig am 27.09.2021	€ 400	492	0,02	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 0,678 % fällig am 25.02.2036	770	767	0,03
ING Bank NV 2,625 % fällig am 05.12.2022	\$ 3.200	3.342	0,13			8.443	0,33	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 0,768 % fällig am 25.01.2032	2	2	0,00
JT International Financial Services BV 3,500 % fällig am 28.09.2023	2.700	2.913	0,11	<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Ellington Loan Acquisition Trust 1,248 % fällig am 25.05.2037	1.160	1.161	0,04
NXP BV 3,875 % fällig am 01.09.2022	200	211	0,01	Canada Square Funding PLC 1,156 % fällig am 17.10.2051	£ 6.265	8.574	0,33	Encore Credit Receivables Trust 1,048 % fällig am 25.01.2036	1.400	1.364	0,05
4,625 % fällig am 01.06.2023	200	219	0,01	Finsbury Square PLC 1,084 % fällig am 16.09.2069	5.151	7.062	0,27	First Franklin Mortgage Loan Trust 0,458 % fällig am 25.07.2036	1.561	1.492	0,06
		7.944	0,31	Great Hall Mortgages PLC 0,167 % fällig am 18.03.2039	84	113	0,01	1,018 % fällig am 25.09.2035	3.465	3.441	0,13
Summe Niederlande		27.322	1,06	0,187 % fällig am 18.06.2038	76	102	0,00	Home Equity Asset Trust 1,003 % fällig am 25.08.2034	90	90	0,00
<b>NEUSEELAND</b>				Hawksmoor Mortgages PLC 1,104 % fällig am 25.05.2053	10.569	14.471	0,56	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 0,788 % fällig am 25.03.2036	4.645	4.554	0,18
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Paragon Mortgages PLC 0,286 % fällig am 15.01.2039	9.782	13.142	0,51	HSI Asset Securitization Corp. Trust 1,165 % fällig am 25.05.2037	699	688	0,03
New Zealand Government International Bond 2,000 % fällig am 20.09.2025	NZD33.694	27.203	1,05	Towd Point Mortgage Funding PLC 1,073 % fällig am 20.10.2051	5.816	7.982	0,31	Massachusetts Educational Financing Authority 1,165 % fällig am 25.04.2038	72	72	0,00
3,000 % fällig am 20.09.2030	1.035	996	0,04	Twin Bridges PLC 1,204 % fällig am 12.06.2053	6.765	9.271	0,36	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,808 % fällig am 25.01.2035	1.867	1.813	0,07
Summe Neuseeland		28.199	1,09			60.717	2,35	New Century Home Equity Loan Trust 0,868 % fällig am 25.10.2035	1.500	1.474	0,06
<b>PERU</b>				<b>STAATSEMISSIONEN</b>				0,913 % fällig am 25.02.2035	2.781	2.730	0,11
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				United Kingdom Gilt				Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 0,583 % fällig am 25.03.2036	1.500	1.469	0,06
Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 7.900	2.726	0,11	0,125 % fällig am 10.08.2028 (a)	25.400	43.879	1,70	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates	163	163	0,01
6,150 % fällig am 12.08.2032	17.100	5.804	0,22	0,125 % fällig am 22.03.2029 (a)	12.024	21.104	0,82	Saxon Asset Securities Trust 1,190 % fällig am 25.09.2037	1.506	1.465	0,06
Summe Peru		8.530	0,33	0,125 % fällig am 22.11.2036 (a)	18.211	38.859	1,51	0,868 % fällig am 25.05.2035	4.544	4.453	0,17
<b>KATAR</b>				0,125 % fällig am 10.08.2041 (a)	13.575	31.795	1,23	SLM Student Loan Trust 1,715 % fällig am 25.04.2023	119	119	0,00
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				0,125 % fällig am 22.03.2044 (a)	1	3	0,00				
Qatar Government International Bond 3,875 % fällig am 23.04.2023	\$ 2.200	2.367	0,09	0,125 % fällig am 10.08.2048 (a)	3.031	8.110	0,31	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>			
				0,125 % fällig am 22.11.2056 (a)	7.276	22.617	0,88	AbbVie, Inc. 2,300 % fällig am 14.05.2021	100	101	0,00
<b>SLOWENIEN</b>				0,125 % fällig am 22.03.2068 (a)	8.192	30.665	1,19	Ally Financial, Inc. 4,125 % fällig am 13.02.2022	200	208	0,01
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,125 % fällig am 22.03.2052 (a)	1.768	7.123	0,28	Charter Communications Operating LLC 4,464 % fällig am 23.07.2022	1.100	1.160	0,05
Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 1.100	1.221	0,05	0,250 % fällig am 22.03.2040 (a)	8.301	24.364	0,95	Cox Communications, Inc. 3,250 % fällig am 15.12.2022	900	948	0,04
				0,375 % fällig am 22.03.2062 (a)	23.861	87.207	3,38	CVS Health Corp. 3,350 % fällig am 09.03.2021	54	54	0,00
<b>SPANIEN</b>				0,500 % fällig am 22.03.2050 (a)	7.585	22.555	0,87	3,700 % fällig am 09.03.2023	14	15	0,00
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				0,625 % fällig am 22.03.2040 (a)	7.014	17.204	0,67	Duke Energy Corp. 2,400 % fällig am 15.08.2022	100	103	0,00
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	3.189	3.907	0,15	0,625 % fällig am 22.11.2042 (a)	3.603	9.382	0,36	Energy Transfer Operating LP 3,600 % fällig am 01.02.2023	100	105	0,00
				0,625 % fällig am 22.10.2050	17.600	23.318	0,90	4,250 % fällig am 15.03.2023	100	106	0,00
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				0,750 % fällig am 22.11.2047 (a)	25.114	74.633	2,90	Eversource Energy 2,900 % fällig am 01.10.2024	100	108	0,01
Telefonica Emisiones S.A. 5,462 % fällig am 16.02.2021	\$ 700	704	0,03	1,250 % fällig am 22.11.2027 (a)	18.346	33.253	1,29	Ford Motor Credit Co. LLC 3,550 % fällig am 07.10.2022	2.100	2.146	0,08
				1,250 % fällig am 22.11.2032 (a)	68.332	148.361	5,75	Keurig Dr Pepper, Inc. 3,551 % fällig am 25.05.2021	3.600	3.645	0,14
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				1,250 % fällig am 22.11.2055 (a)	18.960	73.367	2,85	Lehman Brothers Holdings, Inc. 0,000 % fällig am 05.03.2010 ^	€ 950	16	0,00
Spain Government International Bond 0,150 % fällig am 30.11.2023 (a)	€17.039	21.770	0,84	4,125 % fällig am 22.07.2030	850	2.046	0,08	0,000 % fällig am 05.04.2011 ^	10	0	0,00
0,500 % fällig am 30.04.2030	22.000	28.218	1,10	4,250 % fällig am 07.12.2055	2.200	6.319	0,25	Nissan Motor Acceptance Corp. 2,600 % fällig am 28.09.2022	\$ 500	513	0,02
0,700 % fällig am 30.11.2033 (a)	1	1	0,00					2,650 % fällig am 13.07.2022	1.900	1.946	0,08
1,000 % fällig am 30.11.2030 (a)	2.359	3.468	0,13	Summe Großbritannien		726.164	28,17	RELX Capital, Inc. 3,500 % fällig am 16.03.2023	200	213	0,01
1,250 % fällig am 31.10.2030	4.100	5.610	0,22	<b>USA</b>							
1,450 % fällig am 31.10.2027	13.400	18.311	0,71	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>							
1,450 % fällig am 30.04.2029	5.700	7.882	0,31	Accredited Mortgage Loan Trust 0,408 % fällig am 25.09.2036	\$ 4.093	4.008	0,16				
		85.260	3,31	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 1,198 % fällig am 25.12.2033	1.792	1.776	0,07				
Summe Spanien		89.871	3,49	Aegis Asset-Backed Securities Trust 0,588 % fällig am 25.06.2035	93	93	0,00				
<b>SCHWEDEN</b>				AMRESO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust 1,088 % fällig am 25.06.2029	9	9	0,00				
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Asset-Backed Funding Certificates Trust 0,748 % fällig am 25.10.2034	1.157	1.141	0,04				
Sweden Government International Bond 0,125 % fällig am 01.06.2032	SEK48.137	7.009	0,27	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust 1,509 % fällig am 15.04.2033	318	318	0,01				
				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 0,348 % fällig am 25.12.2036	773	774	0,03				
<b>GROSSBRITANNIEN</b>				1,123 % fällig am 25.05.2035	961	958	0,04				
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Carrington Mortgage Loan Trust 0,398 % fällig am 25.04.2036	12.546	10.718	0,42				
FCE Bank PLC 0,869 % fällig am 13.09.2021	€ 2.100	2.568	0,10	CIT Mortgage Loan Trust 1,498 % fällig am 25.10.2037	534	537	0,02				



Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 136,000 EUR auf Euro-Bobl 10-Year Bond March 2021 Futures <sup>(1)</sup>	Short	02.2021	321	\$ 38	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2021	1.086	24	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2021	151	(178)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	310	(177)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	81	289	0,01
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	177	(109)	0,00
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2021	1.276	128	0,01
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	15	0	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2021	532	(111)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	2.412	580	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	3.365	(310)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	428	213	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	224	(311)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	54	(48)	0,00
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	182	(211)	(0,01)
				\$ (133)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (133)	(0,01)

<sup>(1)</sup> 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.06.2022	\$ 100	\$ (10)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	800	54	0,00
				\$ 44	0,00

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 9.700	\$ (275)	(0,01)

#### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,394 %	21.11.2023	\$ 78.100	\$ (77)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2023	€ 15.350	13	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	76.500	(12)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	0,500	15.05.2027	13.500	445	0,02
Erhalt	CPTFEMU	1,087	15.02.2030	14.750	(252)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	1,710	15.03.2033	5.900	(262)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	0,860	15.06.2021	\$ 26.900	(318)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,488	01.10.2021	16.200	(73)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,760	04.11.2029	23.300	(841)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA	1,883	20.11.2029	300	(7)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	6.200	(82)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	1.800	(12)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,210	05.02.2023	21.840	(383)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,263	09.05.2023	6.846	(160)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	800	33	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,370	06.06.2028	12.900	525	0,02
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	700	30	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,500	15.07.2022	38.000	1.506	0,06
Zahlung	UKRPI	3,346	15.05.2030	€ 2.550	33	0,00
Zahlung	UKRPI	3,475	15.08.2030	33.600	330	0,01
				\$ 436	0,02	
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ 205	0,01	

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann (i) erhält der Fonds vom Sicherungsgeber einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) erhält der Fonds 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 Global Real Return 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.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
HUS	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,315	07.01.2021	36.400	\$ 462	\$ 5	0,00

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	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	\$ 502	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	8.440	642	576	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	4.500	505	497	0,02
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	4.360	326	297	0,01
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	5.900	650	651	0,03
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,344	17.11.2022	183.700	206	303	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	7.000	510	483	0,02
							\$ 2.845	\$ 3.309	0,13

##### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.02.2051	\$ 66,000	04.02.2021	81.900	\$ 3	\$ 0	0,00

##### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700 %	17.03.2021	8.600	\$ (12)	\$ (11)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	1.400	(10)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	15.400	(12)	(9)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	6.700	(6)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	10.300	(14)	(14)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	15.400	(15)	(17)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	6.700	(8)	(6)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	4.700	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	4.700	(7)	(8)	0,00
BRC	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	45.800	(23)	(22)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	45.800	(79)	(78)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	13.800	(22)	(21)	0,00
GST	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	4.900	(4)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	10.700	(7)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	10.700	(12)	(12)	0,00
						\$ (234)	\$ (214)	(0,01)

##### INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	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)	\$ (7)	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)	\$ (7)	0,00

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	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	\$ (465)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	25.850	(641)	(547)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	13.500	(495)	(495)	(0,02)
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	12.450	(306)	(263)	(0,01)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526 %	17.11.2022	153.100	\$ (238)	\$ (204)	(0,01)
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	17.700	(638)	(650)	(0,02)
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	21.100	(512)	(444)	(0,02)
							\$ (2.830)	\$ (3.068)	(0,12)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	\$ 102.906	11.03.2021	900	\$ (3)	\$ (6)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103.773	11.02.2021	3.000	(5)	(3)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103.578	11.03.2021	4.300	(10)	(19)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104.000	11.03.2021	900	(2)	(4)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104.125	14.04.2021	1.100	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102.141	04.03.2021	500	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	104.141	04.03.2021	500	(1)	(1)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98.406	04.02.2021	8.700	(27)	(35)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102.750	04.02.2021	1.400	(4)	(4)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	103.750	04.02.2021	1.400	(3)	(6)	0,00
					\$ (59)	\$ (82)	0,00

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 12.200	\$ (713)	\$ 861	\$ 148	0,01
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.500	(5)	25	20	0,00
					\$ (718)	\$ 886	\$ 168	0,01

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	01.2021	AUD 18.337	\$ 13.540	\$ 0	\$ (610)	\$ (610)	(0,02)
	01.2021	¥ 4.202.970	\$ 40.413	0	(297)	(297)	(0,01)
BPS	01.2021	SGD 1	1	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 9.267	€ 7.593	24	0	24	0,00
	01.2021	4.598	£ 3.443	108	0	108	0,00
	02.2021	DKK 197.702	\$ 31.552	0	(966)	(966)	(0,04)
BRC	01.2021	BRL 951	179	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	€ 6.555	8.010	0	(11)	(11)	0,00
	01.2021	\$ 183	BRL 951	0	0	0	0,00
	01.2021	1.200	£ 881	4	0	4	0,00
CBK	01.2021	BRL 951	\$ 183	0	0	0	0,00
	01.2021	€ 3.645	4.398	0	(62)	(62)	0,00
	01.2021	£ 2.541	3.396	0	(77)	(77)	0,00
	01.2021	¥ 409.751	3.934	0	(35)	(35)	0,00
	01.2021	\$ 188	BRL 951	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	6	RUB 443	0	0	0	0,00
	02.2021	BRL 951	\$ 188	5	0	5	0,00
	02.2021	DKK 207.441	33.240	0	(879)	(879)	(0,03)
	02.2021	PEN 23.027	6.397	29	0	29	0,00
	02.2021	\$ 7	RUB 514	0	0	0	0,00
	03.2021	PEN 9.470	\$ 2.669	50	0	50	0,00
	03.2021	\$ 267	MXN 5.448	4	0	4	0,00
GLM	01.2021	NZD 39.242	\$ 27.561	0	(693)	(693)	(0,03)
	01.2021	\$ 83.270	¥ 8.618.542	210	0	210	0,01
	01.2021	7	RUB 551	0	0	0	0,00
	02.2021	DKK 190.500	\$ 30.642	0	(691)	(691)	(0,03)
	02.2021	¥ 8.618.542	83.294	0	(212)	(212)	(0,01)
	02.2021	\$ 1.818	DKK 11.005	0	(7)	(7)	0,00
HUS	01.2021	AUD 12.970	\$ 9.627	0	(382)	(382)	(0,01)
	01.2021	€ 40.547	49.256	0	(359)	(359)	(0,01)
	01.2021	£ 56.749	75.900	0	(1.676)	(1.676)	(0,07)
	01.2021	¥ 756.975	7.264	0	(69)	(69)	0,00
	01.2021	SEK 59.826	7.032	0	(253)	(253)	(0,01)
	01.2021	\$ 14.141	€ 11.579	31	(3)	28	0,00
	02.2021	28	RUB 2.058	0	0	0	0,00
	03.2021	212	CNY 1.409	3	0	3	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Real Return 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
JPM	03.2021	\$ 245	IDR 3.512.288	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
	01.2021	AUD 13.861	\$ 10.199	0	(498)	(498)	(0,02)
	01.2021	CLP 516.558	657	0	(70)	(70)	0,00
MYI	01.2021	€ 6.168	7.532	0	(16)	(16)	0,00
	01.2021	6.271	7.687	13	0	13	0,00
	01.2021	£ 11.854	16.018	0	(187)	(187)	(0,01)
SCX	01.2021	\$ 62	£ 46	1	0	1	0,00
	01.2021	AUD 8.094	\$ 5.962	0	(283)	(283)	(0,01)
	01.2021	€ 303.174	363.079	0	(7.869)	(7.869)	(0,31)
	01.2021	£ 50.112	66.986	0	(1.517)	(1.517)	(0,06)
	01.2021	\$ 1.007	£ 747	14	0	14	0,00
SSB	02.2021	125	ILS 428	9	0	9	0,00
	01.2021	£ 451.142	\$ 602.195	0	(14.512)	(14.512)	(0,56)
TOR	01.2021	CAD 71.932	55.523	0	(938)	(938)	(0,04)
	01.2021	€ 255.010	305.398	0	(6.619)	(6.619)	(0,26)
	01.2021	¥ 3.248.845	31.143	0	(326)	(326)	(0,01)
	01.2021	\$ 56.461	CAD 71.932	0	0	0	0,00
	02.2021	CAD 71.932	\$ 56.467	0	(1)	(1)	0,00
UAG	02.2021	€ 559.658	685.230	0	(6)	(6)	0,00
	01.2021	AUD 27.237	20.026	0	(993)	(993)	(0,04)
	01.2021	£ 6.466	8.676	0	(163)	(163)	(0,01)
	02.2021	DKK 247.328	39.600	0	(1.080)	(1.080)	(0,04)
02.2021	\$ 24	RUB 1.830	0	0	0	0,00	
				\$ 511	\$ (42.369)	\$ (41.858)	(1,63)

### ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen fur die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschuttend und Investor 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	01.2021	CHF 74	\$ 83	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 32.443	CHF 29.304	711	0	711	0,03
BPS	01.2021	2.375	2.109	12	0	12	0,00
	01.2021	118	105	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	CHF 8	\$ 9	0	0	0	0,00
	01.2021	93	105	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2021	\$ 32.634	CHF 29.556	805	0	805	0,03
	01.2021	CHF 11	\$ 12	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	\$ 316	CHF 286	8	0	8	0,00
	01.2021	32.990	29.729	645	0	645	0,02
UAG	01.2021	838	743	2	0	2	0,00
				\$ 2.184	\$ (1)	\$ 2.183	0,08

Zum 31. Dezember 2020 standen fur die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E 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	01.2021	\$ 1.656	€ 1.348	\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00
	01.2021	€ 2	\$ 2	0	0	0	0,00
BPS	01.2021	\$ 435.672	€ 363.471	9.076	(21)	9.055	0,35
	01.2021	1.393	1.140	2	0	2	0,00
CBK	01.2021	4.795	3.986	83	0	83	0,01
	01.2021	34.331	28.313	318	(4)	314	0,01
JPM	01.2021	2.021	1.655	4	0	4	0,00
	01.2021	14.335	11.753	47	0	47	0,00
SCX	01.2021	465.291	388.517	10.077	0	10.077	0,39
	02.2021	745.906	609.207	0	(3)	(3)	0,00
TOR	01.2021	438.703	366.316	9.502	0	9.502	0,37
	02.2021	604.331	493.578	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 29.109	\$ (37)	\$ 29.072	1,13

Zum 31. Dezember 2020 standen fur die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschuttend, Class E GBP (Hedged) ausschuttend und Class R GBP (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
BPS	01.2021	\$ 1.188	£ 886	\$ 23	\$ 0	\$ 23	0,00
	01.2021	1.470	1.093	24	0	24	0,00
CBK	01.2021	55.953	41.857	1.266	0	1.266	0,05
	01.2021	£ 231	\$ 312	0	(3)	(3)	0,00
HUS	01.2021	\$ 56.997	£ 42.617	1.261	0	1.261	0,05
	01.2021	60	45	1	0	1	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	01.2021	\$ 541	£ 404	\$ 11	\$ 0	\$ 11	0,00
SSB	01.2021	60.751	45.512	1.464	0	1.464	0,06
				\$ 4.050	\$ (3)	\$ 4.047	0,16

Zum 31. Dezember 2020 standen fur die Anteilsklasse Institutional SGD (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
BPS	01.2021	SGD 62.545	\$ 47.147	\$ 0	\$ (177)	\$ (177)	(0,01)
	02.2021	\$ 47.149	SGD 62.545	176	0	176	0,01
MYI	01.2021	SGD 31.795	\$ 23.894	0	(164)	(164)	(0,01)
	01.2021	\$ 23.602	SGD 31.563	279	0	279	0,01
	02.2021	23.895	31.795	163	0	163	0,01
NGF	01.2021	SGD 60.501	\$ 45.404	0	(372)	(372)	(0,01)
	01.2021	\$ 45.597	SGD 61.122	650	0	650	0,02
	02.2021	45.406	60.501	373	0	373	0,01
SCX	01.2021	45.833	61.504	703	0	703	0,03
SSB	01.2021	487	654	7	0	7	0,00
				\$ 2.351	\$ (713)	\$ 1.638	0,06

Zum 31. Dezember 2020 standen fur die Anteilsklasse Institutional USD (Currency Exposure) 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	01.2021	\$ 1.120	¥ 116.447	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
BPS	01.2021	641	AUD 872	31	0	31	0,00
	02.2021	218	DKK 1.351	4	0	4	0,00
CBK	01.2021	109	¥ 11.353	1	0	1	0,00
	01.2021	298	NZD 424	7	0	7	0,00
GLM	01.2021	¥ 238.784	\$ 2.307	0	(6)	(6)	0,00
	02.2021	\$ 2.308	¥ 238.784	6	0	6	0,00
HUS	01.2021	24.406	£ 18.248	540	0	540	0,02
	01.2021	201	¥ 20.973	2	0	2	0,00
	01.2021	659	SEK 5.609	24	0	24	0,00
SCX	01.2021	14.763	€ 12.327	320	0	320	0,02
	02.2021	15.093	12.327	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	CAD 1.735	\$ 1.362	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 1.339	CAD 1.735	23	0	23	0,00
	01.2021	863	¥ 90.012	9	0	9	0,00
	02.2021	1.362	CAD 1.735	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	204	AUD 278	10	0	10	0,00
				\$ 985	\$ (6)	\$ 979	0,04

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (3.828) (0,15)

Summe Anlagen

\$ 3.675.193 142,56

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (1.097.131) (42,56)

Nettovermogen

\$ 2.578.062 100,00

## 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) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(b) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar

(c) Mit dem Fonds verbunden.

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(e) Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 783.734 als Sicherheiten verpfandet.

(f) Gema den Rahmenvertragen fur Wertpapier-Termingeschafte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.811 als Sicherheiten fur verzogert gelieferte Wertpapiere oder Ruckkauf-Finanzierungsgeschafte verpfandet oder geliefert.

Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 6.742 und Barmittel in Hohe von USD 6.149 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Hohe von USD 14.945 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Hohe von USD 14.640 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Real Return Fund (Forts.)

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(133)	(3.620)	(3)	(3.756)
<b>Summen</b>	<b>\$ 43.353</b>	<b>\$ 3.631.843</b>	<b>\$ (3)</b>	<b>\$ 3.675.193</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 2.715.380	\$ 10.110	\$ 2.725.490
Investmentfonds	15.104	0	0	15.104
Pensionsgeschäfte	0	1.277	0	1.277
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	539	(14.000)	0	(13.461)
<b>Summen</b>	<b>\$ 15.643</b>	<b>\$ 2.702.657</b>	<b>\$ 10.110</b>	<b>\$ 2.728.410</b>

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

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

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

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOM	0,170 %	13.10.2020	13.01.2021	\$ (100.524)	\$ (100.562)	(3,90)
	0,170	18.11.2020	19.01.2021	(134.647)	(134.675)	(5,22)
CIB	0,160	29.12.2020	19.01.2021	(96.468)	(96.470)	(3,74)
GRE	0,170	03.11.2020	03.02.2021	(9.742)	(9.745)	(0,38)
	0,180	28.10.2020	27.01.2021	(118.606)	(118.644)	(4,60)
	0,180	05.11.2020	05.01.2021	(206.200)	(206.259)	(8,00)
IND	0,150	16.12.2020	11.02.2021	(48.304)	(48.308)	(1,88)
SCX	0,160	10.12.2020	11.01.2021	(54.700)	(54.705)	(2,12)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (769.368)</b>	<b>(29,84)</b>

### Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	% des Nettovermögens
BPG	0,180 %	10.11.2020	27.01.2021	\$ (1.770)	\$ (1.770)	(0,07)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (1.770)</b>	<b>(0,07)</b>

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (205)	\$ 0	\$ (205)
BPS	8.294	(10.190)	(1.896)
BRC	(71)	0	(71)
CBK	387	50	437
GLM	(1.605)	1.340	(265)
GST	130	0	130
HUS	(559)	340	(219)
JPM	(616)	580	(36)
MYC	342	(597)	(255)
MYI	958	(890)	68
NGF	651	(560)	91
SAL	(25)	0	(25)
SCX	1.470	(2.210)	(740)
SSB	(12.396)	10.050	(2.346)
TOR	1.641	(2.450)	(809)
UAG	(2.224)	2.280	56

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	109,80	92,59
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	30,65	56,23
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,53	k. A.
Investmentfonds	1,69	0,83
Pensionsgeschäfte	0,04	0,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	(0,31)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,15)	(0,45)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(29,84)	(36,42)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,07)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Argentinien		
	0,00	k. A.
Australien	2,43	2,58
Brasilien	0,01	0,23
Kanada	2,21	2,91
Cayman-Inseln	1,21	1,46
Dänemark	5,43	5,85
Frankreich	15,15	7,30
Deutschland	0,48	0,68
Guernsey, Kanalinseln	0,10	0,14
Irland	1,69	1,63
Italien	7,03	6,95
Japan	3,25	5,46
Luxemburg	0,02	k. A.
Niederlande	1,06	1,65
Neuseeland	1,09	2,07
Peru	0,33	0,47
Katar	0,09	0,67
Slowenien	0,05	k. A.
Spanien	3,49	8,15
Schweden	0,27	0,34
Großbritannien	30,85	29,59
USA	64,73	70,68
Kurzfristige Instrumente	0,01	0,01
Investmentfonds	1,69	0,83
Pensionsgeschäfte	0,04	0,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	0,04
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(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	(0,01)	(0,15)
Zinsswaps	0,02	(0,16)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	0,13	0,01
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Inflation-Capped Options	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,12)	(0,02)
Zinsscaps	k. A.	0,00
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,01
Zinsswaps	k. A.	(0,18)
Devisenterminkontrakte	(1,63)	(1,40)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,47	1,15
Sonstige Aktiva und Passiva	(42,56)	(48,99)
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			
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>														
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>														
Advanz Pharma Corp. 6,500 % fällig am 06.09.2024	\$	23.455	\$ 22.927	0,03	Fleet U.S. Bidco, Inc. 3,397 % fällig am 07.10.2026	1.227	1.221	0,00	PetSmart, Inc. 4,500 % fällig am 11.03.2022	89.231	89.231	0,13		
AI Convoy (Luxembourg) SARL 3,750 % fällig am 17.01.2027	€	7.000	8.566	0,01	Forest City Enterprises LP 3,647 % fällig am 08.12.2025	12.544	12.038	0,02	Playtika Holding Corp. 7,000 % fällig am 10.12.2024	5.181	5.224	0,01		
4,500 % fällig am 17.01.2027	\$	3.375	3.378	0,01	Froneri International PLC 2,397 % fällig am 31.01.2027	14.776	14.658	0,02	Prestige Brands, Inc. 2,147 % fällig am 26.01.2024	165	165	0,00		
Alphabet Holding Co., Inc. 3,647 % fällig am 26.09.2024		4.257	4.228	0,01	€	13.000	15.720	0,02	PUG LLC 3,647 % fällig am 12.02.2027	4.366	4.180	0,01		
Alice France S.A. 3,846 % fällig am 31.01.2026		622	618	0,00	\$	381	380	0,00	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 3,897 % fällig am 16.11.2025	5.539	5.529	0,01		
4,237 % fällig am 14.08.2026		28.812	28.743	0,04	Gardner Denver, Inc. 1,897 % fällig am 01.03.2027	349	345	0,00	Reynolds Consumer Products LLC 1,897 % fällig am 04.02.2027	6.747	6.715	0,01		
American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 2,147 % fällig am 15.01.2027		43.450	43.106	0,06	Gates Global LLC 3,750 % fällig am 01.04.2024	2.622	2.619	0,00	Reynolds Group Holdings, Inc. 2,897 % fällig am 05.02.2023	1.124	1.120	0,00		
Aramark Services, Inc. 1,895 % fällig am 11.03.2025		6.716	6.649	0,01	Genesee & Wyoming, Inc. 2,254 % fällig am 30.12.2026	21.934	21.915	0,03	RPI Intermediate Finance Trust 1,897 % fällig am 11.02.2027	3.025	3.026	0,01		
Avantor Funding, Inc. 3,250 % fällig am 21.11.2024		1.714	1.718	0,00	Golden Nugget, Inc. 3,250 % fällig am 04.10.2023	8.477	8.215	0,01	SBA Senior Finance LLC 1,900 % fällig am 11.04.2025	3.120	3.091	0,00		
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 2,250 % fällig am 12.02.2027		10.173	10.042	0,01	Gray Television, Inc. 2,655 % fällig am 02.01.2026	8.157	8.112	0,01	Sequa Mezzanine Holdings LLC 7,750 % fällig am 28.11.2023	39.090	39.383	0,06		
2,500 % fällig am 15.01.2025		21.326	21.165	0,03	Grifols Worldwide Operations USA, Inc. 2,102 % fällig am 15.11.2027	21.073	20.881	0,03	10,000 % fällig am 23.07.2025	68.784	66.721	0,09		
Axalta Coating Systems U.S. Holdings, Inc. 2,001 % fällig am 01.06.2024		2.386	2.371	0,00	HCA, Inc. 1,897 % fällig am 13.03.2025	9.043	9.058	0,01	Sequa Mezzanine Holdings LLC (11,750 % bar und 6,750 % PIK) 18,500 % fällig am 28.04.2024 (c)	11.853	10.357	0,02		
Banjay Entertainment S.A.S. 3,903 % fällig am 01.03.2025		1.746	1.728	0,00	1,897 % fällig am 18.03.2026	7.190	7.199	0,01	Serta Simmons Bedding LLC 4,500 % fällig am 08.11.2023	1.444	730	0,00		
Bausch Health Cos., Inc. 2,898 % fällig am 27.11.2025		7.860	7.802	0,01	Hilton Worldwide Finance LLC 1,898 % fällig am 22.06.2026	64.007	63.395	0,09	Sierra Hamilton LLC 15,000 % fällig am 12.09.2023	66	66	0,00		
3,148 % fällig am 02.06.2025		6.088	6.072	0,01	iHeartCommunications, Inc. 3,147 % fällig am 01.05.2026	298.183	293.835	0,41	66	66	0,00			
Beacon Roofing Supply, Inc. 2,397 % fällig am 02.01.2025		3.890	3.870	0,01	4,750 % fällig am 01.05.2026	44.477	44.384	0,06	Sigma Bidco BV 3,500 % fällig am 02.07.2025	€	28.800	34.717	0,05	
BWAY Holding Co. 3,480 % fällig am 03.04.2024		3.320	3.220	0,01	Illuminate Buyer LLC 4,147 % fällig am 30.06.2027	3.791	3.798	0,01	Sinclair Television Group, Inc. 2,650 % fällig am 30.09.2026	\$	7.153	7.095	0,01	
Caesars Resort Collection LLC 2,897 % fällig am 23.12.2024		43.850	43.113	0,06	INEOS Finance PLC 2,500 % fällig am 01.04.2024	€	42.818	51.784	0,07	Sotera Health Holdings LLC 5,500 % fällig am 11.12.2026	13.837	13.908	0,02	
4,647 % fällig am 21.07.2025		31.400	31.496	0,04	Ingersoll Rand Co. Ltd. 1,897 % fällig am 01.03.2027	\$	12.267	12.121	0,02	SS&C Technologies, Inc. 1,897 % fällig am 16.04.2025	30.008	29.728	0,04	
Camelot U.S. Acquisition 1 Co. 3,147 % fällig am 30.10.2026		1.980	1.974	0,00	Intelsat Jackson Holdings S.A. 3,600 % - 6,500 % fällig am 13.07.2022	37.413	38.302	0,05	Starfruit Finco BV 3,153 % fällig am 01.10.2025	22.386	22.170	0,03		
Carnival Corp. 7,500 % fällig am 30.06.2025	€	44.178	55.585	0,08	8,000 % fällig am 27.11.2023	132.233	134.024	0,19	Sunshine Luxembourg SARL 3,500 % fällig am 01.10.2026	€	4.600	5.626	0,01	
8,500 % fällig am 30.06.2025	\$	110.425	114.400	0,16	8,750 % fällig am 02.01.2024	2.700	2.751	0,00	4,254 % fällig am 01.10.2026	\$	31.088	31.218	0,04	
CenturyLink, Inc. 2,397 % fällig am 15.03.2027		52.862	52.323	0,07	IRB Holding Corp. TBD% fällig am 05.02.2025	12.303	12.221	0,02	Syniverse Holdings, Inc. 6,000 % fällig am 09.03.2023	14.144	12.875	0,02		
Charter Communications Operating LLC 1,900 % fällig am 01.02.2027		66.083	65.830	0,09	Jefferies Finance LLC 3,147 % fällig am 03.06.2026	4.931	4.904	0,01	TransDigm, Inc. 2,397 % fällig am 22.08.2024	9.171	9.018	0,01		
CityCenter Holdings LLC 2,397 % fällig am 18.04.2024		2.992	2.959	0,00	KFC Holding Co. 1,908 % fällig am 03.04.2025	16.918	16.854	0,02	U.S. Renal Care, Inc. 5,147 % fällig am 26.06.2026	16.710	16.662	0,02		
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. 3,714 % fällig am 21.08.2026		20.181	19.471	0,03	Lealand Finance Company B.V. (1,147 % bar und 3,000 % PIK) 4,147 % fällig am 30.06.2025 (c)	6.138	4.194	0,01	Univision Communications, Inc. 3,750 % fällig am 15.03.2024	198.633	197.640	0,28		
CommScope, Inc. 3,397 % fällig am 06.04.2026		18.170	18.089	0,03	McDermott Technology Americas, Inc. TBD% fällig am 30.06.2024	2.771	2.286	0,00	Valaris PLC TBD% fällig am 17.08.2021	2.486	2.469	0,00		
Core & Main LP 3,750 % fällig am 01.08.2024		3.463	3.457	0,01	Meredith Corp. 2,647 % fällig am 31.01.2025	1.415	1.404	0,00	VFH Parent LLC 3,153 % fällig am 01.03.2026	2.057	2.061	0,00		
CSC Holdings LLC 2,659 % fällig am 15.04.2027		5.487	5.454	0,01	Messer Industrie GmbH TBD% fällig am 01.03.2026	7.737	7.689	0,01	VICI Properties LLC 1,894 % fällig am 20.12.2024	29.543	29.125	0,04		
Dell International LLC 2,750 % fällig am 19.09.2025		42.459	42.537	0,06	MH Sub LLC 3,647 % fällig am 13.09.2024	9.036	8.939	0,01	VS Buyer LLC 3,397 % fällig am 28.02.2027	2.487	2.480	0,00		
Delos Finance SARL 2,004 % fällig am 06.10.2023		8.226	8.226	0,01	Nascar Holdings, Inc. 2,897 % fällig am 19.10.2026	3.891	3.881	0,01	Westmoreland Mining Holdings LLC 9,250 % fällig am 15.03.2022	321	299	0,00		
Delta Air Lines, Inc. 4,750 % fällig am 20.10.2027		17.300	17.973	0,03	NCI Building Systems, Inc. 3,904 % fällig am 12.04.2025	38.119	38.119	0,05	Westmoreland Mining Holdings LLC (15,000 % PIK) TBD% fällig am 15.03.2029 (c)	3.867	1.934	0,00		
5,750 % fällig am 29.04.2023		12.168	12.386	0,02	Neiman Marcus Group Ltd. LLC 13,000 % fällig am 25.09.2025	93.088	99.546	0,14	Whatabrands LLC 2,970 % fällig am 31.07.2026	2.763	2.743	0,00		
Diamond (BC) BV 3,147 % - 3,214 % fällig am 06.09.2024		2.571	2.538	0,00	Nexstar Broadcasting, Inc. 2,395 % fällig am 17.01.2024	2.185	2.169	0,00	Windstream Services LLC 7,250 % fällig am 21.09.2027	10.184	9.985	0,01		
Diamond Resorts International, Inc. 4,750 % fällig am 02.09.2023		63.991	60.824	0,09	Nielsen Finance LLC 2,146 % fällig am 04.10.2023	4.360	4.352	0,01	Wyndham Hotels & Resorts, Inc. 1,897 % fällig am 30.05.2025	8.211	8.126	0,01		
Elanco Animal Health, Inc. 1,905 % fällig am 01.08.2027		17.059	16.936	0,02	3,750 % fällig am 04.06.2025	€	1.990	2.446	0,00	Zayo Group Holdings, Inc. 3,147 % fällig am 09.03.2027	€	50.953	50.710	0,07
Emerald TopCo, Inc. 3,714 % fällig am 24.07.2026		3.660	3.628	0,01	4,750 % fällig am 04.06.2025	\$	3.483	3.517	0,01	3,250 % fällig am 09.03.2027	€	10.918	13.362	0,02
Envision Healthcare Corp. 3,897 % fällig am 10.10.2025		149.349	125.391	0,18	Numericable Group S.A. 2,897 % fällig am 31.07.2025	218	214	0,00						
EyeCare Partners LLC 3,750 % - 3,897 % fällig am 18.02.2027		7.300	7.134	0,01	Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 3,398 % fällig am 30.06.2025	\$	4.988	\$ 4.927	0,01					
Financial & Risk U.S. Holdings, Inc. 3,250 % fällig am 01.10.2025	€	111.254	\$ 136.077	0,19	Parexel International Corp. 2,897 % fällig am 27.09.2024	5.356	5.275	0,01						
3,397 % fällig am 01.10.2025	\$	98.294	98.271	0,14										
												2.857.055	4,01	









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
Kinder Morgan, Inc. 7,750 % fällig am 15.01.2032	\$ 3.400	\$ 4.919	0,01	NXP BV 4,300 % fällig am 18.06.2029	\$ 13.517	\$ 16.138	0,02	Royal Caribbean Cruises Ltd. 9,125 % fällig am 15.06.2023	\$ 8.642	\$ 9.387	0,01
Kraft Heinz Foods Co. 3,000 % fällig am 01.06.2026	29.676	31.012	0,04	Occidental Petroleum Corp. 1,671 % fällig am 15.08.2022	22.542	22.100	0,03	Russian Railways Via RZD Capital PLC 3,374 % fällig am 20.05.2021	€ 19.844	24.603	0,03
3,750 % fällig am 01.04.2030	23.836	25.495	0,04	Oracle Corp. 3,850 % fällig am 01.04.2060	26.399	32.535	0,05	7,487 % fällig am 25.03.2031	£ 9.350	17.526	0,02
3,875 % fällig am 15.05.2027	18.950	20.444	0,03	3,250 % fällig am 01.06.2050	2.665	3.086	0,00	SABIC Capital BV 2,150 % fällig am 14.09.2030	\$ 28.700	28.548	0,04
4,250 % fällig am 01.03.2031	16.365	18.263	0,03	PeaceHealth Obligated Group 3,218 % fällig am 15.11.2050	13.300	14.484	0,02	3,000 % fällig am 14.09.2050	7.900	7.905	0,01
5,200 % fällig am 15.07.2045	4.600	5.478	0,01	Par Pharmaceutical, Inc. 7,500 % fällig am 01.04.2027	8.068	8.764	0,01	Sabine Pass Liquefaction LLC 4,500 % fällig am 15.05.2030	20.921	24.825	0,03
5,500 % fällig am 01.06.2050	8.212	10.387	0,01	PayPal Holdings, Inc. 3,250 % fällig am 01.06.2050	2.665	3.086	0,00	Sands China Ltd. 3,800 % fällig am 08.01.2026	14.340	15.351	0,02
L Brands, Inc. 6,875 % fällig am 01.07.2025	3.900	4.240	0,01	Peababhan Indonesia Persero PT 3,218 % fällig am 15.11.2050	13.300	14.484	0,02	4,375 % fällig am 18.06.2030	9.480	10.589	0,01
Leidos, Inc. 2,300 % fällig am 15.02.2031	2.400	2.448	0,00	Perrigo Finance Unlimited Co. 3,150 % fällig am 15.06.2030	9.746	10.437	0,01	4,600 % fällig am 08.08.2023	30.850	32.840	0,05
4,375 % fällig am 15.05.2030	2.609	3.129	0,00	Petroleos de Venezuela S.A. 5,375 % fällig am 12.04.2027	53.114	2.125	0,00	5,125 % fällig am 08.08.2025	42.050	47.270	0,07
Leland Stanford Junior University 3,647 % fällig am 01.05.2048	10.546	13.398	0,02	5,500 % fällig am 12.04.2037	50.574	1.972	0,00	5,400 % fällig am 08.02.2028	38.802	45.552	0,06
Lendlease U.S. Capital, Inc. 4,500 % fällig am 26.05.2026	9.423	10.360	0,01	6,000 % fällig am 16.05.2024	47.576	1.903	0,00	Saudi Arabian Oil Co. 3,250 % fällig am 24.11.2050	32.200	32.715	0,05
Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030	16.700	17.574	0,02	6,000 % fällig am 15.11.2026	63.177	2.527	0,00	Seagate HDD Cayman 4,091 % fällig am 01.06.2029	1.300	1.395	0,00
Level 3 Financing, Inc. 3,400 % fällig am 01.03.2027	16.035	17.493	0,02	9,750 % fällig am 17.05.2035	28.330	1.105	0,00	4,125 % fällig am 15.01.2031	13.682	14.614	0,02
Live Nation Entertainment, Inc. 3,750 % fällig am 15.01.2028	6.000	6.077	0,01	Petroleos Mexicanos 5,350 % fällig am 12.02.2028	11.983	11.875	0,02	4,875 % fällig am 01.06.2027	1.100	1.240	0,00
(b)				5,950 % fällig am 28.01.2031	120.615	120.525	0,17	5,750 % fällig am 01.12.2034	1.300	1.535	0,00
Marriott International, Inc. 4,625 % fällig am 15.06.2030	1.412	1.659	0,00	6,490 % fällig am 23.01.2027	9.590	10.141	0,01	Six Flags Theme Parks, Inc. 7,000 % fällig am 01.07.2025	2.346	2.538	0,00
Marriott Ownership Resorts, Inc. 6,125 % fällig am 15.09.2025	3.719	3.970	0,01	6,500 % fällig am 13.03.2027	102.375	107.999	0,15	Southwest Airlines Co. 5,125 % fällig am 15.06.2027	9.525	11.344	0,02
Melco Resorts Finance Ltd. 5,375 % fällig am 04.12.2029	37.220	38.781	0,05	6,500 % fällig am 23.01.2029	171.345	177.925	0,25	5,250 % fällig am 04.05.2025	4.220	4.891	0,01
5,625 % fällig am 17.07.2027	3.550	3.745	0,01	6,750 % fällig am 21.09.2047	3.730	3.503	0,00	Spanish Broadcasting System, Inc. 12,500 % fällig am 15.04.2017	9.986	10.001	0,01
Memorial Sloan-Kettering Cancer Center 2,955 % fällig am 01.01.2050	2.500	2.673	0,00	6,840 % fällig am 23.01.2030	95.292	99.917	0,14	Sprint Spectrum Co. LLC 3,360 % fällig am 20.03.2023	11.552	11.678	0,02
MGM China Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 18.06.2025	19.381	20.199	0,03	6,950 % fällig am 28.01.2060	76.875	72.447	0,10	4,738 % fällig am 20.09.2029	110.900	120.461	0,17
5,875 % fällig am 15.05.2026	13.375	14.168	0,02	7,690 % fällig am 23.01.2050	14.280	14.423	0,02	5,152 % fällig am 20.09.2029	28.258	32.779	0,05
Micron Technology, Inc. 4,663 % fällig am 15.02.2030	34.097	41.906	0,06	Petronas Capital Ltd. 4,550 % fällig am 21.04.2050	8.700	11.667	0,02	Standard Industries, Inc. 4,375 % fällig am 15.07.2030	2.785	2.983	0,00
5,327 % fällig am 06.02.2029	9.282	11.625	0,02	4,800 % fällig am 21.04.2060	5.800	8.411	0,01	Staples, Inc. 7,500 % fällig am 15.04.2026	1.369	1.432	0,00
Mitchells & Butlers Finance PLC 0,667 % fällig am 15.12.2030	5.513	5.022	0,01	PetSmart, Inc. 5,875 % fällig am 01.06.2025	5.008	5.155	0,01	Sutter Health 2,294 % fällig am 15.08.2030	11.000	11.447	0,02
6,013 % fällig am 15.12.2030	£ 6.484	9.483	0,01	Post Holdings, Inc. 4,625 % fällig am 15.04.2030	7.785	8.199	0,01	3,161 % fällig am 15.08.2040	6.900	7.344	0,01
Moody's Corp. 3,250 % fällig am 20.05.2050	\$ 726	810	0,00	PTC, Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2025	5.682	5.852	0,01	3,361 % fällig am 15.08.2050	16.800	18.340	0,03
Motorola Solutions, Inc. 4,600 % fällig am 23.05.2029	22.500	26.974	0,04	Quanta Services, Inc. 2,900 % fällig am 01.10.2030	18.900	20.281	0,03	Syngenta Finance NV 3,933 % fällig am 23.04.2021	20.400	20.538	0,03
NCL Corp. Ltd. 3,625 % fällig am 15.12.2024	1.328	1.264	0,00	QVC, Inc. 4,850 % fällig am 01.04.2024	28.902	31.250	0,04	4,441 % fällig am 24.04.2023	5.700	5.986	0,01
NetApp, Inc. 2,700 % fällig am 22.06.2030	18.100	19.472	0,03	RAC Bond Co. PLC 4,870 % fällig am 06.05.2046	£ 5.000	7.322	0,01	4,892 % fällig am 24.04.2025	5.000	5.369	0,01
Netfix, Inc. 3,625 % fällig am 15.05.2027	€ 44.605	61.026	0,09	Radiology Partners, Inc. 9,250 % fällig am 01.02.2028	\$ 5.467	6.150	0,01	5,182 % fällig am 24.04.2028	13.830	14.846	0,02
3,625 % fällig am 15.06.2030	19.966	27.859	0,04	(m)				T-Mobile USA, Inc. 2,550 % fällig am 15.02.2031	24.800	26.073	0,04
3,875 % fällig am 15.11.2029	66.905	94.849	0,13	Refinitiv U.S. Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 15.05.2026	€ 61.250	79.046	0,11	TEGNA, Inc. 4,625 % fällig am 15.03.2028	7.383	7.563	0,01
4,625 % fällig am 15.05.2029	72.140	107.069	0,15	Regeneron Pharmaceuticals, Inc. 1,750 % fällig am 15.09.2030	\$ 21.932	21.636	0,03	4,625 % fällig am 15.07.2024	1.887	1.936	0,00
4,875 % fällig am 15.06.2030	\$ 16.200	18.660	0,03	2,800 % fällig am 15.09.2050	8.200	7.993	0,01	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 2,950 % fällig am 18.12.2022	17.100	17.089	0,02
5,375 % fällig am 15.11.2029	6.364	7.510	0,01	RELX Capital, Inc. 3,000 % fällig am 22.05.2030	8.582	9.541	0,01	3,650 % fällig am 10.11.2021	24.562	24.937	0,03
Nielsen Co. Luxembourg SARL 5,500 % fällig am 01.10.2021	120	121	0,00	Rite Aid Corp. 7,500 % fällig am 01.07.2025	11.431	11.951	0,02	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,250 % fällig am 31.03.2023	€ 4.340	5.145	0,01
Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % fällig am 17.03.2026	€ 56.900	73.704	0,10	Roadster Finance DAC 1,625 % fällig am 09.12.2029	€ 1.800	2.238	0,00	2,200 % fällig am 21.07.2021	\$ 15.228	15.218	0,02
2,652 % fällig am 17.03.2026	€ 56.900	73.704	0,10	2,375 % fällig am 08.12.2032	7.000	8.818	0,01	2,800 % fällig am 21.07.2023	13.988	13.875	0,02
3,201 % fällig am 17.09.2028	86.900	115.508	0,16	Rockefeller Foundation 2,492 % fällig am 01.10.2050	\$ 25.300	26.435	0,04	3,250 % fällig am 15.04.2022	€ 49.850	62.023	0,09
3,522 % fällig am 17.09.2025	\$ 55.000	58.940	0,08	Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 10.000	13.276	0,02	6,000 % fällig am 31.01.2025	12.700	16.938	0,02
4,345 % fällig am 17.09.2027	66.700	73.756	0,10	5,750 % fällig am 15.10.2027	€ 10.000	11.088	0,02	Times Square Hotel Trust 8,528 % fällig am 01.08.2026	\$ 2.397	2.625	0,00
4,810 % fällig am 17.09.2030	20.000	22.555	0,03	(m)	£ 7.800	11.835	0,02	Topaz Solar Farms LLC 4,875 % fällig am 30.09.2039	6.317	6.906	0,01
Noble Corp. 15,000 % fällig am 16.02.2028 (b)	6.481	6.481	0,01	Roadster Finance DAC 1,625 % fällig am 09.12.2029	€ 1.800	2.238	0,00	5,750 % fällig am 30.09.2039	52.984	60.938	0,09
Noble Holding International Ltd. 7,875 % fällig am 01.02.2026	36.413	14.695	0,02	2,375 % fällig am 08.12.2032	7.000	8.818	0,01	TransDigm, Inc. 5,500 % fällig am 15.11.2027	4.164	4.384	0,01
Nokia Oyj 2,375 % fällig am 15.05.2025	€ 8.300	10.761	0,02	Rockefeller Foundation 2,492 % fällig am 01.10.2050	\$ 25.300	26.435	0,04	Transocean Guardian Ltd. 5,875 % fällig am 15.01.2024	4.061	3.422	0,00
3,125 % fällig am 15.05.2028	24.300	32.761	0,05	Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 10.000	13.276	0,02	Transocean, Inc. 7,250 % fällig am 01.11.2025	7.112	3.663	0,01
Norwegian Air Shuttle ASA Pass-Through Trust 4,875 % fällig am 10.11.2029	\$ 3.478	3.221	0,00	5,750 % fällig am 15.10.2027	€ 10.000	11.088	0,02	7,500 % fällig am 15.01.2026	3.660	1.702	0,00
NVR, Inc. 3,000 % fällig am 15.05.2030	5.882	6.443	0,01	(m)	£ 7.800	11.835	0,02	8,000 % fällig am 01.02.2027	18.529	8.824	0,01
								Triumph Group, Inc. 5,250 % fällig am 01.06.2022	3.292	3.144	0,00
								6,250 % fällig am 15.09.2024	4.204	4.178	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						
Fondo de Titulacion de Activos UCI 0,000 % fällig am 16.06.2049	€	17.113	\$	20.086	0,03	0,712 % fällig am 20.10.2045	6.679	\$	5.102	0,01	2,791 % fällig am 25.09.2036 ^	168	\$	146	0,00		
FWD Securitization Trust 2,240 % fällig am 25.01.2050	\$	21.466	22.039	0,03	0,772 % fällig am 19.09.2035	10.434	6.876	0,01	2,938 % fällig am 25.11.2035 ^	2.178	2,057	0,01	2,964 % fällig am 25.12.2035	5.359	4.756	0,01	
2,810 % fällig am 25.06.2049	\$	5.660	5.814	0,01	0,772 % fällig am 19.11.2035	481	441	0,00	2,981 % fällig am 25.06.2037 ^	4.753	4.442	0,01	3,019 % fällig am 25.09.2035 ^	398	328	0,00	
GC Pastor Hipotecario FTA 0,000 % fällig am 21.06.2046	€	2.041	2.160	0,00	0,792 % fällig am 19.08.2045	3.322	2.971	0,00	3,046 % fällig am 25.06.2037 ^	2.403	2.482	0,00	3,062 % fällig am 25.11.2035 ^	48	37	0,00	
GMAC Commercial Mortgage Asset Corp. 5,456 % fällig am 10.03.2051	\$	18.798	19.716	0,03	0,832 % fällig am 19.01.2035	282	277	0,00	3,080 % fällig am 25.07.2037	9.184	8.840	0,01	3,128 % fällig am 25.09.2036 ^	117	118	0,00	
5,550 % fällig am 10.08.2038		20.826	23.226	0,03	1,148 % fällig am 25.10.2037	18.797	19.299	0,03	3,092 % fällig am 25.08.2034	117	118	0,00	3,111 % fällig am 25.08.2036	248	234	0,00	
GMAC Mortgage Corp. Loan Trust 3,372 % fällig am 19.11.2035 ^		77	74	0,00	1,459 % fällig am 19.12.2036 ^	2.800	2.630	0,00	3,115 % fällig am 25.09.2036	2.406	1.937	0,00	3,124 % fällig am 25.06.2037 ^	8.178	6.679	0,01	
3,587 % fällig am 19.04.2036 ^		168	148	0,00	1,692 % fällig am 19.02.2036	2.520	1.970	0,00	3,128 % fällig am 25.09.2036 ^	202	185	0,00	3,149 % fällig am 25.08.2035	87	78	0,00	
3,986 % fällig am 19.07.2035		262	241	0,00	2,109 % fällig am 19.09.2035 ^	210	189	0,00	3,152 % fällig am 25.07.2036	4.980	4.192	0,01	3,168 % fällig am 25.09.2037	18.247	16.658	0,02	
4,204 % fällig am 18.03.2035		43	42	0,00	2,609 % fällig am 19.10.2035	8.732	6.488	0,01	3,170 % fällig am 25.06.2036	9.141	7.293	0,01	3,170 % fällig am 25.06.2036	3.403	2.690	0,00	
5,750 % fällig am 25.07.2035	1.355	1.349	0,00	2,609 % fällig am 19.10.2035	1.227	707	0,00	3,233 % fällig am 25.08.2037	85	66	0,00	3,243 % fällig am 25.05.2035	5.189	4.616	0,01		
Grand Canal Securities 1 Designated Activity Co. 0,028 % fällig am 19.02.2055	€	385	469	0,00	2,628 % fällig am 19.11.2034	511	517	0,00	3,256 % fällig am 25.03.2036 ^	368	337	0,00	3,256 % fällig am 25.03.2036 ^	6.025	5.080	0,01	
Great Hall Mortgages PLC 0,167 % fällig am 18.03.2039	£	10.670	14.395	0,02	2,995 % fällig am 19.12.2035 ^	1.501	1.439	0,00	3,290 % fällig am 25.05.2035 ^	368	337	0,00	3,303 % fällig am 25.08.2037 ^	5.161	4.825	0,01	
0,187 % fällig am 18.06.2038		8.784	11.826	0,02	3,255 % fällig am 25.04.2037	1.654	1.521	0,00	3,325 % fällig am 25.04.2037	2.171	2.029	0,00	3,357 % fällig am 25.05.2037 ^	9.573	9.015	0,01	
0,366 % fällig am 18.06.2039	\$	562	548	0,00	3,415 % fällig am 25.04.2047	1.712	1.657	0,00	3,372 % fällig am 25.04.2037	273	235	0,00	3,400 % fällig am 25.05.2036 ^	2.614	1.994	0,00	
GreenPoint Mortgage Funding Trust 0,348 % fällig am 25.10.2046		11.053	10.570	0,02	3,514 % fällig am 19.06.2036 ^	2.828	1.701	0,00	3,406 % fällig am 25.05.2037 ^	26	25	0,00	3,406 % fällig am 25.05.2037 ^	964	939	0,00	
0,358 % fällig am 25.01.2047		154	270	0,00	Hawkmoor Mortgages PLC 1,104 % fällig am 25.05.2053	£	13.148	18.002	0,03	3,568 % fällig am 25.03.2037 ^	504	475	0,00	6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	211	127	0,00
0,588 % fällig am 25.06.2045		1.151	1.042	0,00	Hipocot FTA 0,000 % fällig am 24.10.2039	€	3.883	4.724	0,01	3,607 % fällig am 25.01.2037 ^	848	511	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2037	370	197	0,00
0,668 % fällig am 25.10.2045		5.324	5.254	0,01	0,670 % fällig am 25.01.2036	2.040	1.987	0,00	6,500 % fällig am 25.09.2037 ^	2.059	1.602	0,00	6,500 % fällig am 25.10.2037	3.088	2.425	0,00	
0,728 % fällig am 25.02.2036		3.391	3.340	0,01	0,885 % fällig am 25.01.2036	9.254	7.688	0,01	InTown Hotel Portfolio Trust 1,209 % fällig am 15.01.2033	6.700	6.594	0,01	6,500 % fällig am 25.10.2037	20.900	20.365	0,03	
0,768 % fällig am 25.10.2045		3.219	2.957	0,00	3,255 % fällig am 25.04.2037	1.654	1.521	0,00	1,409 % fällig am 15.01.2033	9.480	9.267	0,01	Jepson Residential 0,276 % fällig am 24.11.2057	€	8.025	9.819	0,01
Grifonas Finance No. 1 PLC 0,000 % fällig am 28.08.2039	€	12.784	15.167	0,02	3,415 % fällig am 25.04.2047	1.712	1.657	0,00	2,209 % fällig am 15.01.2033	20.900	20.365	0,03	JPMorgan Alternative Loan Trust 0,428 % fällig am 25.04.2047	\$	6.396	6.228	0,01
GS Mortgage Securities Corp. 1,489 % fällig am 10.02.2046		29.142	799	0,00	IM Pastor Fondo de Titulacion Hipotecaria 0,000 % fällig am 22.09.2041	€	256	312	0,00	6,500 % fällig am 25.09.2037 ^	2.059	1.602	0,00	0,668 % fällig am 25.01.2036	79	80	0,00
(a)	\$	29.142	799	0,00	Impac CMB Trust 0,688 % fällig am 25.05.2035	\$	359	361	0,00	6,500 % fällig am 25.09.2037 ^	2.059	1.602	0,00	0,788 % fällig am 25.11.2034	3.138	3.154	0,01
GS Mortgage Securities Corp. Trust 3,419 % fällig am 10.10.2032		26.700	27.320	0,04	0,788 % fällig am 25.11.2034	3.138	3.154	0,01	7,788 % fällig am 25.03.2035	5.984	5.970	0,00	0,788 % fällig am 25.03.2035	4.081	4.064	0,01	
4,591 % fällig am 10.10.2032		35.288	33.343	0,05	0,828 % fällig am 25.01.2035	4.081	4.064	0,01	6,060 % fällig am 25.10.2034	545	584	0,00	6,060 % fällig am 25.10.2034	545	584	0,00	
GSC Capital Corp. Mortgage Trust 0,548 % fällig am 25.02.2036 ^		2.663	2.588	0,00	6,060 % fällig am 25.10.2034	545	584	0,00	Impac Secured Assets CMN Owner Trust 5,258 % fällig am 25.03.2033	440	450	0,00	6,060 % fällig am 25.10.2034	545	584	0,00	
GSMPs Mortgage Loan Trust 0,498 % fällig am 25.03.2035		8.708	7.941	0,01	Impac Secured Assets Corp. 0,788 % fällig am 25.03.2036	2.317	2.002	0,00	5,258 % fällig am 25.03.2033	440	450	0,00	6,060 % fällig am 25.10.2034	545	584	0,00	
0,498 % fällig am 25.09.2035		9.420	7.848	0,01	0,788 % fällig am 25.03.2036	2.317	2.002	0,00	0,788 % fällig am 25.03.2036	2.317	2.002	0,00	6,060 % fällig am 25.10.2034	545	584	0,00	
0,548 % fällig am 25.06.2034		669	566	0,00	1,573 % fällig am 25.02.2035	1.000	990	0,00	1,573 % fällig am 25.02.2035	1.000	990	0,00	6,060 % fällig am 25.10.2034	545	584	0,00	
3,780 % fällig am 25.06.2034		6.012	5.805	0,01	Impac Secured Assets Trust 0,258 % fällig am 25.05.2037 ^	1.366	1.258	0,00	Impac Secured Assets Corp. 0,788 % fällig am 25.03.2036	2.317	2.002	0,00	6,060 % fällig am 25.10.2034	545	584	0,00	
7,084 % fällig am 20.10.2032		1.746	1.780	0,00	0,308 % fällig am 25.03.2037 ^	2.534	2.486	0,00	1,573 % fällig am 25.02.2035	1.000	990	0,00	6,060 % fällig am 25.10.2034	545	584	0,00	
GSMSc Resecuritization Trust 0,330 % fällig am 26.09.2036		10.908	8.446	0,01	0,348 % fällig am 25.11.2036	4.668	4.352	0,01	Impac Secured Assets Trust 0,258 % fällig am 25.05.2037 ^	1.366	1.258	0,00	6,060 % fällig am 25.10.2034	545	584	0,00	
3,595 % fällig am 26.08.2035		431	436	0,00	0,388 % fällig am 25.09.2037 ^	4.658	4.013	0,01	0,308 % fällig am 25.03.2037 ^	2.534	2.486	0,00	6,060 % fällig am 25.10.2034	545	584	0,00	
4,425 % fällig am 26.04.2037		9.316	3.496	0,01	0,408 % fällig am 25.01.2037	12.548	11.585	0,02	0,348 % fällig am 25.11.2036	4.668	4.352	0,01	6,060 % fällig am 25.10.2034	545	584	0,00	
GSR Mortgage Loan Trust 0,378 % fällig am 25.05.2037		15.896	10.596	0,02	0,418 % fällig am 25.11.2036	6.815	5.380	0,01	0,388 % fällig am 25.09.2037 ^	4.658	4.013	0,01					



















BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND</b>				<b>ENERGIE</b>				<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>			
4,250 % fällig am 13.03.2025	\$ 274.600	\$ 276.058	0,39	Dommo Energia S.A. (d)	1.428.523	\$ 382	0,00	Uniti Group, Inc.	979.763	\$ 11.492	0,01
4,625 % fällig am 31.03.2025	€ 68.800	89.423	0,13	Noble Corp. PLC (d)(l)	533.022	4.755	0,01	VICI Properties, Inc.	5.793.243	147.728	0,21
5,250 % fällig am 13.03.2030	\$ 155.000	155.880	0,22			5.137	0,01			159.220	0,22
5,600 % fällig am 14.11.2024	111.200	116.771	0,16	<b>FINANZWERTE</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
5,625 % fällig am 30.03.2021	30.800	31.095	0,04	Cairo Mezz PLC (d)	3.408.327	514	0,00	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
5,750 % fällig am 22.03.2024	26.000	27.437	0,04	Eurobank Ergasias S.A. 'A' (d)	40.899.918	28.778	0,04	(3,480) % fällig am			
6,350 % fällig am 10.08.2024	79.700	85.721	0,12			29.292	0,04	13.09.2021 (e)(f)	ARS 9.893.889	72.121	0,10
7,250 % fällig am 23.12.2023	95.400	104.521	0,15	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				(1,117) % fällig am			
7,625 % fällig am 26.04.2029	122.900	142.148	0,20	Sierra Hamilton Holder LLC (d)(l)	2.210.032	0	0,00	21.05.2021 (e)(f)	9.728.500	71.638	0,10
<b>VENEZUELA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND</b>				<b>OPTIONSSCHEINE</b>				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	9.289	901	0,00	iHeartMedia, Inc. 'A' - Exp. 01.05.2039	9.732.157	124.303	0,18	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	14.228	1.380	0,00	Sequa Corp. - Exp. 28.04.2024	174.000	324	0,00	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (l)	224.052.286	2.232.009	3,13
7,650 % fällig am 21.04.2025 ^	28.167	2.732	0,00	Stearns Holdings LLC 'B' - Exp. 05.11.2039	1.125.796	0	0,00	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
7,750 % fällig am 13.10.2019 ^	5.850	567	0,00	Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21.09.2055	2.023.011	37.072	0,05	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (i)	2.903.000	295.197	0,42
8,250 % fällig am 13.10.2024 ^	35.331	3.427	0,00			161.699	0,23	<b>Summe Investmentfonds</b>			
8,250 % fällig am 07.05.2023 ^	13.516	1.311	0,00	<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>			
9,250 % fällig am 15.09.2027 ^	34.519	3.366	0,00	Nationwide Building Society 10,250 %	859.974	208.218	0,29	<b>\$94.258.066 132,24</b>			
9,250 % fällig am 07.05.2028 ^	39.817	3.862	0,01	Sequa Corp. 12,000 %	4.565	6.525	0,01	<b>AKTIEN</b>			
11,750 % fällig am 21.10.2026 ^	3.990	387	0,00			214.743	0,30	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
12,750 % fällig am 23.08.2022 ^	6.170	599	0,00	<b>Summe</b>				<b>Summe</b>			
		5.395.922	7,57	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>				<b>\$94.258.066 132,24</b>			
<b>STAMMAKTIEN</b>				<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>				<b>\$94.258.066 132,24</b>			
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>				<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>				<b>\$94.258.066 132,24</b>			
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (d)	26.868.244	44.333	0,06	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>				<b>\$94.258.066 132,24</b>			
iHeartMedia, Inc. 'A' (d)	1.494.315	19.396	0,03	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>				<b>\$94.258.066 132,24</b>			
iHeartMedia, Inc. 'B' (d)	20.063	234	0,00	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>				<b>\$94.258.066 132,24</b>			
<b>BASISKONSUMGÜTER</b>				<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>				<b>\$94.258.066 132,24</b>			
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (d)(l)	1.179.713	106.951	0,15	<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>				<b>\$94.258.066 132,24</b>			

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 14.587	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (14.879)	\$ 14.587	\$ 14.587	0,02
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (14.879)</b>	<b>\$ 14.587</b>	<b>\$ 14.587</b>	<b>0,02</b>

(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 March Futures	Short	03.2021	230	\$ (114)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	9.888	10.477	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	2	0	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	2	1	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	325	93	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	51.026	(2.168)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	1.427	2.025	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	6.115	23.212	0,03
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	308	(581)	0,00
<b>Summe</b>				<b>\$ 32.945</b>	<b>0,05</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	\$ 168,000	22.01.2021	700	\$ (555)	\$ (131)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	171,000	22.01.2021	310	(272)	(223)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	177,000	22.01.2021	700	(671)	(208)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	179,000	22.01.2021	310	(272)	(39)	0,00
				\$ (1.770)	\$ (601)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 32.344	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 INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Bombardier, Inc.	5,000 %	20.06.2024	\$ 4.100	\$ (436)	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20.12.2024	4.900	(482)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2022	600	(70)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	109.900	7.106	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	19.900	540	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 23.100	(1.763)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	8.800	519	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	2.600	(37)	0,00
Sprint Communications, Inc.	5,000	20.12.2021	\$ 2.100	(166)	0,00
				\$ 5.211	0,01

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-31 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2023	\$ 62.700	\$ 42	0,00
CDX.IG-33 5-Year Index	(1,000)	20.12.2024	1.181.440	(34.974)	(0,05)
				\$ (34.932)	(0,05)

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-28 5-Year Index	1,000 %	20.12.2022	\$ 219.575	\$ 10.089	0,01
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000	20.06.2023	121.110	3.240	0,00
CDX.EM-30 5-Year Index	1,000	20.12.2023	602.258	31.915	0,04
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000	20.06.2024	108.852	4.564	0,01
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	142.476	6.685	0,01
CDX.EM-33 5-Year Index	1,000	20.06.2025	212.990	22.222	0,03
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	214.600	8.259	0,01
CDX.HY-33 5-Year Index	5,000	20.12.2024	230.190	(213)	0,00
CDX.HY-34 5-Year Index	5,000	20.06.2025	145.912	13.604	0,02
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000	20.12.2025	662.400	19.814	0,03
CDX.IG-34 5-Year Index	1,000	20.06.2025	45.000	413	0,00
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	91.700	247	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 971.500	4.536	0,01
				\$ 125.375	0,17

#### ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,840 %	03.01.2022	BRL 188.100	\$ (6)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,848	03.01.2022	154.800	(7)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022	777.600	(55)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,865	03.01.2022	283.400	(23)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	119.400	(12)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,880	03.01.2022	119.400	(14)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,883	03.01.2022	459.200	(55)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,884	03.01.2022	97.300	(12)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,886	03.01.2022	142.500	(18)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,060	03.01.2022	4.680.700	2.379	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,830	02.01.2023	1.005.200	10.762	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,836	02.01.2023	782.600	8.418	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,855	02.01.2023	260.500	2.826	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2047	CAD 2.600	149	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month CAD-Bank Bill	1,300 %	16.06.2047	CAD 2.500	\$ 82	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	3,400	20.06.2029	6.300	375	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,250	30.03.2023	\$ 492.700	(223)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,300	15.01.2026	2.108.400	14.401	0,02
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,400	30.03.2026	34.300	(143)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,550	15.01.2031	4.663.600	164.212	0,23
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,674	05.08.2030	62.900	1.630	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,678	29.07.2030	65.200	1.620	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,711	28.07.2030	69.000	1.500	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,715	27.07.2030	200.000	4.272	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,750	30.03.2031	963.600	13.954	0,02
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,800	15.01.2051	2.112.300	334.039	0,47
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,144	04.11.2050	49.600	(2.283)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,150	30.03.2051	191.500	14.819	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,215	13.10.2050	83.500	(3.137)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,317	16.12.2050	33.800	(18)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	19.09.2028	ZAR 1.510.200	12.472	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,250	15.03.2024	10.200	(58)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,300	15.03.2027	187.600	1.639	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD 72.880	7.402	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	1.179.040	128.706	0,18
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024	197.200	12.237	0,02
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025	361.600	23.998	0,03
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024	97.200	3.758	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	18.06.2024	124.400	1.948	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	18.03.2030	€ 907.700	(27.762)	(0,04)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	17.06.2030	244.000	(10.566)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050	126.900	(20.761)	(0,03)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	17.09.2024	149.000	(68)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	17.03.2031	£ 1.041.200	(4.572)	(0,01)
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.09.2030	254.700	(15.560)	(0,02)
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR	0,750	18.03.2030	1.671.624	(26.391)	(0,04)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,000	20.09.2026	¥ 48.830.000	(7.347)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,000	15.03.2029	344.670.000	(886)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,020	20.09.2028	395.820.000	(4.387)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,580	10.06.2022	MXN 1.931.300	(449)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,650	10.05.2022	7.444.600	(2.103)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,740	03.06.2022	1.871.900	(648)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,825	27.05.2022	759.300	(309)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,095	05.02.2021	1.357.900	4.237	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,120	06.05.2025	957.400	1.033	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,160	06.06.2025	825.300	893	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,280	23.05.2025	323.500	436	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,280	30.05.2025	798.900	1.070	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,430	17.11.2021	413.600	1.480	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,535	04.05.2027	1.634.200	2.830	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,610	07.07.2021	423.400	1.151	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,615	21.05.2021	719.400	1.857	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,680	28.05.2021	303.800	755	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,780	29.09.2022	579.430	2.312	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,795	02.06.2023	245.200	1.170	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,798	06.09.2021	1.768.100	4.611	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,810	02.05.2022	189.300	652	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,850	02.05.2022	607.900	2.055	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,900	20.07.2021	1.652.600	3.808	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,950	30.01.2026	752.200	5.276	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,980	26.08.2024	87.900	506	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,990	30.01.2026	816.500	5.683	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,000	18.07.2022	1.700.000	5.817	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	10.03.2026	1.660.900	11.438	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,350	01.09.2023	351.400	1.465	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,490	08.09.2026	1.322.100	8.862	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,620	18.02.2030	94.500	777	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,710	20.09.2029	87.500	693	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,750	31.08.2021	714.400	715	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,150	11.06.2027	2.193.600	14.705	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,165	06.09.2032	266.600	1.912	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,199	03.12.2021	194.600	130	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,200	11.06.2027	1.587.300	9.566	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,350	17.11.2021	198.300	62	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,360	21.08.2037	285.500	2.830	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,370	11.10.2027	1.861.100	13.336	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,380	04.11.2026	36.300	205	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,380	14.08.2037	111.200	(1.341)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,388	17.11.2021	154.800	39	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,480	18.06.2037	337.300	2.932	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,498	19.06.2037	810.000	7.080	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,520	18.04.2023	1.819.700	6.491	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,530	18.04.2023	2.360.500	8.448	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,530	21.04.2023	257.700	952	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,538	23.02.2022	698.000	218	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,545	18.04.2023	2.167.800	7.779	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,603	14.04.2025	1.995.300	11.927	0,02

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610 %	23.01.2023	MXN 4.957.600	\$ 17.837	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	15.04.2025	288.800	1.722	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,640	03.01.2023	214.500	725	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,645	03.01.2023	466.500	1.579	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,670	05.03.2025	5.616.000	34.089	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,700	02.05.2023	713.700	2.930	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,710	26.02.2025	1.873.400	11.270	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,710	07.03.2025	347.300	2.119	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,715	07.03.2025	345.200	2.110	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,745	05.01.2023	313.500	1.093	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,800	28.12.2027	273.800	(2.341)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,805	06.02.2023	760.000	2.786	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,818	17.02.2027	816.800	4.219	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,820	06.02.2023	870.300	3.382	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,865	27.12.2022	536.600	1.867	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,865	02.02.2027	1.026.600	5.283	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,875	16.12.2022	306.800	1.072	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,880	27.12.2022	7.579.800	22.992	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,910	30.12.2027	967.500	9.344	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,984	10.12.2027	32.700	(295)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,990	21.12.2027	14.700	(133)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,005	21.12.2027	3.730.800	(31.685)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,010	04.02.2027	448.800	2.222	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,030	31.01.2028	450.400	(4.187)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,050	31.01.2028	679.600	6.403	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,090	15.01.2027	1.435.600	6.825	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,103	04.01.2038	3.750.800	(48.898)	(0,07)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,120	15.01.2027	293.600	1.384	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,280	28.11.2036	690.000	5.472	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,310	28.11.2036	1.066.400	8.348	0,01
					\$ 868.112	1,22
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 963.766</b>	<b>1,35</b>

(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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,975 %	15.06.2022	26.100	\$ 2.836	\$ 886	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,975	15.06.2022	26.100	2.836	4.217	0,01
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,306	29.10.2021	48.000	3.520	2.268	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,306	29.10.2021	48.000	3.520	4.008	0,01
DUB	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,990	22.06.2022	75.000	8.130	2.640	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,990	22.06.2022	75.000	8.200	11.939	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,035	24.06.2022	25.900	2.844	991	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,035	24.06.2022	25.900	2.845	3.910	0,01
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,975	15.06.2022	26.100	2.819	886	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,975	15.06.2022	26.100	2.819	4.217	0,01
							\$ 40.369	\$ 35.962	0,05

#### VERKAUFSOPTIONS

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,425 %	17.03.2021	253.100	\$ (120)	\$ (95)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	253.100	(259)	(201)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	252.000	(306)	(198)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	587.700	(463)	(337)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700 %	17.03.2021	409.400	\$ (544)	\$ (544)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	587.700	(571)	(659)	(0,01)
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	256.000	(155)	(125)	0,00
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	256.000	(376)	(435)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	275.400	(359)	(217)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	258.900	(361)	(344)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	146.100	(59)	(71)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	146.100	(278)	(249)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	121.500	(148)	(42)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	288.100	(188)	(198)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	288.100	(341)	(156)	0,00
FBF	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	128.100	(169)	(44)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	153.400	(107)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	296.169	(207)	(34)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	158.700	(124)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	349.391	(269)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	295.700	(211)	(203)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	295.700	(316)	(160)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	501.100	(330)	(288)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	268.650	(184)	(268)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	501.100	(551)	(562)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	268.650	(333)	(225)	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	297.000	(602)	(33)	0,00
MYC	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	249.300	(134)	(120)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	249.300	(249)	(126)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	241.500	(326)	(192)	0,00
						\$ (8.640)	\$ (6.129)	(0,01)

## DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put - OTC USD versus CNH	CNH 6,520	14.01.2021	80.146	\$ (324)	\$ (476)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6,780	14.01.2021	80.146	(315)	(6)	0,00
GLM	Put - OTC USD versus CNH	6,534	15.01.2021	64.117	(292)	(475)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6,792	15.01.2021	64.117	(231)	(6)	0,00
HUS	Put - OTC USD versus CNH	6,530	05.02.2021	112.205	(588)	(998)	(0,01)
	Call - OTC USD versus CNH	6,800	05.02.2021	112.205	(588)	(66)	0,00
	Put - OTC USD versus CNH	6,510	08.02.2021	84.315	(383)	(634)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6,810	08.02.2021	84.315	(383)	(55)	0,00
	Put - OTC USD versus CNH	6,450	19.02.2021	80.816	(335)	(358)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6,700	19.02.2021	80.816	(259)	(177)	0,00
SCX	Put - OTC USD versus CNH	6,400	09.03.2021	161.632	(593)	(542)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6,680	09.03.2021	161.632	(813)	(625)	0,00
					\$ (5.104)	\$ (4.418)	(0,01)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,295 %	11.01.2021	82.600	\$ (706)	\$ (170)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,595	11.01.2021	82.600	(706)	(47)	0,00
FAR	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,223	15.01.2021	49.100	(545)	(92)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,523	15.01.2021	49.100	(545)	(229)	0,00
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,165	11.01.2021	78.100	(582)	(13)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,485	11.01.2021	78.100	(582)	(298)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,131	19.01.2021	84.000	(945)	(58)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,210	19.01.2021	57.300	(539)	(110)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,491	19.01.2021	84.000	(945)	(615)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,550	19.01.2021	57.300	(539)	(225)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,078	20.01.2021	203.500	(2.340)	(88)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,438	20.01.2021	203.500	(2.340)	(2.641)	(0,01)
							\$ (11.314)	\$ (4.586)	(0,01)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	\$101,563	07.01.2021	65.000	\$ (221)	\$ 0	0,00
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	117.000	(192)	(107)	0,01
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	88.000	(206)	(397)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	28.600	(74)	(74)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	99,688	04.02.2021	101.000	(603)	(507)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,367	04.02.2021	26.000	(74)	(103)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,703	04.02.2021	56.000	(140)	(236)	0,00
					\$ (1.510)	\$ (1.424)	0,01

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% 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	(1.529)	(275)	0,00
BPS	UBS AG	(1,000)	20.06.2024	7.000	458	(557)	(99)	0,00
					\$ 1.734	\$ (2.132)	\$ (398)	0,00

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2022	\$ 22.300	\$ (732)	\$ 902	\$ 170	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	2.400	(94)	112	18	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	2.700	(274)	311	37	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	6.300	(316)	293	(23)	0,00
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2022	22.900	(1.062)	1.215	153	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	56.800	(1.200)	2.275	1.075	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	35.400	(572)	1.217	645	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2021	1.000	(280)	284	4	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2021	400	(61)	64	3	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	31.500	(1.413)	861	(552)	0,00
BRC	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	57.900	(2.291)	2.732	441	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	8.750	(538)	588	50	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2022	675	2	8	10	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	4.500	29	32	61	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2021	5.800	(1.670)	1.694	24	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.12.2021	3.000	(272)	250	(22)	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2022	47.000	237	602	839	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	74.450	(2.101)	2.666	565	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	22.400	(429)	716	287	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	4.100	(414)	470	56	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	20.400	(1.297)	1.378	81	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.100	(289)	316	27	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.200	(73)	69	(4)	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	50.505	(1.969)	2.354	385	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	168.400	(2.908)	2.014	(894)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.000	(102)	261	159	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	29.600	116	318	434	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2023	75.800	(1.119)	2.637	1.518	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	55.000	(889)	1.891	1.002	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	6.400	(555)	643	88	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2022	22.500	52	216	268	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	2.800	(141)	131	(10)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2021	2.000	(41)	39	(2)	0,00
DUB	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2021	4.400	(91)	86	(5)	0,00
FBF	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	7.000	(270)	323	53	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	5.000	30	38	68	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	86.300	(1.084)	1.741	657	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.700	(441)	430	(11)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	176.800	(2.751)	1.812	(939)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	9.600	93	45	138	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	53.900	(807)	1.735	928	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	77.850	(714)	2.048	1.334	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	60.300	(502)	1.558	1.056	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2022	22.500	356	(67)	289	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2021	10.013	(2.794)	2.835	41	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2021	7.300	(1.251)	1.305	54	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2022	16.500	(1.498)	1.623	125	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2022	7.800	(443)	503	60	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.12.2021	1.400	(85)	75	(10)	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	13.500	(849)	612	(237)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	387.450	(8.475)	13.442	4.967	0,01
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2024	106.300	646	778	1.424	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	4.200	(269)	286	17	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	24.900	(1.425)	1.587	162	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	8.700	(449)	367	(82)	0,00
	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV	1,000	20.06.2022	9.500	(536)	453	(83)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	30.100	(953)	1.065	112	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	255.100	(7.463)	7.251	(212)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2022	1.500	7	15	22	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	32.400	(94)	610	516	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	296.450	(4.732)	10.344	5.612	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	49.700	(664)	1.569	905	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2021	1.100	(315)	320	5	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2022	10.000	(568)	645	77	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.12.2021	2.000	(183)	168	(15)	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	26.900	(122)	467	345	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.09.2024	2.459	(336)	370	34	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	8.300	(515)	548	33	0,00
JPM	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	90.700	(1.766)	3.483	1.717	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	11.800	(191)	406	215	0,00

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
	Petrobras Global Finance BV	1,000 %	20.12.2021	\$ 2.300	\$ (373)	\$ 390	\$ 17	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2022	9.000	(703)	771	68	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2021	7.800	(304)	363	59	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2023	14.400	(434)	634	200	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	4.800	(339)	370	31	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	48.200	(2.857)	2.682	(175)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	37.600	(2.111)	1.758	(353)	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2022	19.000	(704)	849	145	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2022	7.100	(84)	165	81	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	224.000	(1.479)	5.402	3.923	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	149.000	(2.052)	3.477	1.425	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2022	4.500	19	42	61	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2022	7.000	33	92	125	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2023	54.900	(1.097)	1.860	763	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2022	67.700	156	650	806	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	2.100	(148)	162	14	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2022	29.900	(627)	692	65	0,00
NGF	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2022	32.200	78	305	383	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2021	1.400	(86)	92	6	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	10.100	(724)	790	66	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	10.200	(531)	435	(96)	0,00
UAG	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2021	200	(15)	16	1	0,00
					\$ (78.552)	\$ 112.432	\$ 33.880	0,05

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	ABX.HE.AA.6-1 Index	0,320 %	25.07.2045	\$ 1.411	\$ (487)	\$ 396	\$ (91)	0,00
	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	48.437	(10.450)	8.194	(2.256)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	2.000	(5)	7	2	0,00
BRC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	3.810	(821)	643	(178)	0,00
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	100.000	(1.840)	2.070	230	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	13.800	(464)	475	11	0,00
	PRIMEX.ARM.2-AAA Index	4,580	25.12.2037	334	14	(10)	4	0,00
CBK	CDX.HY-33 5-Year Index 35-100 %	5,000	20.12.2024	58.582	9.754	656	10.410	0,01
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	233.645	(4.705)	7.740	3.035	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	645.100	(3.371)	10.891	7.520	0,01
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	688.600	(4.427)	12.454	8.027	0,01
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	162.200	(1.133)	2.443	1.310	0,00
GST	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	1.250	(252)	194	(58)	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.176.350	(15.149)	30.432	15.283	0,02
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	90.500	(473)	1.528	1.055	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	436.500	(12.201)	15.726	3.525	0,01
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	49.500	(1.449)	1.563	114	0,00
JPS	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	171.400	(2.957)	5.184	2.227	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	171.700	(1.351)	3.352	2.001	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	45.500	(336)	703	367	0,00
MEI	CDX.HY-33 5-Year Index 35-100 %	5,000	20.12.2024	118.545	19.753	1.312	21.065	0,03
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	66.700	(1.419)	2.285	866	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	364.800	(3.092)	7.344	4.252	0,01
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	923.900	(14.119)	21.580	7.461	0,01
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	1.200	(37)	38	1	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	810.495	(7.907)	18.436	10.529	0,02
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	152.400	(785)	2.561	1.776	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.386.500	(13.794)	24.991	11.197	0,02
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	15.500	(445)	646	201	0,00
					\$ (73.948)	\$ 183.834	\$ 109.886	0,15

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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	\$ (879)	\$ (879)	0,00
CBK	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,448	17.06.2025	1.075.000	0	(1.331)	(1.331)	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,845	23.01.2025	247.000	0	345	345	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,850	23.01.2025	245.400	0	350	350	0,00
UAG	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,833	23.01.2025	255.000	0	336	336	0,00
						\$ 0	\$ (1.179)	\$ (1.179)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

## 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	01.2021	BRL	977.000	\$ 189.893	\$ 1.799	\$ 0	\$ 1.799	0,00
	01.2021	€	95	115	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	¥	3.745.295	36.013	0	(265)	(265)	0,00
	01.2021	\$	75.177	AUD 101.813	3.390	0	3.390	0,01
	01.2021		189.127	BRL 977.000	69	(1.101)	(1.032)	0,00
	01.2021		7.063	€ 5.771	8	(9)	(1)	0,00
	01.2021		3.856	MXN 81.285	215	0	215	0,00
	01.2021		76.722	ZAR 1.203.684	5.019	0	5.019	0,01
	02.2021	NOK	4.305	\$ 486	0	(16)	(16)	0,00
	02.2021	\$	189.797	BRL 977.000	0	(1.764)	(1.764)	0,00
	02.2021		270.940	NOK 2.525.695	24.019	0	24.019	0,03
	02.2021		248.352	SEK 2.152.365	13.867	0	13.867	0,02
	02.2021		10.820	TRY 82.567	115	(4)	111	0,00
	03.2021		15.947	HKD 123.622	0	(1)	(1)	0,00
	03.2021		523.393	INR 39.372.267	11.624	0	11.624	0,02
BPS	01.2021	€	7.733	\$ 9.451	8	(20)	(12)	0,00
	01.2021	£	375.953	501.912	0	(12.012)	(12.012)	(0,02)
	01.2021	\$	30.954	CLP 24.350.568	3.314	0	3.314	0,01
	01.2021		130.300	€ 107.115	774	(3)	771	0,00
	01.2021		16.839	£ 12.468	204	0	204	0,00
	01.2021		14.230	TRY 109.633	488	0	488	0,00
	01.2021	ZAR	150.025	\$ 10.254	43	0	43	0,00
	02.2021	\$	4.377	DKK 27.424	134	0	134	0,00
	02.2021		402.850	MXN 9.164.039	55.253	0	55.253	0,08
	03.2021		4.993	SGD 6.738	106	0	106	0,00
	06.2021		85.522	MXN 1.830.757	4.712	0	4.712	0,01
	01.2021	BRL	189.036	\$ 35.891	0	(503)	(503)	0,00
	01.2021	£	106.667	142.374	0	(3.439)	(3.439)	0,00
	01.2021	\$	36.376	BRL 189.036	17	0	17	0,00
	01.2021		27.867	€ 22.937	200	0	200	0,00
01.2021		24.100	£ 17.865	321	0	321	0,00	
01.2021		36.436	TRY 282.795	1.362	0	1.362	0,00	
01.2021	ZAR	140.500	\$ 9.614	53	0	53	0,00	
02.2021	\$	35.875	BRL 189.036	507	0	507	0,00	
02.2021		152.375	MXN 3.492.018	22.188	0	22.188	0,03	
02.2021		22.523	TRY 172.993	489	(22)	467	0,00	
BSS	08.2021	CLP	4.120.528	\$ 6.084	281	0	281	0,00
	01.2021	€	32.852	39.637	0	(563)	(563)	0,00
	01.2021	£	1.869.276	2.498.728	0	(56.556)	(56.556)	(0,08)
	01.2021	¥	365.132	3.505	0	(31)	(31)	0,00
	01.2021	PEN	434.431	120.869	767	0	767	0,00
	01.2021	\$	32.271	CLP 25.233.112	3.239	0	3.239	0,01
	01.2021		29.008	€ 24.046	416	0	416	0,00
	01.2021		25.759	£ 19.272	586	0	586	0,00
	01.2021		8.390	MXN 175.001	376	0	376	0,00
	01.2021		1.299	NZD 1.847	30	0	30	0,00
	01.2021		38.908	RUB 2.993.782	1.524	0	1.524	0,00
	01.2021		3.783	TRY 29.329	153	0	153	0,00
	01.2021		166.725	ZAR 2.601.462	9.937	0	9.937	0,01
	01.2021	ZAR	1.145.702	\$ 76.620	30	(1.213)	(1.183)	0,00
	02.2021	PEN	286.198	79.430	289	0	289	0,00
02.2021	\$	4.611	DKK 28.775	122	0	122	0,00	
02.2021		60.348	MXN 1.386.122	8.944	0	8.944	0,01	
02.2021		237.648	NOK 2.180.565	17.007	0	17.007	0,02	
02.2021		47.224	RUB 3.477.916	0	(401)	(401)	0,00	
02.2021		261.694	SEK 2.301.530	18.697	0	18.697	0,03	
02.2021		18.498	TRY 141.639	259	(68)	191	0,00	
03.2021	PEN	5.382	\$ 1.479	0	(10)	(10)	0,00	
03.2021	\$	5.383	CNH 35.951	124	0	124	0,00	
03.2021		17.254	MXN 376.347	1.461	0	1.461	0,00	
04.2021		148.497	3.041.569	2.409	0	2.409	0,00	
05.2021	COP	20.255.902	\$ 5.522	0	(370)	(370)	0,00	
05.2021	PEN	36.415	10.112	47	0	47	0,00	
06.2021	\$	175.964	MXN 3.717.938	7.285	0	7.285	0,01	
06.2021		64.606	1.364.539	2.649	0	2.649	0,00	
02.2021		54.590	TRY 424.523	1.598	(15)	1.583	0,00	
DUB FBF GLM	01.2021	BRL	9.044	\$ 1.748	7	0	7	0,00
	01.2021	PEN	94.146	26.128	97	0	97	0,00
	01.2021	\$	1.740	BRL 9.044	1	0	1	0,00
	01.2021		74.203	¥ 7.680.041	187	0	187	0,00
	01.2021		8.830	MXN 178.343	136	(32)	104	0,00
	01.2021		52.022	PEN 187.539	0	(176)	(176)	0,00
	01.2021		48.645	RUB 3.726.875	1.687	0	1.687	0,00
	01.2021		6.180	TRY 47.894	247	0	247	0,00
	01.2021	ZAR	509.461	\$ 34.142	0	(454)	(454)	0,00
	02.2021	¥	7.680.041	74.224	0	(189)	(189)	0,00
	02.2021	\$	1.747	BRL 9.044	0	(6)	(6)	0,00
	02.2021		3.567	DKK 22.239	90	0	90	0,00
	02.2021		125.372	RUB 9.575.019	3.655	0	3.655	0,01
	02.2021		19.074	TRY 145.203	281	(105)	176	0,00
	04.2021	PEN	187.539	\$ 51.997	155	0	155	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
HUS	05.2021	\$	11.970	MXN	257.470	\$	751	0,00	
	01.2021	BRL	678.813	\$	130.624		0	0,00	
	01.2021	€	341.638		409.419		(8.626)	(0,01)	
	01.2021	£	60.402		79.844		(2.725)	0,00	
	01.2021	HKD	3.999		516		0	0,00	
	01.2021	¥	674.546		6.473		(61)	0,00	
	01.2021	\$	133.411	BRL	678.813		(2.724)	0,00	
	01.2021		124.061	€	101.892	644	(25)	0,00	
	01.2021		40.442	£	30.077	673	0	0,00	
	01.2021		4.793	HKD	37.160	0	0	0,00	
	01.2021		6.766	RUB	510.656	131	0	0,00	
	01.2021		15	SGD	20	0	0	0,00	
	01.2021		210.626	ZAR	3.303.393	13.704	0	13.704	0,02
	01.2021	ZAR	252.422	\$	17.219	38	0	38	0,00
	02.2021	\$	146.044	RUB	10.879.919	748	(299)	449	0,00
	02.2021		3.665	TRY	27.283	0	(41)	(41)	0,00
	03.2021	PEN	6.327	\$	1.762	13	0	13	0,00
	03.2021	\$	160.293	MXN	3.486.136	13.377	0	13.377	0,02
	05.2021		126.821		2.725.304	7.830	0	7.830	0,01
	06.2021		49.272		1.040.908	2.032	0	2.032	0,00
02.2021		3.329	TRY	25.178	16	0	16	0,00	
04.2021		84.709	MXN	1.734.631	1.353	0	1.353	0,00	
JPM	01.2021	BRL	1.374.191	\$	266.833		2.270	0,00	
01.2021	€	3.375.154		4.049.331	0	(80.670)	(80.670)	(0,11)	
01.2021	£	106.667		142.365	0	(3.448)	(3.448)	0,00	
01.2021	\$	56.627	AUD	76.962	2.763	0	2.763	0,00	
01.2021		264.435	BRL	1.374.191	127	0	127	0,00	
01.2021		2.829	€	2.317	6	0	6	0,00	
01.2021		964	MXN	19.857	31	0	31	0,00	
01.2021		60.757	TRY	472.299	2.433	0	2.433	0,00	
01.2021	ZAR	208.105	\$	14.169	37	0	37	0,00	
02.2021	NOK	1.005		105	0	(12)	(12)	0,00	
02.2021	\$	266.695	BRL	1.374.191	0	(2.218)	(2.218)	0,00	
02.2021		60.753	TRY	469.979	1.363	(94)	1.269	0,00	
05.2021		56.434	MXN	1.211.246	3.411	0	3.411	0,01	
MYI	01.2021	AUD	2	\$	1		0	0,00	
01.2021	CHF	3		3	0	0	0	0,00	
01.2021	€	18.650		22.871	53	(1)	52	0,00	
01.2021	£	830		1.118	0	(17)	(17)	0,00	
01.2021	HKD	3.869		499	0	0	0	0,00	
01.2021	SGD	4.293		3.238	0	(10)	(10)	0,00	
01.2021	\$	3.513	AUD	4.565	9	0	9	0,00	
01.2021		8	CHF	7	0	0	0	0,00	
01.2021		2.579	€	2.114	8	0	8	0,00	
01.2021		11.604	£	8.531	59	0	59	0,00	
01.2021		92	SGD	122	0	0	0	0,00	
01.2021		28.460	TRY	220.366	1.123	0	1.123	0,00	
01.2021		63.589	ZAR	975.652	2.666	0	2.666	0,00	
02.2021		5.771	TRY	43.860	15	0	15	0,00	
01.2021		9.876	£	7.407	249	0	249	0,00	
RBC	01.2021	ZAR	239.562	\$	16.258		0	(10)	0,00
RYL	02.2021	\$	15.393	TRY	117.100		154	(46)	0,00
03.2021	HKD	15	\$	2			0	0	0,00
05.2021	\$	14.094	MXN	302.812	867		0	867	0,00
SCX	01.2021	BRL	83.297	\$	16.029		0	(8)	0,00
01.2021	€	737		889	0		0	(13)	0,00
01.2021	£	585.293		782.677	0	(17.414)	(17.414)	(0,02)	
01.2021	\$	33.105	AUD	44.939	1.574	0	1.574	0,00	
01.2021		15.570	BRL	83.297	467	0	467	0,00	
01.2021		1.097	CHF	992	26	0	26	0,00	
01.2021		6.271	€	5.117	0	(10)	(10)	0,00	
01.2021		16.696	£	12.361	201	0	201	0,00	
01.2021		3.460	MXN	69.742	33	0	33	0,00	
01.2021		31.089	TRY	239.260	1.049	0	1.049	0,00	
01.2021		243	ZAR	3.677	7	0	7	0,00	
01.2021	ZAR	504.996	\$	33.779	0	(515)	(515)	0,00	
02.2021	\$	43.818	RUB	3.358.951	1.477	0	1.477	0,00	
02.2021		30.721	TRY	232.502	170	(162)	8	0,00	
03.2021		508.227	IDR	7.317.957.736	14.804	0	14.804	0,02	
SOG	01.2021	€	1.569.910	\$	1.883.288		0	(37.729)	(0,05)
02.2021	\$	7.806	TRY	59.185	58	0	58	0,00	
SSB	01.2021	£	1.308.493	\$	1.746.608		0	(42.090)	(0,06)
01.2021	\$	5.247	£	3.903	88	0	88	0,00	
01.2021		4.008	MXN	81.100	61	(7)	54	0,00	
01.2021		14.174	ZAR	217.600	603	0	603	0,00	
TOR	01.2021	BRL	1.562.010	\$	300.577		0	(145)	0,00
01.2021	CAD	32.651		25.203	0		0	(426)	0,00
01.2021	¥	2.895.068		27.752	0	(290)	(290)	0,00	
01.2021	\$	293.779	BRL	1.562.010	6.943	0	6.943	0,01	
01.2021		25.629	CAD	32.651	0	0	0	0,00	
01.2021		1.651	£	1.229	29	0	29	0,00	
01.2021		3.812	TRY	29.547	153	0	153	0,00	
01.2021	ZAR	2.289.706	\$	154.764	0	(764)	(764)	0,00	
02.2021	CAD	32.651		25.631	0	0	0	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
UAG	02.2021	\$ 3.634	TRY 27.574	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	01.2021	BRL 13.175	\$ 2.558	21	0	21	0,00
	01.2021	CAD 788	616	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 111.190	AUD 151.230	5.511	0	5.511	0,01
	01.2021	2.535	BRL 13.175	1	0	1	0,00
	01.2021	355	HKD 2.750	0	0	0	0,00
	01.2021	14.661	MXN 294.567	110	(15)	95	0,00
	01.2021	59.559	TRY 461.858	2.247	0	2.247	0,00
	01.2021	ZAR 509.461	\$ 34.270	0	(327)	(327)	0,00
	02.2021	\$ 2.556	BRL 13.175	0	(21)	(21)	0,00
	02.2021	5.493	DKK 34.308	150	0	150	0,00
	02.2021	369.686	RUB 27.922.102	6.828	(398)	6.430	0,01
	02.2021	3.665	TRY 28.642	113	0	113	0,00
					\$ 336.752	\$ (280.776)	\$ 55.976

### ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen 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	01.2021	AUD 685	\$ 513	\$ 0	\$ (16)	\$ (16)	0,00
	01.2021	\$ 4.843	AUD 6.460	142	0	142	0,00
BPS	01.2021	43.321	58.895	2.127	0	2.127	0,00
BRC	01.2021	809	1.064	13	0	13	0,00
CBK	01.2021	632	828	7	0	7	0,00
HUS	01.2021	AUD 5.335	\$ 4.035	0	(82)	(82)	0,00
	01.2021	\$ 565.233	AUD 765.737	25.671	0	25.671	0,04
JPM	01.2021	149.049	202.571	7.272	0	7.272	0,01
MYI	01.2021	AUD 395	\$ 292	0	(13)	(13)	0,00
SCX	01.2021	\$ 252.130	AUD 341.133	11.116	0	11.116	0,02
	01.2021	AUD 3.340	\$ 2.573	2	(7)	(5)	0,00
TOR	01.2021	\$ 120.788	AUD 163.915	5.702	0	5.702	0,01
	01.2021	77.318	104.664	3.449	0	3.449	0,00
UAG	01.2021	462.061	627.589	22.236	0	22.236	0,03
				\$ 77.737	\$ (118)	\$ 77.619	0,11

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	BRL 549.952	\$ 108.665	\$ 2.787	\$ 0	\$ 2.787	0,00
	01.2021	\$ 105.827	BRL 549.952	51	0	51	0,00
	02.2021	108.608	549.952	0	(2.764)	(2.764)	(0,01)
BPS	01.2021	BRL 52.932	\$ 10.186	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	\$ 10.171	BRL 52.932	84	(64)	20	0,00
BRC	02.2021	3.668	19.055	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	BRL 989.778	\$ 190.463	0	(92)	(92)	0,00
CBK	01.2021	\$ 186.506	BRL 989.778	4.048	0	4.048	0,01
	01.2021	BRL 1.016.630	\$ 200.915	5.191	0	5.191	0,01
GLM	01.2021	\$ 190.358	BRL 1.016.630	5.366	0	5.366	0,01
	02.2021	200.810	1.016.630	0	(5.149)	(5.149)	(0,01)
	01.2021	BRL 4.086	\$ 804	17	0	17	0,00
HUS	01.2021	\$ 786	BRL 4.086	0	0	0	0,00
	02.2021	804	4.086	0	(17)	(17)	0,00
	01.2021	BRL 463.451	\$ 91.591	2.366	0	2.366	0,00
JPM	01.2021	\$ 89.182	BRL 463.451	43	0	43	0,00
	02.2021	91.543	463.451	0	(2.347)	(2.347)	0,00
	01.2021	BRL 4.086	\$ 786	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	\$ 805	BRL 4.086	0	(19)	(19)	0,00
	01.2021	BRL 1.016.630	\$ 200.816	5.092	0	5.092	0,01
	01.2021	\$ 195.630	BRL 1.016.630	94	0	94	0,00
SSB	02.2021	200.709	1.016.630	0	(5.048)	(5.048)	(0,01)
	01.2021	186.436	989.778	4.119	0	4.119	0,01
				\$ 29.258	\$ (15.506)	\$ 13.752	0,02

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 28.202	CAD 36.583	\$ 514	\$ 0	\$ 514	0,00
BPS	01.2021	7.114	9.175	88	0	88	0,00
CBK	01.2021	63.348	82.325	1.273	0	1.273	0,01
GLM	01.2021	CAD 385	\$ 302	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 157	CAD 200	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
HUS	01.2021	CAD 384	\$ 297	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
JPM	01.2021	\$ 11.326	CAD 14.730	236	0	236	0,00
MYI	01.2021	CAD 385	\$ 302	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	\$ 11.206	CAD 14.558	222	(2)	220	0,00
TOR	01.2021	CAD 82.545	\$ 64.792	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 63.717	CAD 82.545	1.076	0	1.076	0,00
	02.2021	64.799	82.545	0	0	0	0,00
				\$ 3.409	\$ (7)	\$ 3.402	0,01

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 230.670	CHF 208.337	\$ 5.044	\$ (1)	\$ 5.043	0,01
BPS	01.2021	CHF 1.577	\$ 1.787	5	(2)	3	0,00
	01.2021	\$ 10.757	CHF 9.511	4	0	4	0,00
BRC	01.2021	CHF 1.675	\$ 1.856	0	(38)	(38)	(0,01)
	01.2021	\$ 297	CHF 264	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	CHF 17	\$ 19	0	0	0	0,00
FBF	01.2021	274	308	0	(2)	(2)	0,00
GLM	01.2021	151	170	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2021	368	415	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 250.751	CHF 227.099	6.189	0	6.189	0,01
SCX	01.2021	21.007	18.980	468	(1)	467	0,00
SSB	01.2021	252.645	227.668	4.939	0	4.939	0,01
UAG	01.2021	CHF 3.772	\$ 4.261	2	(9)	(7)	0,00
	01.2021	\$ 2.201	CHF 1.952	8	0	8	0,00
				\$ 16.660	\$ (56)	\$ 16.604	0,02

Zum 31. Dezember 2020 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) ausschuttend A, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschuttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschuttend, Class E EUR (Hedged) ausschuttend II, Class E EUR (Hedged) ausschuttend II Q, G Retail EUR (Hedged) ausschuttend, H Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class R EUR (Hedged) ausschuttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend und Class T 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	01.2021	\$ 3.204	€ 2.609	\$ 0	(12)	(12)	0,00
BPS	01.2021	€ 204.627	\$ 249.915	321	(798)	(477)	0,00
	01.2021	\$ 68.226	€ 55.836	133	(34)	99	0,00
	02.2021	6.227.488	5.086.202	0	(26)	(26)	0,00
BRC	01.2021	1.701	1.392	2	0	2	0,00
	02.2021	683.857	558.529	0	(3)	(3)	0,00
CBK	01.2021	€ 60.831	\$ 73.012	0	(1.425)	(1.425)	0,00
	01.2021	\$ 44.876	€ 37.016	418	0	418	0,00
HUS	01.2021	€ 123.059	\$ 149.783	0	(799)	(799)	0,00
	01.2021	\$ 1.027.228	€ 856.812	21.237	(28)	21.209	0,03
JPM	01.2021	€ 5.464	\$ 6.672	0	(14)	(14)	0,00
	01.2021	\$ 8.029.882	€ 6.692.980	159.973	0	159.973	0,22
MYI	01.2021	€ 45.274	\$ 55.219	0	(180)	(180)	0,00
SCX	01.2021	\$ 5.644.532	€ 4.713.170	122.267	0	122.267	0,17
SOG	01.2021	5.109.363	4.259.169	102.364	0	102.364	0,14
TOR	01.2021	4.537.370	3.788.692	98.284	0	98.284	0,14
	02.2021	3.687.708	3.011.877	0	(15)	(15)	0,00
				\$ 504.999	\$ (3.334)	\$ 501.665	0,70

Zum 31. Dezember 2020 standen fur die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschuttend, Investor GBP (Hedged) ausschuttend, Administrative GBP (Hedged) ausschuttend, Class E GBP (Hedged) ausschuttend und Class R 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	01.2021	£ 482	\$ 645	\$ 0	\$ (14)	\$ (14)	0,00
BRC	01.2021	1.413	1.898	0	(34)	(34)	0,00
	01.2021	\$ 11.149	£ 8.184	38	0	38	0,00
CBK	01.2021	£ 3.908	\$ 5.300	0	(41)	(41)	0,00
	01.2021	\$ 335.314	£ 250.845	7.590	0	7.590	0,01
HUS	01.2021	£ 9.692	\$ 13.011	0	(238)	(238)	0,00
	01.2021	\$ 381.403	£ 285.159	8.407	0	8.407	0,01
MYI	01.2021	£ 263	\$ 353	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	\$ 30.707	£ 23.006	741	0	741	0,00
SCX	01.2021	£ 1.769	\$ 2.358	0	(60)	(60)	0,00
	01.2021	\$ 3.024	£ 2.247	47	0	47	0,00
SSB	01.2021	404.352	302.925	9.744	0	9.744	0,02
				\$ 26.567	\$ (392)	\$ 26.175	0,04

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional JPY (Hedged) thesaurierend und Class E JPY (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	01.2021	¥ 45.324	\$ 436	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	01.2021	\$ 4.636	¥ 482.070	34	0	34	0,00
BRC	01.2021	5.828	607.173	53	0	53	0,00
	02.2021	3.745	386.467	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	¥ 538.556	\$ 5.196	0	(21)	(21)	0,00
	01.2021	\$ 532	¥ 55.421	5	0	5	0,00
GLM	02.2021	5.197	538.556	21	0	21	0,00
	01.2021	¥ 944.374	\$ 9.124	0	(23)	(23)	0,00
HUS	01.2021	\$ 84	¥ 8.736	1	0	1	0,00
	02.2021	9.127	944.374	23	0	23	0,00
MYI	01.2021	982	102.386	9	0	9	0,00
SCX	01.2021	526	54.838	5	0	5	0,00
SSB	01.2021	6.799	708.369	62	0	62	0,00
	02.2021	9.002	929.075	0	0	0	0,00
	01.2021	7.915	824.803	74	0	74	0,00
				\$ 287	\$ (47)	\$ 240	0,00

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse 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	01.2021	NOK 422	\$ 48	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2021	\$ 79.465	NOK 702.399	2.572	0	2.572	0,00
BRC	01.2021	73.151	642.345	1.872	0	1.872	0,00
CBK	01.2021	NOK 268	\$ 30	0	(1)	(1)	0,00
GLM	01.2021	1.949	221	0	(7)	(7)	0,00
MYI	01.2021	451	51	0	(1)	(1)	0,00
RYL	01.2021	\$ 85.521	NOK 757.126	2.908	0	2.908	0,01
	01.2021	NOK 95	\$ 11	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	\$ 6.897	NOK 59.915	101	0	101	0,00
SSB	01.2021	NOK 32.743	\$ 3.749	0	(75)	(75)	0,00
	01.2021	5.991	691	0	(9)	(9)	0,00
				\$ 7.453	\$ (94)	\$ 7.359	0,01

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Investor RMB (Hedged) thesaurierend und Class E RMB (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	01.2021	\$ 21.322	CNH 140.378	\$ 285	\$ 0	\$ 285	0,00
BPS	01.2021	CNH 333.361	\$ 51.089	0	(224)	(224)	0,00
	01.2021	\$ 46.205	CNH 303.302	481	0	481	0,00
BRC	02.2021	CNH 1.477	\$ 227	0	0	0	0,00
	02.2021	\$ 51.087	CNH 333.974	224	0	224	0,00
GLM	01.2021	4.824	31.807	72	0	72	0,00
	01.2021	CNH 333.816	\$ 51.211	0	(171)	(171)	0,00
HUS	02.2021	\$ 51.161	CNH 334.103	170	0	170	0,00
	01.2021	CNH 158.945	\$ 24.343	0	(123)	(123)	0,00
IND	01.2021	\$ 48.656	CNH 320.751	716	0	716	0,00
	02.2021	24.450	159.948	123	0	123	0,00
MYI	02.2021	75	487	0	0	0	0,00
SOG	01.2021	531	3.470	2	0	2	0,00
SSB	01.2021	CNH 294	\$ 45	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 910	CNH 5.982	11	0	11	0,00
UAG	01.2021	CNH 834	\$ 128	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 3.802	CNH 25.028	51	0	51	0,00
	02.2021	98	637	0	0	0	0,00
				\$ 2.135	\$ (520)	\$ 1.615	0,00

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen 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	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2021	SGD 1.616.230	\$ 1.218.325	\$ 0	\$ (4.564)	\$ (4.564)	(0,01)
	02.2021	\$ 1.218.374	SGD 1.616.230	4.540	0	4.540	0,01
BRC	01.2021	SGD 13.602	\$ 10.156	0	(136)	(136)	0,00
CBK	01.2021	\$ 476.142	SGD 641.108	8.940	0	8.940	0,01
GLM	02.2021	SGD 12.237	\$ 9.262	3	0	3	0,00
	01.2021	5.656	4.211	0	(69)	(69)	0,00
HUS	02.2021	24.685	18.594	0	(85)	(85)	0,00
	02.2021	\$ 3.064	SGD 4.060	8	0	8	0,00
MYI	01.2021	SGD 770.616	\$ 579.105	0	(3.965)	(3.965)	(0,01)
	01.2021	\$ 54.398	SGD 72.746	643	0	643	0,00
	02.2021	579.129	770.616	3.954	0	3.954	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		
NGF	01.2021	SGD	1.623.169	\$ 1.218.138	\$ 0	\$ (10.001)	(0,01)		
	01.2021	\$	1.190.530	SGD 1.595.876	16.958	0	0,02		
	02.2021		1.218.169	1.623.169	9.996	0	0,01		
SCX	01.2021		1.191.896	1.599.413	18.268	0	0,03		
SSB	01.2021	SGD	1.300	\$ 972	0	(11)	0,00		
	01.2021	\$	88.128	SGD 118.209	1.313	0	0,00		
UAG	01.2021		2.391	3.219	45	0	0,00		
	02.2021		5.466	7.311	66	0	0,00		
						\$ 64.734	\$ (18.831)	\$ 45.903	0,06
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>							<b>\$ 911.904</b>	<b>1,28</b>	

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMOGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHORDEN</b>			
Freddie Mac, TBA			
4,000 % fallig am 01.01.2051	\$ 68.550	\$ (73.231)	(0,10)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fallig am 01.01.2051 (k)	35.365	(36.739)	(0,05)
2,500 % fallig am 01.01.2051 (k)	164.674	(173.602)	(0,25)
5,000 % fallig am 01.01.2051	32.000	(35.419)	(0,05)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (318.991)</b>	<b>(0,45)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 98.388.882</b>	<b>138,04</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (27.113.571)</b>	<b>(38,04)</b>
<b>Nettovermogen</b>		<b>\$ 71.275.311</b>	<b>100,00</b>

## 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) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.

(d) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.

(e) Nullkuponwertpapier.

(f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.

(g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.

(i) Mit dem Fonds verbunden.

(j) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(k) Zum 31. Dezember 2020 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in ubertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(l) Eingeschrankte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Chester A PLC 0,000 % fallig am 17.03.2046	18.04.2019	\$ 12.391	\$ 15.342	0,02
Chester A PLC 0,000 % fallig am 17.03.2046	18.04.2019	17.298	12.349	0,02
Chester A PLC 0,854 % fallig am 17.03.2046	18.04.2019	147.793	156.380	0,22
Chester A PLC 1,304 % fallig am 17.03.2046	18.04.2019	19.159	19.777	0,03
Chester A PLC 1,804 % fallig am 17.03.2046	18.04.2019	17.790	18.340	0,03
Chester A PLC 2,304 % fallig am 17.03.2046	18.04.2019	10.948	11.300	0,02
Chester A PLC 3,054 % fallig am 17.03.2046	18.04.2019	5.473	5.465	0,01
Export-Import Bank of India 1,271 % fallig am 28.03.2022	19.12.2019	56.240	56.677	0,08
General Motors Co. 6,800 % fallig am 01.10.2027	07.05.2020	3.314	4.273	0,01
Morgan Stanley 7,500 % fallig am 02.04.2032	11.02.2020	58.547	59.008	0,08
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	37.976	106.951	0,15
Noble Corp. PLC	23.12.2020	0	4.755	0,01
Sierra Hamilton Holder LLC	31.07.2017	560	0	0,00
Westmoreland Mining Holdings LLC	08.12.2014 -19.12.2019	1.691	622	0,00
		<b>\$ 389.180</b>	<b>\$ 471.239</b>	<b>0,68</b>

(m) Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 8.484.027 und Barmittel in Hohe von USD 28.627 als Sicherheiten verpfandet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Income Fund (Forts.)

(n) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 43.789 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 20.434 und Barmittel in Höhe von USD 16.889 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 1.401.610 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 15.500 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	32.344	1.875.740	(70)	1.908.014
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(318.991)	0	(318.991)
<b>Summen</b>	<b>\$ 2.487.816</b>	<b>\$ 95.215.009</b>	<b>\$ 686.057</b>	<b>\$ 98.388.882</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 380.320	\$ 96.754.505	\$ 434.305	\$ 97.569.130
Investmentfonds	1.769.800	0	0	1.769.800
Pensionsgeschäfte	0	204.048	0	204.048
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(23.173)	503.283	265	480.375
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(670.959)	0	(670.959)
<b>Summen</b>	<b>\$ 2.126.947</b>	<b>\$ 96.790.877</b>	<b>\$ 434.570</b>	<b>\$ 99.352.394</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Netto- vermögens
BOM	0,180 %	06.11.2020	08.02.2021	\$ (254.250)	\$ (254.321)	(0,36)
	0,190	14.12.2020	14.01.2021	(268.132)	(268.158)	(0,38)
	0,642	28.04.2020	28.04.2021	(53.562)	(53.624)	(0,08)
	(2,800)	08.10.2020	07.10.2022	€ (1.617)	(1.966)	0,00
	(2,800)	14.10.2020	13.10.2022	(84)	(102)	0,00
	(1,000)	09.12.2020	08.12.2022	(5.061)	(6.189)	(0,01)
	(0,900)	23.12.2020	08.12.2022	(8.772)	(10.731)	(0,02)
	(0,850)	02.12.2020	27.11.2022	(1.368)	(1.673)	0,00
	(0,750)	26.10.2020	21.10.2022	£ (1.221)	(1.667)	0,00
	(0,250)	16.12.2020	15.12.2022	\$ (1.415)	(1.414)	0,00
BOS	(0,150)	22.09.2020	15.01.2021	€ (23.290)	(28.485)	(0,04)
	0,614	11.05.2020	11.02.2021	\$ (76.506)	(76.570)	(0,11)
	(6,000)	09.12.2020	08.12.2022	(1.125)	(1.121)	0,00
	(2,500)	28.08.2020	18.05.2022	€ (6.868)	(8.342)	(0,01)
	(2,500)	22.10.2020	21.10.2022	(1.575)	(1.918)	0,00
	0,100	04.12.2020	03.12.2022	\$ (10.219)	(10.220)	(0,01)
	0,100	22.12.2020	21.12.2022	(4.676)	(4.676)	(0,01)
	0,150	22.06.2020	19.06.2022	(231)	(231)	0,00
	0,150	09.11.2020	06.11.2022	(23.078)	(23.083)	(0,03)
	0,613	31.07.2020	09.02.2021	(42.409)	(42.446)	(0,06)
BSN	0,613	08.05.2020	09.02.2021	(43.040)	(43.078)	(0,06)
	0,190	14.12.2020	14.01.2021	(627.297)	(627.356)	(0,88)
	(1,750)	18.11.2020	18.11.2022	€ (4.225)	(5.169)	(0,01)
	(0,850)	30.11.2020	27.11.2022	(7.350)	(8.986)	(0,01)
CFR	0,160	17.12.2020	19.01.2021	\$ (383.250)	(383.276)	(0,54)
	0,180	14.12.2020	14.01.2021	(707.496)	(707.560)	(0,99)
IND	0,190	14.12.2020	14.01.2021	(1.056.038)	(1.056.138)	(1,48)
	0,170	19.10.2020	14.01.2021	(536.250)	(536.437)	(0,75)
NXN	0,170	14.12.2020	14.01.2021	(1.273.532)	(1.273.640)	(1,79)
	0,170	15.12.2020	04.01.2021	(343.438)	(343.465)	(0,48)
RCY	0,160	02.12.2020	02.02.2021	(169.125)	(169.148)	(0,24)
	0,160	15.12.2020	15.01.2021	(195.000)	(195.015)	(0,27)
	0,180	10.11.2020	11.01.2021	(279.375)	(279.448)	(0,39)

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften		% des Nettovermögens
					\$	\$	
SCX	0,180 %	18.11.2020	18.02.2021	\$ (24.338)	\$ (24.343)	(0,03)	
SGY	0,170	14.10.2020	05.01.2021	(1.107.406)	(1.107.819)	(1,56)	
TDM	0,170	08.10.2020	11.02.2021	(299.004)	(299.124)	(0,42)	
	0,230	08.07.2020	07.01.2021	(416.314)	(416.784)	(0,59)	
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (8.273.723)</b>	<b>(11,61)</b>	

## Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPG	0,110 %	17.12.2020	11.01.2021	\$ (11.508)	\$ (11.508)	(0,02)
	0,140	17.12.2020	05.01.2021	(2.496)	(2.496)	0,00
	0,160	17.12.2020	12.01.2021	(1.279)	(1.279)	0,00
	0,170	17.12.2020	05.01.2021	(1.587)	(1.587)	0,00
	0,180	17.12.2020	19.01.2021	(2.645)	(2.646)	0,00
	0,180	17.12.2020	21.01.2021	(9.576)	(9.577)	(0,01)
	0,180	17.12.2020	22.01.2021	(2.381)	(2.381)	0,00
	0,180	17.12.2020	27.01.2021	(3.682)	(3.683)	(0,01)
	0,180	17.12.2020	28.01.2021	(5.026)	(5.027)	(0,01)
	0,180	17.12.2020	29.01.2021	(3.968)	(3.969)	(0,01)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (44.153)</b>	<b>(0,06)</b>

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 4 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 67.775	\$ (68.230)	(455)
BPS	59.308	(62.760)	(3.452)
BRC	28.570	(30.560)	(1.990)
BSS	281	(320)	(39)
CBK	49.169	(60.930)	(11.761)
DUB	32.283	(37.560)	(5.277)
FAR	(321)	550	229
FBF	10.995	(11.160)	(165)
GLM	5.846	(4.820)	1.026
GST	28.066	(27.820)	246
HUS	84.576	(82.780)	1.796
IND	1.369	(1.420)	(51)
JLN	(33)	0	(33)
JPM	94.141	(112.150)	(18.009)
JPS	4.228	(4.130)	98
MEI	367	(290)	77
MYC	41.670	(51.297)	(9.627)
MYI	25.297	(24.560)	737
NGF	17.312	(14.780)	2.532
RBC	239	0	239
RYL	1.076	(1.180)	(104)
SAL	23.163	(22.300)	863
SCX	147.330	(169.420)	(22.090)
SOG	64.703	(79.950)	(15.247)
SSB	(20.906)	14.950	(5.956)
TOR	108.297	(131.340)	(23.043)
UAG	37.103	(30.980)	6.123

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	54,16	63,71
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	72,93	56,63
Sonstige übertragbare Wertpapiere	5,15	k. A.
Investmentfonds	3,55	2,18
Pensionsgeschäfte	0,02	0,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,05	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,35	(0,08)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,28	0,70
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,45)	(0,82)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(11,61)	(2,94)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,06)	(0,21)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	4,01	3,07
Unternehmensanleihen und Wechsel	39,29	31,33
Wandelanleihen & Wechsel	0,04	0,07
Kommunalanleihen und Wechsel	0,41	0,38
US-Regierungsbehörden	41,37	37,53
US-Schatzobligationen	12,64	14,90
Non-Agency-MBS	13,84	13,21
Forderungsbesicherte Wertpapiere	11,83	15,07
Staatsemissionen	7,57	3,64
Stammaktien	0,29	0,34
Optionsscheine	0,23	0,20
Vorzugswertpapiere	0,30	0,24
Real Estate Investment Trusts	0,22	0,18
Kurzfristige Instrumente	0,20	0,18
Investmentfonds	3,55	2,18
Pensionsgeschäfte	0,02	0,25
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,05	(0,02)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,05)	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,17	(0,05)
Zinsswaps	1,22	(0,01)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,05	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	0,00
Devisenoptionen	(0,01)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,01)
Optionen auf Wertpapiere	0,01	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,05	(0,07)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,15	0,09
Zinsswaps	0,00	k. A.
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,01
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,08	(0,20)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,97	0,88
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,45)	(0,82)
Sonstige Aktiva und Passiva	(38,04)	(22,54)
Nettovermögen	100,00	100,00



## Aufstellung der Wertpapieranlagen Inflation Strategy Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ONEOK, Inc.	12.938	\$ 497	0,71	AvalonBay Communities, Inc.	1.990	\$ 319	0,45	Public Storage	2.088	\$ 482	0,69
Pembina Pipeline Corp.	11.750	278	0,40	Boston Properties, Inc.	1.490	141	0,20	QTS Realty Trust, Inc. 'A'	995	62	0,09
Rattler Midstream LP	8.215	78	0,11	Camden Property Trust	1.102	110	0,16	Realty Income Corp.	2.984	185	0,26
Targa Resources Corp.	7.141	188	0,27	CoreSite Realty Corp.	368	46	0,07	Regency Centers Corp.	2.338	107	0,15
TC Energy Corp.	5.066	206	0,29	Crown Castle International Corp.	589	94	0,13	Rexford Industrial Realty, Inc.	1.918	94	0,13
Williams Cos., Inc.	20.940	420	0,60	Digital Realty Trust, Inc.	2.594	362	0,52	Sabra Health Care REIT, Inc.	1.386	24	0,03
		2.779	3,97	Douglas Emmett, Inc.	1.481	43	0,06	SBA Communications Corp.	1.022	288	0,41
<b>FINANZWERTE</b>				Duke Realty Corp.	5.178	207	0,30	Simon Property Group, Inc.	1.177	100	0,14
National General Holdings Corp.	2.035	69	0,10	Equinix, Inc.	299	214	0,30	Sun Communities, Inc.	1.538	234	0,33
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Equity LifeStyle Properties, Inc.	1.618	102	0,15	Sunstone Hotel Investors, Inc.	3.231	37	0,05
Navistar International Corp. (a)	1.501	66	0,10	Equity Residential	3.150	187	0,27	UDR, Inc.	4.181	161	0,23
<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				Essex Property Trust, Inc.	918	218	0,31	Vornado Realty Trust	2.770	103	0,15
PNM Resources, Inc.	1.296	63	0,09	Extra Space Storage, Inc.	1.068	124	0,18	Welltower, Inc.	3.788	245	0,35
		3.049	4,36	Federal Realty Investment Trust	784	67	0,10				
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				First Industrial Realty Trust, Inc.	2.559	108	0,15				
Nationwide Building Society	3.685	892	1,27	Gaming and Leisure Properties, Inc.	1.415	60	0,09	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 94.181	134,47	
<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>				Healthcare Realty Trust, Inc.	2.109	62	0,09	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Agree Realty Corp.	746	50	0,07	Healthcare Trust of America, Inc. 'A'	937	26	0,04	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	871	155	0,22	Healthpeak Properties, Inc.	6.781	205	0,29	PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
American Homes 4 Rent 'A'	4.575	137	0,20	Host Hotels & Resorts, Inc.	8.543	125	0,18	US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	261.155	2.602	3,71
Americold Realty Trust	2.700	101	0,14	Hudson Pacific Properties, Inc.	3.628	87	0,12	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
Apartment Income REIT Corp.	719	28	0,04	Invitation Homes, Inc.	3.721	110	0,16	Invesco Physical Gold ETC	17.926	3.295	4,71
Apartment Investment and Management Co. 'A'	718	4	0,01	JBG SMITH Properties	866	27	0,04	Summe Investmentfonds	\$ 5.897	8,42	
				Kilroy Realty Corp.	1.394	80	0,11				
				Kimco Realty Corp.	3.978	60	0,09				
				Life Storage, Inc.	479	57	0,08				
				MGM Growth Properties LLC 'A'	7.124	223	0,32				
				Mid-America Apartment Communities, Inc.	1.445	183	0,26				
				Prologis, Inc.	8.493	846	1,21				

### PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Netto- vermögens
SSB	0,00 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 571	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021	\$ (582)	\$ 571	\$ 571	0,82
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (582)	\$ 571	\$ 571	0,82

<sup>(1)</sup> 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 March Futures	Short	03.2021	8	\$ 0	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	1	(1)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @ EUR 100,625 auf 3-Month EURIBOR September 2022 Futures <sup>(1)</sup>	Short	09.2022	23	1	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2021	48	6	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2021	2	(2)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	4	2	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	1	2	0,00
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2021	56	6	0,01
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	1	0	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2021	8	(2)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2021	47	(16)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	43	1	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	16	4	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	9	(13)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	8	6	0,01
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2021	2	3	0,00
				\$ (3)	(0,01)

<sup>(1)</sup> Future-Style-Option.

## OPTIONSKAUF

### OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call - CME 90-Day Eurodollar September 2022 Futures	\$ 99,625	19.09.2022	11	\$ 3	\$ 6	0,01
Call - CME 90-Day Eurodollar September 2022 Futures	99,750	19.09.2022	16	3	4	0,01
				\$ 6	\$ 10	0,02
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$	7	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-KOMMUNALEMISSESIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Altria Group, Inc.	(1,000) %	20.06.2021	\$ 100	\$ 3	0,01

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 300	\$ (5)	(0,01)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000 %	20.06.2024	\$ 470	\$ 20	0,03
CDX.EM-33 5-Year Index	1,000	20.06.2025	570	69	0,10
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	200	8	0,01
				\$ 97	0,14

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,700 %	02.01.2024	BRL 17.500	\$ 82	0,12
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,650	02.01.2025	5.600	236	0,34
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,945	02.01.2025	11.200	461	0,66
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,970	02.01.2025	1.600	67	0,09
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,300	02.01.2025	21.500	853	1,22
Erhalt <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,394	21.11.2023	\$ 4.300	(4)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 4.200	(1)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	£ 700	(2)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051	100	(2)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	¥ 154.390	(48)	(0,07)
Erhalt	CPTFEMU	0,500	15.05.2027	€ 300	10	0,01
Erhalt	CPTFEMU	1,324	15.03.2029	500	(21)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA	1,030	18.06.2021	\$ 1.100	(12)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	1,280	19.05.2030	600	(56)	(0,08)
Zahlung	CPURNSA	1,335	01.07.2021	400	(5)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,400	08.07.2021	600	(7)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,420	09.07.2021	500	(6)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,690	07.08.2021	1.500	(16)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	1,794	24.08.2027	850	28	0,04
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	300	10	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,825	14.08.2021	900	(8)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,840	14.08.2021	500	(4)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,863	26.08.2021	600	(4)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	500	13	0,02
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	750	(10)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,165	16.04.2029	500	5	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,220	13.04.2023	1.380	(29)	(0,04)
Erhalt	CPURNSA	2,263	27.04.2023	80	(2)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,263	09.05.2023	300	(7)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,281	10.05.2023	460	(12)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	300	12	0,02
Zahlung	CPURNSA	2,360	09.05.2028	450	19	0,03
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	460	19	0,03
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	300	13	0,02
Zahlung	FRCPXTOB	1,280	15.11.2034	€ 200	9	0,01
Erhalt	FRCPXTOB	1,345	15.06.2021	660	(19)	(0,03)
Zahlung	FRCPXTOB	1,590	15.02.2028	180	20	0,03

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Inflation Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	UKRPI	3,330 %	15.01.2025	£ 3.400	\$ 49	0,07
Zahlung	UKRPI	3,475	15.08.2030	300	0	0,00
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	1.400	62	0,09
Zahlung	UKRPI	3,500	15.09.2033	190	19	0,03
Zahlung	UKRPI	3,695	15.12.2028	480	55	0,08
Zahlung	UKRPI	3,850	15.09.2024	400	34	0,05
					\$ 1.801	2,57
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ 1.896</b>	<b>2,71</b>

- (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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### 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

##### DEIVENSOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
HUS	Put - OTC GBP versus USD	\$ 1,315	07.01.2021	2.070	\$ 27	\$ 0	0,00

##### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,195 %	02.11.2022	200	\$ 0	\$ 14	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	250	19	18	0,02
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,197	04.11.2022	150	11	10	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,344	17.11.2022	10.000	11	16	0,02
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,190	02.11.2022	200	15	14	0,02
							\$ 56	\$ 72	0,10

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.02.2051	\$ 64,000	04.02.2021	4.800	\$ 0	\$ 0	0,00

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450 %	20.01.2021	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	100	0	0	0,00
BPS	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	300	(1)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	600	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	1.000	(1)	(1)	(0,01)
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	300	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	300	0	(1)	0,00
BRC	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	600	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	600	(1)	(1)	0,00
GST	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	600	0	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	600	(1)	(1)	0,00
						\$ (7)	\$ (6)	(0,01)

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	300	\$ (14)	\$ 0	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000 %	02.11.2022	600	\$ 0	\$ (12)	(0,02)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	740	(18)	(16)	(0,02)
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	04.11.2022	460	(11)	(10)	(0,01)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,526	17.11.2022	8.400	(13)	(11)	(0,01)
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,000	02.11.2022	600	(15)	(13)	(0,02)
							\$ (57)	\$ (62)	(0,08)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	\$ 102,906	11.03.2021	100	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	200	0	0	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	100	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	100	0	0	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,406	04.02.2021	500	(2)	(2)	(0,01)
					\$ (3)	\$ (3)	(0,01)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 200	\$ (6)	\$ 9	\$ 3	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	800	(26)	36	10	0,02
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)	17	5	0,01
					\$ (44)	\$ 64	\$ 20	0,03

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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
MYC	Erhalt	CPURNSA	1,800 %	20.07.2026	\$ 600	\$ 0	\$ (16)	\$ (16)	(0,02)
	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	50	0	(1)	(1)	0,00
	Erhalt	CPURNSA	1,810	19.07.2026	500	0	(12)	(12)	(0,02)
						\$ 0	\$ (29)	\$ (29)	(0,04)

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile an Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Zahlung	BCOMF1TC Index	20.257	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 1.377	16.02.2021	\$ 0	\$ 42	\$ 42	0,06
	Zahlung	BCOMTR Index	3.610	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	583	16.02.2021	0	18	18	0,02
CBK	Zahlung	BCOMF1TC Index	5.431	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	422	16.02.2021	0	13	13	0,02
	Zahlung	BCOMTR Index	711	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	115	16.02.2021	0	4	4	0,01
	Zahlung	AMZX Index	317	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	203	22.04.2021	0	55	55	0,08
FBF	Erhalt	DWRTFT Index	107	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.092	25.08.2021	0	0	0	0,00
GST	Zahlung	BCOMF1TC Index	2.547	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	642	16.02.2021	0	20	20	0,03
	Zahlung	BCOMTR Index	1.614	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	261	16.02.2021	0	8	8	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Inflation Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Erhalt	BCOMTR Index	2.323	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 375	15.01.2021	\$ 0	\$ (12)	\$ (12)	(0,02)
	Zahlung	BCOMF1TC Index	28.657	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	3.776	16.02.2021	0	115	115	0,16
	Zahlung	JMABDEWU Index	16.708	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.655	16.02.2021	0	9	9	0,01
	Erhalt	DWRTFT Index	595	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	6.060	09.06.2021	0	(10)	(10)	(0,01)
SOG	Zahlung	TRNGLU Index	314	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	1.276	20.01.2021	0	219	219	0,31
UAG	Zahlung	DWRTFT Index	15	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	153	25.08.2021	0	0	0	0,00
UBS	Zahlung	TRNGLU Index	1.205	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	5.692	09.06.2021	0	47	47	0,07
							\$ 0	\$ 528	\$ 528	0,75

### 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
BOA	Zahlung	Energy Transfer LP	96.412	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 674	15.01.2021	\$ 0	\$ (77)	\$ (77)	(0,11)
	Zahlung	Western Midstream Partners LP	14.120	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	211	15.01.2021	0	(16)	(16)	(0,02)
	Zahlung	Energy Transfer LP	8.421	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	52	15.04.2021	0	0	0	0,00
	Zahlung	Holly Energy Partners LP	7.229	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	103	15.04.2021	0	0	0	0,00
	Zahlung	Enable Midstream Partners LP	9.976	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	52	17.05.2021	0	0	0	0,00
	Zahlung	Equitrans Midstream Corp.	46.689	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	375	17.05.2021	0	0	0	0,00
	Zahlung	Holly Energy Partners LP	7.670	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	108	17.05.2021	0	1	1	0,00
	Zahlung	Enterprise Products Partners LP	15.309	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	330	15.09.2021	0	(30)	(30)	(0,04)
	Zahlung	Genesis Energy LP	25.037	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	187	15.11.2021	0	(31)	(31)	(0,04)
	Zahlung	MPLX LP	44.874	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.041	15.11.2021	0	(70)	(70)	(0,10)
	Zahlung	Plains All American Pipeline LP	51.734	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	460	15.11.2021	0	(34)	(34)	(0,05)
CBK	Zahlung	DCP Midstream LP	28.162	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	568	16.02.2021	0	(46)	(46)	(0,07)
	Zahlung	Equitrans Midstream Corp.	8.910	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	78	16.02.2021	0	(6)	(6)	(0,01)
	Zahlung	Cheniere Energy Partners LP	7.175	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	253	17.05.2021	0	0	0	0,00
	Zahlung	Equitrans Midstream Corp.	2.880	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	24	15.11.2021	0	(1)	(1)	0,00
FAR	Zahlung	MPLX LP	148	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3	15.09.2021	0	0	0	0,00
	Zahlung	Enterprise Products Partners LP	6.463	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	139	15.10.2021	0	(13)	(13)	(0,02)
MYI	Zahlung	Plains All American Pipeline LP	28.012	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	249	15.01.2021	0	(19)	(19)	(0,03)
	Zahlung	Crestwood Equity Partners LP	7.317	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	142	16.02.2021	0	(3)	(3)	0,00
	Zahlung	Enterprise Products Partners LP	25.105	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	492	15.04.2021	0	0	0	0,00
	Zahlung	NuStar Energy LP	6.782	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	98	15.04.2021	0	0	0	0,00
	Zahlung	Magellan Midstream Partners LP	6.117	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	260	17.05.2021	0	0	0	0,00
	Zahlung	Western Midstream Partners LP	34.753	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	519	15.09.2021	0	(39)	(39)	(0,06)
	Zahlung	Cheniere Energy Partners LP	1.278	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	47	15.10.2021	0	(2)	(2)	0,00
	Zahlung	Crestwood Equity Partners LP	14.288	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	277	15.11.2021	0	(6)	(6)	(0,01)
	Zahlung	Enable Midstream Partners LP	36.933	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	212	15.11.2021	0	(17)	(17)	(0,03)
	Zahlung	NuStar Energy LP	29.119	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	469	15.11.2021	0	(49)	(49)	(0,07)
	Zahlung	Phillips 66 Partners LP	10.495	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	314	15.11.2021	0	(37)	(37)	(0,05)
	Zahlung	Sunoco LP	8.019	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	239	15.11.2021	0	(8)	(8)	(0,01)
							\$ 0	\$ (503)	\$ (503)	(0,72)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	¥ 146.876	\$ 1.412	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	(0,01)
	01.2021	\$ 12	PLN 48	0	0	0	0,00
	03.2021	84	THB 2.550	1	0	1	0,00
BPS	01.2021	AUD 827	\$ 608	0	(30)	(30)	(0,04)
	01.2021	CAD 230	177	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	£ 302	403	0	(10)	(10)	(0,01)
	01.2021	\$ 100	£ 74	1	0	1	0,00
	01.2021	4	PLN 16	0	0	0	0,00
BRC	02.2021	DKK 7.449	\$ 1.195	0	(30)	(30)	(0,04)
	01.2021	\$ 95	£ 70	0	0	0	0,00
	01.2021	709	TRY 5.592	39	0	39	0,06
CBK	01.2021	BRL 3.766	\$ 716	0	(9)	(9)	(0,01)
	01.2021	CAD 1.708	1.314	0	(26)	(26)	(0,04)
	01.2021	¥ 14.319	137	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	PEN 159	44	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 725	BRL 3.766	0	0	0	0,00
	01.2021	328	€ 272	5	0	5	0,01
	01.2021	317	£ 237	7	0	7	0,01
	01.2021	2.925	¥ 303.182	12	0	12	0,02
	01.2021	6	RUB 442	0	0	0	0,00
	01.2021	1	TRY 11	0	0	0	0,00
	01.2021	ZAR 334	\$ 21	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	DKK 4.317	692	0	(18)	(18)	(0,03)
	02.2021	¥ 303.182	2.925	0	(12)	(12)	(0,02)
	02.2021	PEN 783	217	1	0	1	0,00
	02.2021	\$ 7	RUB 514	0	0	0	0,00
	03.2021	CNH 414	\$ 62	0	(1)	(1)	0,00
	03.2021	HKD 171	22	0	0	0	0,00
03.2021	\$ 551	MXN 12.040	49	0	49	0,07	
04.2021	160	3.274	3	0	3	0,00	
GLM	01.2021	MXN 6.573	\$ 326	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 305	MXN 6.100	1	0	1	0,00
	01.2021	7	RUB 550	0	0	0	0,00
	01.2021	25	TRY 194	1	0	1	0,00
	02.2021	BRL 1.158	\$ 223	0	0	0	0,00
	02.2021	\$ 50	DKK 300	0	0	0	0,00
	02.2021	30	RUB 2.258	1	0	1	0,00
	04.2021	COP 572.263	\$ 156	0	(11)	(11)	(0,02)
	01.2021	BRL 15.699	3.103	81	0	81	0,11
	01.2021	€ 402	482	0	(10)	(10)	(0,01)
01.2021	£ 7.031	9.404	0	(209)	(209)	(0,30)	
01.2021	¥ 26.453	254	0	(2)	(2)	0,00	
01.2021	\$ 3.021	BRL 15.699	1	0	1	0,00	
01.2021	11	PLN 40	0	0	0	0,00	
01.2021	ZAR 443	\$ 28	0	(2)	(2)	0,00	
02.2021	ILS 615	187	0	(4)	(4)	(0,01)	
02.2021	\$ 3.101	BRL 15.699	0	(80)	(80)	(0,11)	
02.2021	35	RUB 2.618	0	0	0	0,00	
03.2021	65	CNY 429	1	0	1	0,00	
JPM	01.2021	AUD 565	\$ 416	0	(20)	(20)	(0,03)
	01.2021	BRL 367	71	0	0	0	0,00
	01.2021	€ 10.340	12.405	0	(248)	(248)	(0,35)
	01.2021	\$ 68	BRL 367	3	0	3	0,00
	01.2021	380	CAD 486	1	0	1	0,00
	01.2021	95	CLP 74.939	10	0	10	0,01
	01.2021	78	TRY 617	5	0	5	0,01
	01.2021	128	ZAR 1.974	6	0	6	0,01
	01.2021	ZAR 2.568	\$ 166	0	(8)	(8)	(0,01)
	01.2021	€ 30	36	0	0	0	0,00
01.2021	¥ 9.400	90	0	(1)	(1)	0,00	
01.2021	\$ 1	€ 1	0	0	0	0,00	
02.2021	1	PLN 3	0	0	0	0,00	
02.2021	196	ILS 644	4	0	4	0,01	
SCX	01.2021	AUD 330	\$ 243	0	(12)	(12)	(0,02)
	02.2021	\$ 617	ILS 2.120	43	0	43	0,06
SSB	01.2021	CAD 349	\$ 268	0	(6)	(6)	(0,01)
	01.2021	MXN 518	26	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 630	BRL 3.294	4	0	4	0,01
	03.2021	116	KRW 129.142	3	0	3	0,00
TOR	01.2021	BRL 15.804	\$ 3.041	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	¥ 113.534	1.088	0	(11)	(11)	(0,02)
	01.2021	\$ 2.971	BRL 15.804	72	0	72	0,10
UAG	01.2021	71	¥ 7.400	1	0	1	0,00
	01.2021	AUD 1.110	\$ 816	0	(40)	(40)	(0,06)
	02.2021	DKK 5.147	824	0	(23)	(23)	(0,03)
	02.2021	RUB 2.667	35	0	(1)	(1)	0,00
02.2021	\$ 85	RUB 6.427	2	0	2	0,00	
				\$ 358	\$ (843)	\$ (485)	(0,69)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Inflation Strategy Fund (Forts.)

### ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Class E (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	01.2021	€ 3	\$ 4	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2021	10	12	0	0	0	0,00
	01.2021	HKD 104	13	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 629	€ 521	7	0	7	0,01
	02.2021	13	HKD 104	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	120	€ 100	2	0	2	0,01
HUS	01.2021	€ 412	\$ 500	0	(4)	(4)	(0,01)
	01.2021	\$ 364	€ 304	8	0	8	0,01
	01.2021	13	HKD 104	0	0	0	0,00
JPM	01.2021	27	€ 22	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	18	15	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	2.930	2.447	63	0	63	0,09
	02.2021	4.599	3.756	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	2.763	2.307	60	0	60	0,09
	02.2021	1.438	1.174	0	0	0	0,00
				\$ 140	\$ (4)	\$ 136	0,20

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 123	£ 92	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
CBK	01.2021	117	87	3	0	3	0,00
HUS	01.2021	£ 123	\$ 165	0	(4)	(4)	(0,01)
	01.2021	\$ 956	£ 715	21	0	21	0,03
SCX	01.2021	112	84	3	0	3	0,01
SSB	01.2021	1.015	760	25	0	25	0,04
				\$ 55	\$ (4)	\$ 51	0,07

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (281) (0,40)

Summe Anlagen

\$ 102.271 146,03

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (32.239) (46,03)

Nettovermögen

\$ 70.032 100,00

### 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) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 15.562 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 1.169 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 270 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	7	1.615	0	1.622
Summen	\$ 12.748	\$ 89.523	\$ 0	\$ 102.271

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 11.619	\$ 83.120	\$ 38	\$ 94.777
Investmentfonds	5.051	0	0	5.051
Pensionsgeschäfte	0	584	0	584
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	52	1.509	0	1.561
<b>Summen</b>	<b>\$ 16.722</b>	<b>\$ 85.213</b>	<b>\$ 38</b>	<b>\$ 101.973</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
GRE	0,170 %	23.11.2020	04.01.2021	\$ (2.034)	\$ (2.035)	(2,91)
	0,180	28.10.2020	27.01.2021	(10.715)	(10.718)	(15,30)
	0,180	10.11.2020	27.01.2021	(2.606)	(2.607)	(3,72)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (15.360)</b>	<b>(21,93)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (266)	\$ 270	\$ 4
BPS	(2)	0	(2)
BRC	38	0	38
CBK	33	0	33
FAR	(13)	0	(13)
GLM	(22)	0	(22)
GST	30	0	30
HUS	(203)	0	(203)
JPM	(150)	0	(150)
MYC	(2)	0	(2)
MYI	(177)	(60)	(237)
SCX	97	0	97
SOG	219	0	219
SSB	26	0	26
TOR	121	0	121
UAG	(57)	0	(57)
UBS	47	0	47

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,81	82,96
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	43,93	52,40
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,73	k. A.
Investmentfonds	8,42	7,22
Pensionsgeschäfte	0,82	0,83
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,08
Zentral abgerechnete Finanzderivate	2,71	2,19
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,40)	(0,04)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(21,93)	(24,36)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	6,22	8,43
US-Regierungsbehörden	24,57	21,39
US-Schatzobligationen	33,43	35,43
Non-Agency-MBS	4,03	4,82
Forderungsbesicherte Wertpapiere	5,75	6,96
Staatsemissionen	44,72	40,08
Stammaktien	4,36	5,98
Vorzugswertpapiere	1,27	1,16

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Real Estate Investment Trusts	10,12	11,06
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,05
Investmentfonds	8,42	7,22
Pensionsgeschäfte	0,82	0,83
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	0,08
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,02	0,00
Optionen auf Indizes	k. A.	0,01
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	(0,01)
Optionen auf Indizes	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 Kreditindizes – Schutzkauf	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,14	0,11
Zinsswaps	2,57	2,08
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	0,10	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Inflation-Capped Options	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,08)	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,03	0,02
Zinsswaps	(0,04)	(0,03)
Total Return Swaps auf Indizes	0,75	0,04
Total Return Swaps auf Wertpapiere	(0,72)	0,17
Devisenterminkontrakte	(0,69)	(0,46)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,27	0,25
Sonstige Aktiva und Passiva	(46,03)	(45,64)
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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
Allstate Corp. 0,750 % fällig am 15.12.2025	\$ 2.900	\$ 2.917	0,25	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,968 % fällig am 02.03.2023	8.400	8.458	0,71	Charter Communications Operating LLC 4,464 % fällig am 23.07.2022	\$ 4.300	4.534	0,38
American Tower Corp. 3,000 % fällig am 15.06.2023	3.560	3.773	0,32	Mizuho Financial Group, Inc. 0,849 % fällig am 08.09.2024	3.600	3.623	0,31	Chevron Corp. 1,554 % fällig am 11.05.2025	2.700	2.810	0,24
Aviation Capital Group LLC 0,884 % fällig am 30.07.2021	2.100	2.081	0,18	1,015 % fällig am 05.03.2023	500	504	0,04	CommonSpirit Health 1,547 % fällig am 01.10.2025	2.900	2.982	0,25
1,175 % fällig am 01.06.2021	3.100	3.081	0,26	1,211 % fällig am 10.07.2024	3.100	3.134	0,26	CRH America, Inc. 3,875 % fällig am 18.05.2025	2.700	3.035	0,26
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,875 % fällig am 18.09.2023	2.400	2.418	0,20	1,480 % fällig am 19.07.2023	AUD 4.800	3.748	0,32	Daimler Finance North America LLC 1,093 % fällig am 22.02.2022	3.000	3.022	0,26
Bank of America Corp. 0,810 % fällig am 24.10.2024	2.900	2.928	0,25	Morgan Stanley 0,864 % fällig am 21.10.2025	\$ 2.000	2.018	0,17	2,550 % fällig am 15.08.2022	3.500	3.621	0,31
1,486 % fällig am 19.05.2024	2.400	2.458	0,21	NatWest Markets PLC 0,359 % fällig am 27.09.2021	€ 2.300	2.829	0,24	Danone S.A. 2,947 % fällig am 02.11.2026	2.400	2.640	0,22
2,881 % fällig am 24.04.2023	2.900	2.993	0,25	Nissan Motor Acceptance Corp. 0,869 % fällig am 21.09.2021	\$ 2.600	2.594	0,22	Dell International LLC 5,450 % fällig am 15.06.2023	400	443	0,04
Barclays PLC 1,651 % fällig am 15.02.2023	3.500	3.526	0,30	2,650 % fällig am 13.07.2022	500	512	0,04	Equifax, Inc. 1,091 % fällig am 15.08.2021	4.700	4.715	0,40
4,610 % fällig am 15.02.2023	4.500	4.698	0,40	2,800 % fällig am 13.01.2022	2.300	2.340	0,20	Expedia Group, Inc. 3,600 % fällig am 15.12.2023	2.100	2.240	0,19
BBVA USA 0,951 % fällig am 11.06.2021	2.900	2.907	0,25	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 0,672 % fällig am 17.05.2021	2.200	2.202	0,19	GATX Corp. 0,945 % fällig am 05.11.2021	3.700	3.709	0,31
Brixmor Operating Partnership LP 1,264 % fällig am 01.02.2022	3.500	3.497	0,30	Santander Holdings USA, Inc. 3,450 % fällig am 02.06.2025	2.700	2.952	0,25	General Mills, Inc. 6,410 % fällig am 15.10.2022	3.000	3.311	0,28
CC Holdings GS LLC 3,849 % fällig am 15.04.2023	3.400	3.650	0,31	SMBC Trust Account 1,430 % fällig am 09.04.2021	5.000	4.999	0,42	Hewlett Packard Enterprise Co. 0,958 % fällig am 05.10.2021	3.000	3.000	0,25
Citigroup, Inc. 0,776 % fällig am 30.10.2024	2.300	2.316	0,20	Standard Chartered PLC 1,319 % fällig am 14.10.2023	3.500	3.539	0,30	Hyatt Hotels Corp. 3,225 % fällig am 01.09.2022	2.000	2.023	0,17
0,907 % fällig am 27.10.2022	5.400	5.441	0,46	1,368 % fällig am 20.01.2023	3.200	3.221	0,27	Hyundai Capital America 1,150 % fällig am 10.11.2022	3.500	3.504	0,30
Cooperative Rabobank UA 1,004 % fällig am 24.09.2026	3.700	3.730	0,31	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,474 % fällig am 08.07.2025	3.200	3.281	0,28	Imperial Brands Finance PLC 3,750 % fällig am 21.07.2022	2.300	2.399	0,20
Credit Agricole S.A. 1,235 % fällig am 24.04.2023	4.450	4.503	0,38	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,800 % fällig am 12.09.2023	3.100	3.130	0,26	Leidos, Inc. 2,950 % fällig am 15.05.2023	1.100	1.160	0,10
Credit Suisse Group AG 4,550 % fällig am 17.04.2026	2.400	2.826	0,24	Synchrony Bank 3,650 % fällig am 24.05.2021	2.900	2.929	0,25	Microchip Technology, Inc. 3,922 % fällig am 01.06.2021	1.700	1.724	0,15
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,800 % fällig am 15.09.2022	500	528	0,04	U.S. Bancorp 1,450 % fällig am 12.05.2025	2.700	2.805	0,24	Nissan Motor Co. Ltd. 3,043 % fällig am 15.09.2023	3.600	3.767	0,32
Danske Bank A/S 5,000 % fällig am 12.01.2022	3.000	3.133	0,26	UBS Group AG 1,171 % fällig am 15.08.2023	3.000	3.030	0,26	NXP BV 4,875 % fällig am 01.03.2024	2.700	3.047	0,26
Deutsche Bank AG 1,000 % fällig am 19.11.2025	€ 3.000	3.731	0,31	2,859 % fällig am 15.08.2023	2.900	3.008	0,25	Pan American Energy LLC 38,606 % fällig am 26.02.2021	ARS 51	0	0,00
1,031 % fällig am 22.01.2021	\$ 1.900	1.900	0,16	3,491 % fällig am 23.05.2023	2.900	3.019	0,25	Panasonic Corp. 2,536 % fällig am 19.07.2022	\$ 2.500	2.571	0,22
3,150 % fällig am 22.01.2021	3.000	3.003	0,25	4,125 % fällig am 24.09.2025	2.400	2.751	0,23	Phillips 66 0,900 % fällig am 15.02.2024	2.900	2.908	0,25
3,300 % fällig am 16.11.2022	3.300	3.444	0,29	UniCredit SpA 4,129 % fällig am 14.01.2022	3.200	3.291	0,28	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 2,375 % fällig am 24.06.2022	500	514	0,04
4,250 % fällig am 14.10.2021	2.900	2.974	0,25	7,830 % fällig am 04.12.2023	5.350	6.352	0,54	Royalty Pharma PLC 0,750 % fällig am 02.09.2023	1.000	1.005	0,08
Equinix, Inc. 2,625 % fällig am 18.11.2024	3.400	3.638	0,31	Volkswagen Bank GmbH 0,955 % fällig am 01.08.2022	€ 2.600	3.234	0,27	Siemens Financieringsmaatschappij NV 3,125 % fällig am 16.03.2024	700	757	0,06
Equitable Holdings, Inc. 3,900 % fällig am 20.04.2023	2.800	3.013	0,25	Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	€ 2.400	3.315	0,28	Stryker Corp. 1,150 % fällig am 15.06.2025	2.800	2.859	0,24
Federal Realty Investment Trust 3,950 % fällig am 15.01.2024	2.400	2.613	0,22	1,625 % fällig am 30.11.2022	5.800	8.089	0,68	Suntory Holdings Ltd. 2,550 % fällig am 28.06.2022	4.090	4.205	0,35
Ford Credit Canada Co. 3,530 % fällig am 10.01.2022 (h)	CAD 1.800	1.421	0,12	Wells Fargo & Co. 1,654 % fällig am 02.06.2024	\$ 2.500	2.570	0,22	Sutter Health 1,321 % fällig am 15.08.2025	2.900	2.951	0,25
Ford Motor Credit Co. LLC 2,770 % fällig am 07.01.2021	\$ 3.700	3.700	0,31	2,125 % fällig am 20.12.2023	€ 900	1.286	0,11	Sysco Corp. 5,650 % fällig am 01.04.2025	2.700	3.213	0,27
3,200 % fällig am 15.01.2021	1.300	1.303	0,11			233.570	19,74	Thomson Reuters Corp. 4,300 % fällig am 23.11.2023	2.800	3.071	0,26
3,810 % fällig am 09.01.2024	1.000	1.026	0,09	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				VMware, Inc. 2,950 % fällig am 21.08.2022	3.500	3.632	0,31
5,085 % fällig am 07.01.2021	2.400	2.406	0,20	AbbVie, Inc. 2,150 % fällig am 19.11.2021	\$ 4.300	4.370	0,37	Volkswagen Group of America Finance LLC 2,900 % fällig am 13.05.2022	1.500	1.548	0,13
5,596 % fällig am 07.01.2022	2.200	2.280	0,19	2,300 % fällig am 21.11.2022	4.400	4.562	0,39	3,125 % fällig am 12.05.2023	1.500	1.585	0,13
5,750 % fällig am 01.02.2021	900	904	0,08	Anthem, Inc. 2,375 % fällig am 15.01.2025	2.700	2.889	0,24	Walt Disney Co. 1,750 % fällig am 13.01.2026	2.000	2.098	0,18
General Motors Financial Co., Inc. 1,285 % fällig am 17.11.2023	2.900	2.907	0,25	3,350 % fällig am 01.12.2024	1.000	1.102	0,09	WRKCo, Inc. 3,750 % fällig am 15.03.2025	2.700	3.012	0,25
3,550 % fällig am 08.07.2022	2.800	2.921	0,25	Astrazeneca PLC 3,500 % fällig am 17.08.2023	2.200	2.372	0,20			143.694	12,14
5,200 % fällig am 20.03.2023	2.400	2.633	0,22	Bayer U.S. Finance LLC 0,881 % fällig am 25.06.2021	3.100	3.106	0,26				
Goldman Sachs Group, Inc. 0,963 % fällig am 23.02.2023	1.000	1.010	0,08	BMW Finance NV 2,250 % fällig am 12.08.2022	3.400	3.508	0,30				
1,325 % fällig am 26.04.2022	2.100	2.106	0,18	BMW U.S. Capital LLC 3,450 % fällig am 12.04.2023	2.400	2.559	0,22				
ING Groep NV 1,238 % fällig am 02.10.2023	3.000	3.047	0,26	Boeing Co. 1,950 % fällig am 01.02.2024	3.500	3.607	0,30				
JPMorgan Chase & Co. 1,514 % fällig am 01.06.2024	2.800	2.876	0,24	Bristol-Myers Squibb Co. 3,200 % fällig am 15.06.2026	2.500	2.815	0,24				
Lloyds Banking Group PLC 2,858 % fällig am 17.03.2023	3.300	3.393	0,29	Broadcom, Inc. 2,250 % fällig am 15.11.2023	2.900	3.031	0,26				
Logicor Financing SARL 1,500 % fällig am 14.11.2022	€ 4.800	6.019	0,51	3,459 % fällig am 15.09.2026	504	560	0,05				
Marsh & McLennan Cos., Inc. 3,500 % fällig am 03.06.2024	\$ 3.100	3.384	0,29	4,250 % fällig am 15.04.2026	2.400	2.751	0,23				
Metropolitan Life Global Funding 0,950 % fällig am 02.07.2025	\$ 3.700	3.751	0,32	Central Nippon Expressway Co. Ltd. 0,681 % fällig am 15.02.2022	\$ 7.000	7.009	0,59				
				Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 4.700	5.838	0,49				



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		
RAAC Trust				Peru Government International Bond				0,122 % fällig am					
0,628 % fällig am 25.03.2037	\$ 60	\$ 61	0,01	8,200 % fällig am 12.08.2026	17.000	\$ 6.383	0,54	22.04.2021 (d)(e)(i)	\$ 4.200	\$ 4.199	0,35		
SLC Student Loan Trust				Saudi Government International Bond				0,137 % fällig am					
0,317 % fällig am 15.09.2026	268	268	0,02	2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 2.300	2.337	0,20	21.01.2021 (d)(e)	4.000	4.000	0,34		
0,327 % fällig am 15.03.2027	1.162	1.155	0,10			15.359	1,30			141.174	11,93		
SLM Student Loan Trust				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				Summe kurzfristige Instrumente		239.398	20,23		
0,305 % fällig am 26.01.2026	1.269	1.269	0,11	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.204.487	101,78			
0,365 % fällig am 25.10.2029	2.237	2.218	0,19	Pacific Gas & Electric Co.	2.900	2.902	0,25						
South Carolina Student Loan Corp.				1,600 % fällig am 15.11.2021				<b>AKTIEN</b>					
1,225 % fällig am 03.09.2024	320	321	0,03					<b>INVESTMENTFONDS</b>					
Structured Asset Investment Loan Trust				<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>					
1,123 % fällig am 25.10.2033	205	205	0,02	(0,087) % fällig am				PIMCO Funds: Global Investors					
TICP CLO Ltd.				22.03.2021 (d)(e)	¥ 4.950.000	47.954	4,05	Series plc - US Short-Term Fund (f)					
1,058 % fällig am 20.04.2028	2.494	2.484	0,21	(0,085) % fällig am	4.890.000	47.368	4,00	3.128.205	31.908	2,70			
Trestles CLO Ltd.				08.02.2021 (d)(e)		95.322	8,05	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)					
1,505 % fällig am 25.07.2029	3.600	3.605	0,30	<b>U.S. TREASURY BILLS</b>				3.544.089	35.306	2,98			
Venture CLO Ltd.				0,086 % fällig am	\$ 8.700	8.699	0,73	67.214				5,68	
1,024 % fällig am 28.02.2026	2.069	2.064	0,17	25.02.2021 (d)(e)				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>					
Voya CLO Ltd.				0,091 % fällig am	11.900	11.898	1,01	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)					
0,935 % fällig am 25.07.2026	868	869	0,07	01.04.2021 (d)(e)				484.660	49.283	4,16			
WhiteHorse Ltd.				0,091 % fällig am	8.000	7.998	0,68	Summe Investmentfonds				\$ 116.497	9,84
1,148 % fällig am 17.04.2027	1.229	1.229	0,10	25.05.2021 (d)(e)	70.700	70.681	5,97						
Zais CLO Ltd.				0,101 % fällig am	31.800	31.799	2,69						
1,387 % fällig am 15.04.2028	2.766	2.757	0,23	28.01.2021 (d)(e)	1.900	1.900	0,16						
		62.647	5,29	0,106 % fällig am									
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				21.01.2021 (d)(e)									
Agence Francaise de Developpement	6.600	6.639	0,56										
2,750 % fällig am 22.03.2021													

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettover-mögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 2.675	U.S. Treasury Bills				
					0,000 % fällig am	\$ (2.729)	\$ 2.675	\$ 2.675	0,23
					30.12.2021				
RDR	0,070	31.12.2020	04.01.2021	5.600	U.S. Treasury Notes	(5.719)	5.600	5.600	0,47
					1,750 % fällig am				
					31.05.2022				
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (8.448)</b>	<b>\$ 8.275</b>	<b>\$ 8.275</b>	<b>0,70</b>

(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 March Futures	Long	03.2021	22	\$ (1)	0,00
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	36	0	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2021	1.155	242	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	2.104	507	0,04
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	447	(32)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	240	120	0,01
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	128	(241)	(0,02)
				\$ 595	0,05
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ 595</b>	<b>0,05</b>

**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<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 19.600	\$ 75	0,01

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Average Duration Fund (Forts.)

### ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,850 %	03.01.2022	BRL 35.100	\$ (1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,859	03.01.2022	28.000	(2)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,870	03.01.2022	8.500	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,871	03.01.2022	13.000	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,883	03.01.2022	12.000	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,360	03.01.2022	581.600	736	0,06
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR		0,100	20.03.2024	¥ 6.090.000	158	0,01
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR		0,300	18.03.2026	4.220.000	(510)	(0,04)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR		0,380	18.06.2028	90.000	14	0,00
						\$ 392	0,03
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 467</b>	<b>0,04</b>

(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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
MYC	Barclays Bank PLC	1,000 %	20.12.2021	€ 2.500	\$ 18	\$ 6	\$ 24	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	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	01.2021	AUD 5.175	\$ 3.821	\$ 0	\$ (172)	\$ (172)	(0,01)
	02.2021	€ 1.184	1.412	0	(38)	(38)	0,00
	02.2021	£ 48.393	63.828	0	(2.343)	(2.343)	(0,20)
BPS	02.2021	\$ 1.207	1.012	32	0	32	0,00
	01.2021	CAD 3.330	\$ 2.568	0	(45)	(45)	0,00
BRC	03.2021	¥ 1.068.002	10.288	0	(65)	(65)	(0,01)
CBK	02.2021	€ 2.992	3.561	0	(104)	(104)	(0,01)
	02.2021	\$ 665	€ 558	19	0	19	0,00
DUB	02.2021	£ 1.026	753	4	0	4	0,00
	03.2021	PEN 22.466	\$ 6.270	59	0	59	0,00
HUS	01.2021	\$ 1.067	AUD 1.444	47	0	47	0,00
	02.2021	£ 4.339	\$ 5.750	0	(183)	(183)	(0,02)
	02.2021	¥ 119.139	1.135	0	(19)	(19)	0,00
JPM	03.2021	3.881.998	37.389	0	(243)	(243)	(0,02)
	01.2021	AUD 3.912	2.878	0	(140)	(140)	(0,01)
MYI	01.2021	\$ 1.153	CAD 1.474	4	0	4	0,00
	01.2021	€ 63	\$ 78	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 13	€ 10	0	0	0	0,00
	01.2021	£ 33	€ 25	0	0	0	0,00
SCX	02.2021	¥ 4.890.000	\$ 46.876	0	(507)	(507)	(0,04)
	01.2021	AUD 2.284	1.683	0	(80)	(80)	(0,01)
UAG	02.2021	£ 1.587	2.114	0	(56)	(56)	0,00
	01.2021	AUD 7.686	5.651	0	(280)	(280)	(0,02)
UAG	01.2021	MXN 1.089	54	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	€ 26.904	31.860	0	(1.093)	(1.093)	(0,09)
				\$ 165	\$ (5.369)	\$ (5.204)	(0,44)

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend 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	01.2021	€ 31	\$ 38	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2021	4.316	5.285	5	(1)	4	0,00
	01.2021	\$ 26.783	€ 22.357	571	0	571	0,05
	02.2021	1.297	1.059	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	€ 278	\$ 333	0	(6)	(6)	0,00
	01.2021	\$ 546	€ 451	6	0	6	0,00
HUS	01.2021	€ 765	\$ 930	1	(6)	(5)	0,00
	01.2021	\$ 176	€ 145	1	0	1	0,00
JPM	01.2021	€ 15	\$ 18	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	\$ 258	€ 211	1	0	1	0,00
SCX	01.2021	28.417	23.728	615	0	615	0,05
	02.2021	40.929	33.428	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	26.793	22.372	579	0	579	0,05
	02.2021	40.929	33.428	0	0	0	0,00
				\$ 1.779	\$ (13)	\$ 1.766	0,15

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 83	£ 62	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BRC	01.2021	£ 22	\$ 30	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2021	150	202	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	\$ 7.801	£ 5.836	177	0	177	0,01
HUS	01.2021	£ 634	\$ 848	0	(20)	(20)	0,00
	01.2021	\$ 8.180	£ 6.116	180	0	180	0,02
MYI	01.2021	£ 37	\$ 50	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2021	64	86	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 63	£ 47	2	0	2	0,00
SSB	01.2021	8.571	6.421	206	0	206	0,02
				\$ 567	\$ (27)	\$ 540	0,05
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (2.874)	(0,24)

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Ginnie Mae, TBA			
4,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 200	(213)	(0,02)
5,000 % fällig am 01.01.2051	17.000	(18.561)	(1,57)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,500 % fällig am 01.02.2051	52.400	(55.149)	(4,66)
3,500 % fällig am 01.01.2051 (g)	19.600	(20.720)	(1,75)
3,500 % fällig am 01.02.2051	32.500	(34.403)	(2,91)
4,000 % fällig am 01.01.2051 (g)	72.145	(77.054)	(6,51)
4,000 % fällig am 01.02.2051	28.145	(30.103)	(2,54)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (236.203)	(19,96)
Summe Anlagen		\$ 1.091.244	92,21
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 92.169	7,79
Nettovermögen		\$ 1.183.413	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) Zum 31. Dezember 2020 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Average Duration Fund (Forts.)

### (h) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Ford Credit Canada Co.	3,530 %	10.01.2022	20.10.2020 - 29.10.2020	\$ 1.358	\$ 1.421	0,12

(i) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtwert von USD 4.200 und Barmittel in Höhe von USD 2 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 5.828 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	595	(2.407)	0	(1.812)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(236.203)	0	(236.203)
<b>Summen</b>	<b>\$ 67.809</b>	<b>\$ 1.017.608</b>	<b>\$ 5.827</b>	<b>\$ 1.091.244</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 1.199.063	\$ 0	\$ 1.199.063
Investmentfonds	116.884	0	0	116.884
Pensionsgeschäfte	0	52.556	0	52.556
Einlagen bei Kreditinstituten	0	3.307	0	3.307
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(1.431)	897	0	(534)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(156.316)	0	(156.316)
<b>Summen</b>	<b>\$ 115.453</b>	<b>\$ 1.099.507</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 1.214.960</b>

(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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (2.521)	\$ 2.207	\$ (314)
BPS	532	(560)	(28)
BRC	(66)	0	(66)
CBK	92	0	92
DUB	59	(110)	(51)
HUS	(242)	188	(54)
JPM	(136)	0	(136)
MYC	24	0	24
MYI	(507)	423	(84)
SCX	480	(640)	(160)
SSB	206	0	206
TOR	579	(640)	(61)
UAG	(1.374)	1.384	10

(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	33,42	28,84
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	67,18	71,92
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,18	k. A.
Investmentfonds	9,84	9,83
Pensionsgeschäfte	0,70	4,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,05	(0,12)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,04	0,03
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,24)	0,04
Leerverkaufte Wertpapiere	(19,96)	(13,14)
Einlagenzertifikate	k. A.	0,28
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(13,12)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	34,34	33,12
Kommunalanleihen und Wechsel	0,09	k. A.
US-Regierungsbehörden	29,12	31,21
US-Schatzobligationen	4,03	18,54
Non-Agency-MBS	7,38	6,19
Forderungsbesicherte Wertpapiere	5,29	6,42
Staatsemissionen	1,30	5,28
Kurzfristige Instrumente	20,23	0,00
Investmentfonds	9,84	9,83
Pensionsgeschäfte	0,70	4,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,05	(0,12)
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,01	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,03	0,03
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,44)	(0,37)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,20	0,41
Leerverkaufte Wertpapiere	(19,96)	(13,14)
Einlagenzertifikate	k. A.	0,28
Sonstige Aktiva und Passiva	7,79	(2,10)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit 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		
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>													
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>													
Caesars Resort Collection LLC 4,647 % fällig am 21.07.2025	\$	100	\$	100	0,02	Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022 (f)	\$	293	\$	326	0,05		
Dell International LLC 2,750 % fällig am 19.09.2025	161	161	0,03	10,179 % fällig am 12.06.2021	1.000	1.040	0,16	Flagstar Bancorp. Inc. 6,125 % fällig am 15.07.2021	\$	600	\$	613	0,10
Delos Finance SARL 2,004 % fällig am 06.10.2023	420	420	0,07	Barclays PLC 1,601 % fällig am 16.05.2024	709	719	0,11	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 01.12.2021	€	200	243	0,04	
FinCo LLC 2,647 % fällig am 27.06.2025	200	200	0,03	3,200 % fällig am 10.08.2021	2.600	2.643	0,42	1,048 % fällig am 05.04.2021	\$	2.200	2.191	0,35	
HCA, Inc. 1,897 % fällig am 13.03.2025	117	117	0,02	4,610 % fällig am 15.02.2023	200	209	0,03	1,456 % fällig am 15.02.2023	€	800	772	0,12	
Intelsat Jackson Holdings S.A. 3,600 % - 6,500 % fällig am 13.07.2022	22	22	0,00	BBVA Bancomer S.A. 4,375 % fällig am 10.04.2024	200	218	0,03	1,514 % fällig am 17.02.2023	€	500	612	0,10	
Jefferies Finance LLC 4,500 % fällig am 30.09.2027	698	700	0,11	6,500 % fällig am 10.03.2021	842	852	0,13	3,021 % fällig am 06.03.2024	€	400	508	0,08	
Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 3,398 % fällig am 30.06.2025	91	90	0,01	6,750 % fällig am 30.09.2022	1.750	1.894	0,30	3,550 % fällig am 07.10.2022	\$	1.500	1.533	0,24	
RPI Intermediate Finance Trust 1,897 % fällig am 11.02.2027	22	22	0,00	BGC Partners, Inc. 5,125 % fällig am 27.05.2021	1.100	1.113	0,18	5,750 % fällig am 01.02.2021	€	1.000	1.004	0,16	
Univision Communications, Inc. 3,750 % fällig am 15.03.2024	616	613	0,10	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 1,400 % fällig am 06.07.2022	€	600	0,12	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 6,500 % fällig am 01.10.2025	€	52	52	0,01	
		2.445	0,39	BNP Paribas S.A. 2,219 % fällig am 09.06.2026	\$	1.500	1,571	0,25	6,750 % fällig am 15.03.2022	€	3.500	3.887	0,61
				2,950 % fällig am 23.05.2022	2.000	2.072	0,33	GE Capital International Funding Co. Unlimited Co. 3,373 % fällig am 15.11.2025	\$	3.500	3.887	0,61	
				3,800 % fällig am 10.01.2024	500	545	0,09	General Motors Financial Co., Inc. 1,550 % fällig am 30.06.2022	€	100	101	0,02	
				BOC Aviation Ltd. 2,375 % fällig am 15.09.2021	1.800	1.811	0,29	5,100 % fällig am 17.01.2024	€	300	336	0,05	
				2,750 % fällig am 18.09.2022	800	817	0,13	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,875 % fällig am 20.06.2022	€	600	757	0,12	
				3,500 % fällig am 10.10.2024	1.000	1.062	0,17	2,950 % fällig am 29.07.2026	€	600	773	0,12	
				BPCE S.A. 1,652 % fällig am 06.10.2026	300	307	0,05	Goldman Sachs Group, Inc. 0,488 % fällig am 27.07.2021	€	600	738	0,12	
				Brixmor Operating Partnership LP 1,264 % fällig am 01.02.2022	1.700	1.698	0,27	3,375 % fällig am 27.03.2025	\$	3.100	4.323	0,68	
				CaixaBank S.A. 2,375 % fällig am 01.02.2024	€	100	131	0,02	Greenland Global Investment Ltd. 6,250 % fällig am 16.12.2022	\$	200	197	0,03
				Canadian Imperial Bank of Commerce 0,489 % fällig am 14.12.2023	\$	700	702	0,11	Groupe Bruxelles Lambert S.A. 1,875 % fällig am 19.06.2025	€	1.700	2.247	0,36
				Cantor Fitzgerald LP 6,500 % fällig am 17.06.2022	850	919	0,15	Grupo Aval Ltd. 4,750 % fällig am 26.09.2022	\$	700	734	0,12	
				Castellum AB 2,125 % fällig am 20.11.2023	€	1.300	1.683	0,27	Hammerson PLC 3,500 % fällig am 27.10.2025	€	200	270	0,04
				Cetin Finance BV 1,423 % fällig am 06.12.2021	1.200	1.488	0,24	Horse Gallop Finance Ltd. 3,250 % fällig am 30.05.2022	\$	500	513	0,08	
				China Construction Bank New Zealand Ltd. 0,989 % fällig am 20.12.2021	\$	300	0,05	HSBC Bank PLC 4,000 % fällig am 15.01.2021	€	2.200	2.697	0,43	
				CIFI Holdings Group Co. Ltd. 6,450 % fällig am 07.11.2024	300	324	0,05	HSBC Holdings PLC 3,950 % fällig am 18.05.2024	\$	3.000	3.237	0,51	
				Cooperatieve Rabobank UA 2,625 % fällig am 22.07.2024	€	700	749	0,12	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 1,000 % fällig am 20.07.2023	€	2.500	2.500	0,40
				3,875 % fällig am 25.07.2023	€	1.000	1.346	0,21	1,000 % fällig am 09.09.2023	€	500	500	0,08
				6,625 % fällig am 29.06.2021 (d)(f)	1.200	1.511	0,24	ING Groep NV 1,000 % fällig am 20.09.2023	€	2.000	2.528	0,40	
				Country Garden Holdings Co. Ltd. 3,125 % fällig am 22.10.2025	\$	1.300	1.318	0,21	International Lease Finance Corp. 8,625 % fällig am 15.01.2022	\$	200	215	0,03
				CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 12.05.2026	€	700	931	0,15	Intesa Sanpaolo SpA 3,125 % fällig am 14.07.2022	€	1.600	1.658	0,26
				4,750 % fällig am 08.03.2023	\$	1.000	1.073	0,17	3,375 % fällig am 12.01.2023	€	1.300	1.362	0,22
				Credit Agricole S.A. 0,500 % fällig am 24.06.2024	€	2.300	2.871	0,45	5,017 % fällig am 26.06.2024	€	800	876	0,14
				Credit Suisse AG 2,100 % fällig am 12.11.2021	\$	800	812	0,13	7,000 % fällig am 19.01.2021 (d)(f)	€	300	369	0,06
				3,000 % fällig am 29.10.2021	1.400	1.431	0,23	Itau Unibanco Holding S.A. 2,900 % fällig am 24.01.2023	\$	1.700	1.743	0,28	
				Credit Suisse Group AG 3,574 % fällig am 09.01.2023	500	515	0,08	JPMorgan Chase & Co. 2,776 % fällig am 25.04.2023	€	5.000	5.164	0,82	
				3,800 % fällig am 09.06.2023	400	431	0,07	Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % fällig am 30.06.2024	€	600	583	0,09	
				Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,800 % fällig am 15.09.2022	850	898	0,14	9,750 % fällig am 28.09.2023	€	800	816	0,13	
				CubeSmart LP 4,000 % fällig am 15.11.2025	900	1.015	0,16	11,500 % fällig am 30.01.2023	€	300	315	0,05	
				DAE Sukuk Dific Ltd. 3,750 % fällig am 15.02.2026	700	721	0,11	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,950 % fällig am 30.06.2022	€	1.400	1.941	0,31	
				Danske Bank A/S 1,280 % fällig am 12.09.2023	2.100	2.107	0,33	Kilroy Realty LP 3,450 % fällig am 15.12.2024	\$	800	868	0,14	
				3,001 % fällig am 20.09.2022	800	813	0,13	KSA Sukuk Ltd. 2,894 % fällig am 20.04.2022	€	500	516	0,08	
				Deutsche Bank AG 1,510 % fällig am 04.02.2021	500	500	0,08	KWG Group Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 10.08.2025	€	300	307	0,05	
				2,129 % fällig am 24.11.2026 (g)	500	512	0,08	LeasePlan Corp. NV 0,125 % fällig am 13.09.2023	€	800	982	0,16	
				3,150 % fällig am 22.01.2021	2.500	2.503	0,40	0,750 % fällig am 03.10.2022	€	500	620	0,10	
				3,300 % fällig am 16.11.2022	500	522	0,08	2,875 % fällig am 24.10.2024	\$	1.500	1.587	0,25	
				4,250 % fällig am 14.10.2021	2.600	2.667	0,42	Lloyds Banking Group PLC 3,500 % fällig am 01.04.2026	€	600	836	0,13	
				Digital Dutch Finco BV 0,125 % fällig am 15.10.2022	€	1.000	1.229	0,19	4,050 % fällig am 16.08.2023	\$	1.000	1.093	0,17
				First Abu Dhabi Bank PJSC 1,375 % fällig am 19.02.2023	€	1.000	1.384	0,22	Logicor Financing SARL 0,500 % fällig am 30.04.2021	€	900	1.103	0,17
					€	1.000	1.384	0,22	0,750 % fällig am 15.07.2024	€	1.200	1.499	0,24
								2,250 % fällig am 13.05.2025	€	600	795	0,13	

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
MassMutual Global Funding 0,480 % fällig am 28.08.2023	\$ 1.900	\$ 1.905	0,30	Santander UK Group Holdings PLC 1,532 % fällig am 21.08.2026 3,571 % fällig am 10.01.2023	\$ 1.200	\$ 1.219	0,19	Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023 1,875 % fällig am 07.09.2021	£ 2.200	\$ 3.038	0,48
Metropolitan Life Global Funding 0,375 % fällig am 09.04.2024 0,450 % fällig am 01.09.2023 0,900 % fällig am 08.06.2023 1,250 % fällig am 17.09.2021	\$ 2.100 € 300 1.500 € 1.400	2.617 301 1.519 1.734	0,41 0,05 0,24 0,27	Santander UK PLC 0,881 % fällig am 15.11.2021 3,750 % fällig am 15.11.2021	1.900 700	1.909 721	0,30 0,11	Washington Prime Group LP 6,450 % fällig am 15.08.2024	\$ 400	241	0,04
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 1,075 % fällig am 26.07.2023 2,623 % fällig am 18.07.2022	\$ 3.000 1.600	3.034 1.655	0,48 0,26	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,125 % fällig am 29.10.2022 5,250 % fällig am 23.05.2023 (f) 5,717 % fällig am 16.06.2021 6,125 % fällig am 07.02.2022	500 500 600 2.500	527 536 614 2.635	0,08 0,08 0,10 0,42	Wells Fargo & Co. 2,625 % fällig am 22.07.2022	2.500	2.589	0,41
Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd. 2,250 % fällig am 07.09.2021 3,406 % fällig am 28.02.2022	1.500 2.300	1.517 2.366	0,24 0,37	Scentre Group Trust 1,375 % fällig am 22.03.2023	€ 200	251	0,04	Wells Fargo Bank N.A. 2,897 % fällig am 27.05.2022 3,550 % fällig am 14.08.2023 3,625 % fällig am 22.10.2021	1.100 1.400 700	1.111 1.513 717	0,18 0,24 0,11
Mizuho Financial Group, Inc. 0,837 % fällig am 25.05.2024 1,020 % fällig am 11.10.2023 1,101 % fällig am 11.09.2022	1.900 € 400 \$ 2.700	1.904 504 2.731	0,30 0,08 0,43	Seazen Group Ltd. 7,500 % fällig am 22.01.2021	\$ 1.100	1.103	0,17	Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 17.02.2025	300	308	0,05
Morgan Stanley 0,637 % fällig am 26.07.2024	€ 2.800	3.489	0,55	Shinhan Bank Co. Ltd. 0,250 % fällig am 16.10.2024 1,183 % fällig am 29.09.2025	€ 1.100 AUD 800	1.367 624	0,22 0,10	Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,875 % fällig am 23.01.2022	300	305	0,05
MUFG Bank Ltd. 3,200 % fällig am 26.02.2023	\$ 1.450	1.536	0,24	Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,950 % fällig am 24.10.2022	\$ 900	921	0,15	<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
MUFG Union Bank N.A. 0,798 % fällig am 09.12.2022 2,100 % fällig am 09.12.2022	900 1.000	906 1.032	0,14 0,16	SL Green Realty Corp. 4,500 % fällig am 01.12.2022	2.900	3.052	0,48	21Vianet Group, Inc. 7,875 % fällig am 15.10.2021	300	307	0,05
Multibank, Inc. 4,375 % fällig am 09.11.2022	200	207	0,03	SLM Corp. 5,125 % fällig am 05.04.2022	700	718	0,11	AA Bond Co. Ltd. 2,750 % fällig am 31.07.2043	€ 900	1.213	0,19
Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023	800	817	0,13	SMBC Aviation Capital Finance DAC 2,650 % fällig am 15.07.2021 3,550 % fällig am 15.04.2024 4,125 % fällig am 15.07.2023	1.400 3.330 800	1.415 3.541 855	0,22 0,56 0,14	AbbVie, Inc. 3,250 % fällig am 01.10.2022	\$ 400	417	0,07
Nationale-Nederlanden Bank NV 0,375 % fällig am 31.05.2023	€ 300	372	0,06	Standard Chartered PLC 1,319 % fällig am 14.10.2023 1,335 % fällig am 14.10.2023 1,430 % fällig am 10.09.2022 4,247 % fällig am 20.01.2023	2.400 200 200 1.000 600	2.424 202 201 1.004 622	0,38 0,03 0,03 0,16 0,10	ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. 1,375 % fällig am 17.06.2025	€ 300	377	0,06
Nationwide Building Society 1,000 % fällig am 28.08.2025 3,622 % fällig am 26.04.2023 3,766 % fällig am 08.03.2024	\$ 2.700 700 800	2.715 727 852	0,43 0,12 0,13	Societe Generale S.A. 1,488 % fällig am 14.12.2026	2.400	2.424	0,38	Aeropiort di Roma SpA 5,441 % fällig am 20.02.2023	€ 400	588	0,09
Natwest Group PLC 1,691 % fällig am 15.05.2023 2,000 % fällig am 08.03.2023 2,359 % fällig am 22.05.2024 6,000 % fällig am 19.12.2023	1.800 € 500 \$ 3.000 800	1.820 627 3.123 915	0,29 0,10 0,49 0,14	Standard Chartered PLC 1,319 % fällig am 14.10.2023 1,335 % fällig am 14.10.2023 1,430 % fällig am 10.09.2022 4,247 % fällig am 20.01.2023	200 200 1.000 600	202 201 1.004 622	0,03 0,03 0,16 0,10	Air Canada Pass-Through Trust 3,750 % fällig am 15.06.2029 5,375 % fällig am 15.11.2022	\$ 783 693	778 695	0,12 0,11
NatWest Markets PLC 1,000 % fällig am 28.05.2024	€ 1.300	1.646	0,26	Stearns Holdings LLC 9,375 % fällig am 15.08.2020	602	0	0,00	ALROSA Finance S.A. 4,650 % fällig am 09.04.2024	400	433	0,07
NE Property BV 2,625 % fällig am 22.05.2023	300	382	0,06	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,010 % fällig am 10.09.2025	€ 5.000	6.188	0,98	Altice Financiering S.A. 2,250 % fällig am 15.01.2025	€ 1.200	1.422	0,22
New Metro Global Ltd. 6,500 % fällig am 23.04.2021 7,500 % fällig am 16.12.2021	\$ 200 800	202 824	0,03 0,13	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 0,465 % fällig am 30.05.2024	100	125	0,02	AP Moller - Maersk A/S 3,750 % fällig am 22.09.2024	\$ 1.450	1.572	0,25
Nissan Motor Acceptance Corp. 2,800 % fällig am 13.01.2022	500	509	0,08	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,800 % fällig am 12.09.2023	\$ 700	707	0,11	Arrow Electronics, Inc. 3,500 % fällig am 01.04.2022	1.580	1.626	0,26
Nomura Holdings, Inc. 1,851 % fällig am 16.07.2025 2,648 % fällig am 16.01.2025	200 1.000	208 1.069	0,03 0,17	Sunac China Holdings Ltd. 6,500 % fällig am 09.07.2023 6,500 % fällig am 10.01.2025 6,650 % fällig am 03.08.2024 7,000 % fällig am 09.07.2025	300 400 600 200	311 414 626 209	0,05 0,07 0,10 0,03	Asahi Group Holdings Ltd. 0,155 % fällig am 23.10.2024	€ 500	616	0,10
NTT Finance Corp. 1,900 % fällig am 21.07.2021	900	907	0,14	Svenska Handelsbanken AB 0,625 % fällig am 30.06.2023	1.500	1.511	0,24	Baidu, Inc. 3,875 % fällig am 29.09.2023	700	756	0,12
Nykredit Realkredit A/S 0,750 % fällig am 14.07.2021	€ 1.100	1.352	0,21	Synchrony Financial 4,375 % fällig am 19.03.2024	600	661	0,10	BAT Capital Corp. 1,125 % fällig am 16.11.2023	€ 300	378	0,06
Park Aerospace Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 15.08.2022	\$ 2.200	2.310	0,37	Times China Holdings Ltd. 7,625 % fällig am 21.02.2022	200	203	0,03	BAT International Finance PLC 1,750 % fällig am 05.07.2021	€ 500	688	0,11
PNC Bank N.A. 2,028 % fällig am 09.12.2022	700	711	0,11	Toronto-Dominion Bank 0,566 % fällig am 27.01.2023	800	803	0,13	Bayer AG 0,375 % fällig am 06.07.2024	€ 1.500	1.862	0,29
Powerlong Real Estate Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 30.04.2025 6,250 % fällig am 10.08.2024	1.000 300	1.017 314	0,16 0,05	TP ICAP PLC 5,250 % fällig am 26.01.2024	£ 1.750	2.625	0,42	Bayer U.S. Finance LLC 1,227 % fällig am 15.12.2023	\$ 687	694	0,11
Protective Life Global Funding 1,170 % fällig am 15.07.2025 1,999 % fällig am 14.09.2021	1.000 800	1.017 810	0,16 0,13	UBS AG 7,625 % fällig am 17.08.2022 (f)	\$ 2.900	3.211	0,51	Becton Dickinson and Co. 1,000 % fällig am 15.12.2022	€ 1.000	1.246	0,20
QNB Finance Ltd. 1,310 % fällig am 12.02.2022 3,500 % fällig am 28.03.2024	1.300 1.100	1.305 1.182	0,21 0,19	UBS Group AG 2,859 % fällig am 15.08.2023 6,875 % fällig am 22.03.2021 (d)(f)	300 700	311 708	0,05 0,11	BlueScope Finance Americas LLC 4,625 % fällig am 25.05.2023	\$ 700	747	0,12
Radian Group, Inc. 6,625 % fällig am 15.03.2025	200	227	0,04	UniCredit SpA 6,750 % fällig am 10.09.2021 (d)(f)	€ 1.000	1.249	0,20	Boeing Co. 2,300 % fällig am 01.08.2021	600	606	0,10
Reliance Standard Life Global Funding 2,150 % fällig am 21.01.2023 2,625 % fällig am 22.07.2022 3,050 % fällig am 20.01.2021	500 1.400 200	513 1.440 200	0,08 0,23 0,03	Unum Group 4,500 % fällig am 15.03.2025	900	1.020	0,16	British Airways Pass-Through Trust 3,350 % fällig am 15.12.2030	2.284	2.172	0,34
Santander Holdings USA, Inc. 3,450 % fällig am 02.06.2025	900	984	0,16	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 4,150 % fällig am 18.04.2023 4,200 % fällig am 07.06.2024	1.900 900	2.005 969	0,32 0,15	Broadcom, Inc. 3,459 % fällig am 15.09.2026	521	579	0,09
				Volkswagen Bank GmbH 0,000 % fällig am 15.06.2021 1,250 % fällig am 10.06.2024	€ 2.200 600	2.695 761	0,43 0,12	Caesars Resort Collection LLC 5,750 % fällig am 01.07.2025	500	530	0,08
				Volkswagen Financial Services AG 0,287 % fällig am 15.02.2021 0,625 % fällig am 01.04.2022	1.100 1.200	1.347 1.482	0,21 0,23	Cellnex Telecom S.A. 2,375 % fällig am 16.01.2024	€ 200	258	0,04
								Central Japan Railway Co. 2,200 % fällig am 02.10.2024	\$ 3.300	3.466	0,55
								Central Nippon Expressway Co. Ltd. 2,849 % fällig am 03.03.2022	700	718	0,11
										280.060	44,28

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration 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
Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 1.100	\$ 1.366	0,22	Hyundai Capital America 1,150 % fällig am 10.11.2022	\$ 2.200	\$ 2.203	0,35	1,500 % fällig am 31.05.2024	€ 200	\$ 252	0,04
Charter Communications Operating LLC 4,464 % fällig am 23.07.2022	\$ 1.100	1.160	0,18	IHS Markit Ltd. 4,000 % fällig am 01.03.2026	1.200	1.378	0,22	2,375 % fällig am 25.11.2022	100	127	0,02
Cheniére Corpus Christi Holdings LLC 7,000 % fällig am 30.06.2024	2.065	2.413	0,38	5,000 % fällig am 01.11.2022	800	857	0,14	Seven & i Holdings Co. Ltd. 3,350 % fällig am 17.09.2021	\$ 3.400	3.467	0,55
China Mengniu Dairy Co. Ltd. 4,250 % fällig am 07.08.2023	600	644	0,10	Imperial Brands Finance PLC 3,500 % fällig am 11.02.2023	900	943	0,15	Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	€ 500	623	0,10
China Resources Gas Group Ltd. 4,500 % fällig am 05.04.2022	300	312	0,05	Infor, Inc. 1,450 % fällig am 15.07.2023	300	305	0,05	Sky Ltd. 1,875 % fällig am 24.11.2023	2.100	2.725	0,43
Christian Dior SE 0,750 % fällig am 24.06.2021	€ 600	736	0,12	Informa PLC 2,125 % fällig am 06.10.2025	€ 1.300	1.678	0,27	Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust 6,650 % fällig am 01.08.2022	\$ 139	140	0,02
Clear Channel International BV 6,625 % fällig am 01.08.2025	\$ 200	212	0,03	InterContinental Hotels Group PLC 1,625 % fällig am 08.10.2024	800	1.005	0,16	Spirit AeroSystems, Inc. 5,500 % fällig am 15.01.2025	250	264	0,04
CMHI Finance BVI Co. Ltd. 4,375 % fällig am 06.08.2023	600	647	0,10	3,875 % fällig am 28.11.2022	€ 300	431	0,07	Sprint Spectrum Co. LLC 3,360 % fällig am 20.03.2023	309	313	0,05
CommonSpirit Health 2,760 % fällig am 01.10.2024	100	107	0,02	International Flavors & Fragrances, Inc. 3,200 % fällig am 01.05.2023	\$ 1.600	1.672	0,26	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 900	1.116	0,18
Crown European Holdings S.A. 0,750 % fällig am 15.02.2023	€ 1.000	1.223	0,19	John Lewis PLC 6,125 % fällig am 21.01.2025	€ 200	309	0,05	Stryker Corp. 0,250 % fällig am 03.12.2024	1.000	1.239	0,20
DAE Funding LLC 5,250 % fällig am 15.11.2021	\$ 700	716	0,11	JT International Financial Services BV 3,500 % fällig am 28.09.2023	\$ 400	432	0,07	Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 3,750 % fällig am 23.01.2023	\$ 1.000	1.045	0,17
Danone S.A. 2,077 % fällig am 02.11.2021	200	202	0,03	Kinder Morgan Energy Partners LP 4,150 % fällig am 01.03.2022	600	626	0,10	Suntory Holdings Ltd. 2,250 % fällig am 16.10.2024	1.100	1.151	0,18
Dell Bank International DAC 0,625 % fällig am 17.10.2022	€ 2.000	2.471	0,39	Komatsu Finance America, Inc. 0,849 % fällig am 09.09.2023	2.350	2.369	0,37	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 1.600	2.114	0,33
Delta Air Lines, Inc. 2,900 % fällig am 28.10.2024	\$ 900	889	0,14	Kraft Heinz Foods Co. 0,776 % fällig am 10.02.2021	1.600	1.600	0,25	Tencent Holdings Ltd. 2,985 % fällig am 19.01.2023	\$ 400	416	0,07
4,500 % fällig am 20.10.2025	600	642	0,10	Leidos, Inc. 3,625 % fällig am 15.05.2025	100	112	0,02	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV 3,650 % fällig am 10.11.2021	1.300	1.320	0,21
7,000 % fällig am 01.05.2025	1.000	1.155	0,18	Lennar Corp. 5,250 % fällig am 01.06.2026	780	926	0,15	2,200 % fällig am 21.07.2021	104	104	0,02
DISH DBS Corp. 6,750 % fällig am 01.06.2021	1.700	1.736	0,27	5,375 % fällig am 01.10.2022	3.100	3.331	0,53	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 2,200 % fällig am 21.07.2021	104	104	0,02
Dongfeng Motor Hong Kong International Co. Ltd. 1,150 % fällig am 23.10.2021	€ 2.400	2.960	0,47	Lenovo Group Ltd. 5,875 % fällig am 24.04.2025	200	231	0,04	Thermo Fisher Scientific, Inc. 0,125 % fällig am 01.03.2025	€ 2.300	2.836	0,45
Enbridge, Inc. 0,720 % fällig am 18.02.2022	\$ 1.200	1.201	0,19	Marriott International, Inc. 5,750 % fällig am 01.05.2025	700	819	0,13	2,150 % fällig am 21.07.2022	1.000	1.261	0,20
Energy Transfer Operating LP 2,900 % fällig am 15.05.2025	1.200	1.271	0,20	MGM China Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 18.06.2025	800	834	0,13	Time Warner Cable LLC 4,000 % fällig am 01.09.2021	\$ 400	406	0,06
Energy Transfer Partners LP 4,500 % fällig am 01.11.2023	900	975	0,15	Microchip Technology, Inc. 3,922 % fällig am 01.06.2021	2.400	2.434	0,38	Toyota Industries Corp. 3,110 % fällig am 12.03.2022	1.900	1.956	0,31
Entergy Louisiana LLC 0,620 % fällig am 17.11.2023	2.700	2.709	0,43	Newell Brands, Inc. 4,700 % fällig am 01.04.2026	650	717	0,11	Ubisoft Entertainment S.A. 1,289 % fällig am 30.01.2023	€ 1.700	2.126	0,34
Equifax, Inc. 1,091 % fällig am 15.08.2021	1.800	1.806	0,29	Nissan Canada, Inc. 3,150 % fällig am 14.09.2021	CAD 200	159	0,03	UCB S.A. 1,875 % fällig am 02.04.2022	2.000	2.498	0,40
Eurofins Scientific SE 2,125 % fällig am 25.07.2024	€ 600	782	0,12	(g)				Vale S.A. 3,750 % fällig am 10.01.2023	700	914	0,14
Expedia Group, Inc. 6,250 % fällig am 01.05.2025	\$ 500	580	0,09	Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	€ 2.000	2.552	0,40	Valero Energy Corp. 1,200 % fällig am 15.03.2024	\$ 1.000	1.010	0,16
7,000 % fällig am 01.05.2025	844	931	0,15	3,043 % fällig am 15.09.2023	\$ 2.400	2.511	0,40	VMware, Inc. 2,950 % fällig am 21.08.2022	2.056	2.133	0,34
Fidelity National Information Services, Inc. 0,125 % fällig am 03.12.2022	€ 1.000	1.230	0,19	Nutrition & Biosciences, Inc. 0,697 % fällig am 15.09.2022	800	803	0,13	West Fraser Timber Co. Ltd. 4,350 % fällig am 15.10.2024	200	209	0,03
Flex Ltd. 4,750 % fällig am 15.06.2025	\$ 300	341	0,05	NXP BV 3,875 % fällig am 01.09.2022	1.000	1.054	0,17	Westinghouse Air Brake Technologies Corp. 3,200 % fällig am 15.06.2025	500	540	0,09
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	€ 500	631	0,10	ONEOK Partners LP 5,000 % fällig am 15.09.2023	200	220	0,03	Williams Cos., Inc. 7,875 % fällig am 01.09.2021	385	404	0,06
GATX Corp. 0,945 % fällig am 05.11.2021	\$ 800	802	0,13	Pan American Energy LLC 38,606 % fällig am 26.02.2021	ARS 1.783	12	0,00	Woodside Finance Ltd. 3,650 % fällig am 05.03.2025	600	648	0,10
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,949 % fällig am 24.01.2024	€ 4.000	5.161	0,82	Panasonic Corp. 2,536 % fällig am 19.07.2022	\$ 2.600	2.673	0,42	4,600 % fällig am 10.05.2021	400	402	0,06
Geely Automobile Holdings Ltd. 3,625 % fällig am 25.01.2023	\$ 200	206	0,03	Penske Truck Leasing Co. LP 3,650 % fällig am 29.07.2021	2.500	2.539	0,40	Worldline S.A. 0,500 % fällig am 30.06.2023	€ 600	746	0,12
Georgia-Pacific LLC 0,625 % fällig am 15.05.2024	2.700	2.710	0,43	Petroleos Mexicanos 2,500 % fällig am 21.08.2021	€ 2.400	2.948	0,47	YPF S.A. 38,259 % fällig am 04.03.2021	ARS 3.130	22	0,00
HollyFrontier Corp. 2,625 % fällig am 01.10.2023	1.300	1.329	0,21	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3,050 % fällig am 23.01.2025	\$ 400	417	0,07	39,040 % fällig am 24.07.2021	21.512	134	0,02
HPHT Finance Ltd. 2,875 % fällig am 05.11.2024	700	732	0,12	Rolls-Royce PLC 3,625 % fällig am 14.10.2025	500	504	0,08	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 0,989 % fällig am 19.03.2021	\$ 1.511	1.511	0,24
Huntington Ingalls Industries, Inc. 3,844 % fällig am 01.05.2025	100	111	0,02	Royalty Pharma PLC 0,750 % fällig am 02.09.2023	700	704	0,11	Zoetis, Inc. 0,664 % fällig am 20.08.2021	2.100	2.105	0,33
Huntsman International LLC 5,125 % fällig am 15.11.2022	1.326	1.418	0,22	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625 % fällig am 01.03.2025	200	233	0,04			164.294	25,97
Hyatt Hotels Corp. 3,225 % fällig am 01.09.2022	200	202	0,03	6,250 % fällig am 15.03.2022	620	653	0,10				
5,375 % fällig am 15.08.2021	600	610	0,10	Safran S.A. 0,029 % fällig am 28.06.2021	€ 2.800	3.427	0,54	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
				Sands China Ltd. 4,600 % fällig am 08.08.2023	\$ 5.900	6.280	0,99	Alliant Energy Finance LLC 1,400 % fällig am 15.03.2026	900	905	0,14
				SEB S.A. 1,375 % fällig am 16.06.2025	€ 500	631	0,10	Appalachian Power Co. 4,600 % fällig am 30.03.2021	90	90	0,01
								Azure Power Energy Ltd. 5,500 % fällig am 03.11.2022	500	514	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	
BG Energy Capital PLC 4,000 % fällig am 15.10.2021	\$ 605	\$ 621	0,10	Southern California Edison Co. 1,200 % fällig am 01.02.2026	1.500	1.520	0,24	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,768 % fällig am 25.12.2035	636	628	0,10	
British Transco International Finance BV 0,000 % fällig am 04.11.2021 (a)	450	448	0,07	Southwestern Electric Power Co. 3,550 % fällig am 15.02.2022	\$ 400	\$ 411	0,07			1.180	0,19	
CMS Energy Corp. 3,600 % fällig am 15.11.2025	1.650	1.851	0,29	Sprint Communications, Inc. 6,000 % fällig am 15.11.2022	800	867	0,14	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
Contemporary Ruiding Development Ltd. 1,875 % fällig am 17.09.2025	200	202	0,03	Sprint Corp. 7,125 % fällig am 15.06.2024	125	146	0,02	Autonomous Community of Catalonia 4,900 % fällig am 15.09.2021	€ 900	\$ 1.140	0,18	
Duke Energy Corp. 3,550 % fällig am 15.09.2021	500	507	0,08	7,250 % fällig am 15.09.2021	1.400	1.458	0,23	Canada Government International Bond 1,500 % fällig am 01.09.2024	CAD 2.800	2.294	0,36	
East Ohio Gas Co. 1,300 % fällig am 15.06.2025	1.800	1.836	0,29	7,875 % fällig am 15.09.2023	200	232	0,04	China Development Bank 0,375 % fällig am 16.11.2021	€ 2.200	2.702	0,43	
Enel Finance International NV 0,000 % fällig am 17.06.2024 (a)	€ 800	984	0,16	State Grid Overseas Investment Ltd. 0,797 % fällig am 05.08.2026	€ 500	625	0,10	Export-Import Bank of India 1,271 % fällig am 28.03.2022 (g)	\$ 500	501	0,08	
2,650 % fällig am 10.09.2024	\$ 2.500	2.668	0,42	1,000 % fällig am 05.08.2025	\$ 500	497	0,08	France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2025 (a)	€ 9.000	11.331	1,79	
Evergy, Inc. 5,292 % fällig am 15.06.2022	505	533	0,09	3,750 % fällig am 02.05.2023	1.300	1.387	0,22	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,850 % fällig am 01.07.2025	1.000	1.332	0,21	
Galp Energia SGPS S.A. 2,000 % fällig am 15.01.2026	€ 1.000	1.264	0,20	Systems Energy Resources, Inc. 2,140 % fällig am 09.12.2025	1.150	1.153	0,18	Province of Alberta 1,000 % fällig am 15.11.2021	£ 100	138	0,02	
Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. 4,375 % fällig am 19.09.2022	\$ 200	210	0,03	Vistra Operations Co. LLC 3,550 % fällig am 15.07.2024	2.000	2.167	0,34	Province of Ontario 4,000 % fällig am 02.06.2021	CAD 2.600	2.073	0,33	
Georgia Power Co. 2,100 % fällig am 30.07.2023	200	209	0,03	Wisconsin Power & Light Co. 2,250 % fällig am 15.11.2022	600	617	0,10	Russia Government International Bond 6,500 % fällig am 28.02.2024	RUB 388.200	5.492	0,87	
Greenko Dutch BV 4,875 % fällig am 24.07.2022	1.100	1.114	0,18	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>			46.668	7,38				
India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	250	265	0,04	State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020			491.022	77,63				
IPALCO Enterprises, Inc. 3,700 % fällig am 01.09.2024	1.000	1.092	0,17	1,258 % fällig am 01.07.2025	1.200	1.228	0,19	Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2022	\$ 200	214	0,03	
Mega Advance Investments Ltd. 5,000 % fällig am 12.05.2021	1.400	1.418	0,22	<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>							27.217	4,30
Metropolitan Edison Co. 3,500 % fällig am 15.03.2023	300	313	0,05	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA								
Midwest Connector Capital Co. LLC 3,625 % fällig am 01.04.2022	2.300	2.341	0,37	2,500 % fällig am 01.03.2051	14.410	15.145	2,39	<b>OPTIONSSCHEINE</b>				
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,950 % fällig am 01.09.2022	1.000	1.028	0,16	3,000 % fällig am 01.02.2051	5.000	5.243	0,83	Stearns Holdings LLC 'B' - Exp. 05.11.2039	44.304	0	0,00	
NGPL PipeCo LLC 4,375 % fällig am 15.08.2022	2.977	3.103	0,49	3,500 % fällig am 01.02.2051	25.550	27.046	4,28					
Novatek OAO Via Novatek Finance DAC 4,422 % fällig am 13.12.2022	400	422	0,07				47.434	7,50				
ONEOK, Inc. 7,500 % fällig am 01.09.2023	2.418	2.801	0,44	<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>								
Pacific Gas & Electric Co. 1,750 % fällig am 16.06.2022	700	702	0,11	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)								
3,250 % fällig am 15.06.2023 ^	200	209	0,03	0,125 % fällig am 15.01.2022	115	117	0,02	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				
3,300 % fällig am 15.03.2027 ^	300	322	0,05	0,125 % fällig am 15.04.2025	28.932	31.136	4,92	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				
3,300 % fällig am 01.12.2027 ^	400	428	0,07	0,375 % fällig am 15.07.2027	11	12	0,00	Pacific Gas & Electric Co. 1,600 % fällig am 15.11.2021	\$ 4.100	4.103	0,65	
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	100	107	0,02	U.S. Treasury Notes				Southern California Edison Co. 0,501 % fällig am 03.12.2021	4.800	4.802	0,76	
3,450 % fällig am 01.07.2025	100	109	0,02	0,375 % fällig am 30.11.2025	4.900	4.908	0,78			8.905	1,41	
3,850 % fällig am 15.11.2023 ^	200	213	0,03	1,500 % fällig am 30.11.2024	800	839	0,13	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>				
4,250 % fällig am 01.08.2023	2.000	2.149	0,34				37.012	5,85				
Pennsylvania Electric Co. 4,150 % fällig am 15.04.2025	200	219	0,04	<b>NON-AGENCY-MBS</b>								
Potomac Electric Power Co. 3,600 % fällig am 15.03.2024	1.262	1.371	0,22	GSR Mortgage Loan Trust				34,251 % fällig am 29.01.2021 (a)(b)	ARS 11.798	82	0,01	
PPL WEM Ltd. 5,375 % fällig am 01.05.2021	1.300	1.305	0,21	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				<b>U.S. TREASURY BILLS</b>				
Redexis Gas Finance BV 2,750 % fällig am 08.04.2021	€ 1.200	1.469	0,23	2,745 % fällig am 25.11.2034	10	11	0,00	0,137 % fällig am 21.01.2021 (a)(b)	\$ 5.900	5.900	0,93	
San Diego Gas & Electric Co. 2,500 % fällig am 15.05.2026	\$ 226	246	0,04	6,342 % fällig am 25.09.2034	523	581	0,10	Summe kurzfristige Instrumente		14.887	2,35	
				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 623.281	98,54		
				1,753 % fällig am 25.01.2047	263	254	0,04	<b>AKTIEN</b>				
				2,564 % fällig am 25.01.2033	7	7	0,00	<b>INVESTMENTFONDS</b>				
							856	0,14	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>								
				Driver Australia Five Trust				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	4.320.875	43.045	6,81	
				1,020 % fällig am 21.07.2026	AUD 177	136	0,02	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (e)	5.163	67	0,01	
				IXIS Real Estate Capital Trust				Summe Investmentfonds	\$ 43.112	6,82		
				0,778 % fällig am 25.02.2036	\$ 413	416	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 <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 2.680	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (2.734)	\$ 2.680	\$ 2.680	0,42
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (2.734)</b>	<b>\$ 2.680</b>	<b>\$ 2.680</b>	<b>0,42</b>

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit 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 March Futures	Long	03.2021	173	\$ 28	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2021	141	30	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	69	16	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	31	(9)	0,00
				\$ 65	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 65	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 – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Newell Brands, Inc.	(1,000) %	20.06.2023	\$ 1.000	\$ 2	0,00

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2024	\$ 1.900	\$ 9	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2022	2.400	(5)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2021	1.300	37	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	200	5	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2021	400	(3)	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20.12.2023	900	(20)	(0,01)
Prudential Financial, Inc.	1,000	20.06.2021	400	(1)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 2.200	(178)	(0,03)
Ryder System, Inc.	1,000	20.12.2023	\$ 1.100	39	0,01
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.06.2022	700	0	0,00
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.12.2022	1.600	(1)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	€ 1.200	18	0,00
				\$ (100)	(0,02)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 1.700	\$ (30)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859 %	03.01.2022	BRL 57.600	\$ (4)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	57.600	81	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 5.900	106	0,02
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	1.500	28	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	9.300	387	0,06
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,588	16.12.2025	CNY 2.080	(1)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,605	07.08.2025	1.750	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,605	16.12.2025	3.130	(1)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,611	04.08.2025	1.800	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,620	16.07.2025	5.500	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,625	07.08.2025	1.750	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,633	10.08.2025	1.900	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,650	15.07.2025	7.300	1	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,650	21.08.2025	2.700	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,671	16.12.2025	6.250	1	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,803	17.03.2026	8.000	7	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,810	17.03.2026	4.700	5	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,848	17.03.2026	1.100	1	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,873	17.03.2026	1.100	2	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,884	17.03.2026	3.600	5	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,760	03.02.2030	\$ 1.900	(162)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,870	13.08.2029	700	(66)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,940	20.08.2029	1.100	(110)	(0,02)

Zahlung/ Erhalt	Erhalt/ variabler Zinssatz	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000 %	18.03.2030	\$ 1.000	\$ (88)	(0,01)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	£ 2.900	(9)	0,00	
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	HUF 1.604.100	61	0,01	
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,399	18.06.2028	¥ 77.700	(23)	0,00	
					\$ 221	0,03	
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 93</b>	<b>0,01</b>

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### 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 <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BOA	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.01.2021	1.300	\$ (2)	\$ 0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	600	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	600	(1)	0	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450	20.01.2021	2.200	(2)	(2)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	3.400	(6)	(1)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	600	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	400	(3)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	500	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	600	(1)	0	0,00	
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	1.100	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	500	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.100	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	200	0	0	0,00	
BPS	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	1.100	(1)	(2)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	900	(2)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	1.100	(2)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	1.200	(2)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	1.000	(1)	(1)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	3.100	(2)	(2)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	1.100	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	1.700	(2)	(2)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	3.100	(3)	(4)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.100	(1)	(1)	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	1.100	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	1.100	(2)	(2)	0,00	
	BRC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	2.500	(5)	0	0,00
		Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
		Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	1.100	(2)	(1)	0,00
		Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	2.300	(1)	(1)	0,00
		Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	2.300	(4)	(4)	(0,01)
DUB	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,950	20.01.2021	600	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	500	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	200	0	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	1.200	(2)	0	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	1.200	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	1.200	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	600	(1)	0	0,00	
FBF	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	17.02.2021	500	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.200	(2)	(1)	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	500	0	0	0,00	
GST	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	1.200	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	600	(1)	0	0,00	
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	300	0	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	700	(1)	0	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	1.100	(1)	0	0,00	
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	1.200	(1)	(1)	0,00	
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	1.200	(1)	(1)	0,00	

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400 %	17.03.2021	2.100	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	1.200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	2.100	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	1.200	(2)	(1)	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	1.100	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	1.200	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	600	(1)	0	0,00
MYC	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	1.100	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
						\$ (86)	\$ (42)	(0,01)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	\$ 102,141	04.03.2021	1.500	\$ (5)	\$ (2)	0,00
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104.000	11.03.2021	500	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	99.688	04.02.2021	500	(3)	(2)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98.406	04.02.2021	700	(2)	(3)	0,00
					\$ (11)	\$ (9)	0,00

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BRC	CNAC HK Finbridge Co. Ltd. Sinopec Group Overseas Development Ltd.	1,000 %	20.12.2024	\$ 300	\$ (6)	\$ 2	\$ (4)	0,00
	Intrum AB	1,000	20.12.2024	500	7	6	13	0,00
GST	Petrobras Global Finance BV	5,000	20.12.2024	€ 1.100	129	(31)	98	0,02
HUS	AP Moller - Maersk A/S	1,000	20.06.2022	\$ 300	(27)	29	2	0,00
JPM	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2022	€ 500	(3)	7	4	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	\$ 100	(9)	9	0	0,00
					\$ 91	\$ 22	\$ 113	0,02

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	01.2021	\$ 2.574	¥ 267.680	\$ 19	\$ 0	\$ 19	0,00
	01.2021	484	PLN 1.874	18	0	18	0,00
BPS	01.2021	AUD 575	\$ 423	0	(21)	(21)	0,00
	01.2021	BRL 4.301	828	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 849	BRL 4.301	0	(21)	(21)	0,00
	01.2021	331	€ 271	1	0	1	0,00
	01.2021	164	PLN 636	7	0	7	0,00
	03.2021	546	IDR 7.788.918	11	0	11	0,00
	03.2021	606	INR 45.102	7	0	7	0,00
CBK	01.2021	£ 431	\$ 576	0	(13)	(13)	0,00
	01.2021	\$ 251	¥ 26.096	2	0	2	0,00
	01.2021	8	PLN 30	0	0	0	0,00
	02.2021	371	MXN 8.532	55	0	55	0,01
	03.2021	317	7.166	39	0	39	0,01
	05.2021	955	COP 3.503.969	64	0	64	0,01
GLM	01.2021	BRL 6.287	\$ 1.237	27	0	27	0,00
	01.2021	¥ 548.900	5.303	0	(13)	(13)	0,00
	01.2021	\$ 622	BRL 3.144	0	(17)	(17)	0,00
	02.2021	RUB 77.863	\$ 1.021	0	(27)	(27)	0,00
	02.2021	\$ 618	BRL 3.144	0	(13)	(13)	0,00
	02.2021	5.305	¥ 548.900	13	0	13	0,00
HUS	01.2021	BRL 4.301	\$ 850	22	0	22	0,00
	01.2021	€ 4.716	5.691	0	(80)	(80)	(0,01)
	01.2021	£ 9.652	12.909	0	(285)	(285)	(0,05)
	01.2021	\$ 828	BRL 4.301	0	0	0	0,00
	01.2021	463	¥ 48.210	4	0	4	0,00
	01.2021	711	MXN 14.320	7	0	7	0,00
	01.2021	413	PLN 1.575	10	0	10	0,00
	02.2021	RUB 51.858	\$ 694	0	(5)	(5)	0,00
	02.2021	\$ 850	BRL 4.301	0	(22)	(22)	0,00
	03.2021	606	INR 45.114	7	0	7	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
JPM	01.2021	\$ 606	ZAR 9.226	\$ 20	\$ 0	\$ 20	0,00
MYI	01.2021	€ 1.651	\$ 2.022	2	0	2	0,00
	01.2021	£ 1	2	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 31	PLN 117	1	0	1	0,00
SCX	01.2021	€ 119.109	\$ 142.644	0	(3.092)	(3.092)	(0,49)
	01.2021	HUF 79.623	260	0	(8)	(8)	0,00
	02.2021	€ 119.109	145.833	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2021	CAD 5.580	4.307	0	(73)	(73)	(0,01)
	01.2021	\$ 4.380	CAD 5.580	0	0	0	0,00
	01.2021	1.983	¥ 206.913	21	0	21	0,00
	02.2021	CAD 5.580	\$ 4.380	0	0	0	0,00
	03.2021	\$ 486	MXN 9.968	10	0	10	0,00
UAG	02.2021	RUB 171.414	\$ 2.252	0	(57)	(57)	(0,01)
				\$ 367	\$ (3.748)	\$ (3.381)	(0,54)

## ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional 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
BPS	01.2021	€ 198	\$ 240	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	01.2021	\$ 145.750	€ 121.663	3.116	(5)	3.111	0,49
BRC	01.2021	€ 192	\$ 235	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2021	2.109	2.532	0	(49)	(49)	(0,01)
HUS	01.2021	509	622	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 2.927	€ 2.440	58	0	58	0,01
JPM	01.2021	€ 126	\$ 154	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	\$ 157.599	€ 131.595	3.413	0	3.413	0,54
	02.2021	241.016	196.846	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2021	148.594	124.075	3.219	0	3.219	0,51
	02.2021	219.068	178.920	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 9.806	\$ (60)	\$ 9.746	1,54

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse Institutional 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	01.2021	£ 33	\$ 45	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2021	\$ 186	£ 139	4	0	4	0,00
BRC	01.2021	£ 45	\$ 60	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 81	£ 60	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	£ 23	\$ 31	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 8.110	£ 6.067	184	0	184	0,03
HUS	01.2021	9.306	6.955	201	0	201	0,03
MYI	01.2021	86	64	1	0	1	0,00
SCX	01.2021	£ 65	\$ 87	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 348	£ 262	10	0	10	0,00
SSB	01.2021	9.044	6.775	218	0	218	0,04
				\$ 619	\$ (4)	\$ 615	0,10

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse 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	01.2021	\$ 15.642	NOK 138.263	\$ 507	\$ 0	\$ 507	0,08
BRC	01.2021	15.359	134.864	393	0	393	0,06
MYI	01.2021	15.875	140.545	540	0	540	0,09
				\$ 1.440	\$ 0	\$ 1.440	0,23

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 8.482 1,34

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	\$ 2.400	\$ (2.489)	(0,39)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (2.489)	(0,39)
Summe Anlagen		\$ 675.224	106,75
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (42.705)	(6,75)
Nettovermögen		\$ 632.519	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit 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) Nullkuponwertpapier.

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

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	2,129 %	24.11.2026	17.11.2020	\$ 500	\$ 512	0,08
Export-Import Bank of India	1,271	28.03.2022	19.12.2019	498	501	0,08
Nissan Canada, Inc.	3,150	14.09.2021	05.06.2020	147	159	0,03
				\$ 1.145	\$ 1.172	0,19

Barmittel in Höhe von USD 3.285 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	65	8.575	0	8.640
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(2.489)	0	(2.489)
<b>Summen</b>	<b>\$ 43.177</b>	<b>\$ 631.347</b>	<b>\$ 700</b>	<b>\$ 675.224</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 540.238	\$ 413	\$ 540.651
Investmentfonds	32.319	0	0	32.319
Pensionsgeschäfte	0	12.600	0	12.600
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(192)	8.129	7	7.944
<b>Summen</b>	<b>\$ 32.127</b>	<b>\$ 560.967</b>	<b>\$ 420</b>	<b>\$ 593.514</b>

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 540	\$ (560)	\$ (20)
BPS	3.079	(3.760)	(681)
BRC	394	(420)	(26)
CBK	281	0	281
DUB	(2)	(10)	(12)
FAR	(2)	0	(2)
FBF	(1)	0	(1)
GLM	(30)	0	(30)
GST	91	0	91
HUS	(82)	0	(82)
JPM	20	0	20
MYC	(4)	(110)	(114)
MYI	544	(570)	(26)
SAL	(3)	0	(3)
SCX	320	(270)	50
SSB	218	0	218
TOR	3.176	(3.960)	(784)
UAG	(57)	0	(57)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	61,59	76,47
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	36,47	29,47
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,48	k. A.
Investmentfonds	6,82	6,33
Pensionsgeschäfte	0,42	2,47
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	(0,04)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate	1,34	1,50
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,39)	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(7,72)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(2,34)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,39	0,64
Unternehmensanleihen und Wechsel	77,63	78,29
Kommunalanleihen und Wechsel	0,19	k. A.
US-Regierungsbehörden	7,50	6,29
US-Schatzobligationen	5,85	16,22
Non-Agency-MBS	0,14	0,22
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,19	0,31
Staatsemissionen	4,30	3,73
Optionsscheine	0,00	k. A.
Kurzfristige Instrumente	2,35	0,24
Investmentfonds	6,82	6,33
Pensionsgeschäfte	0,42	2,47
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	(0,04)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	0,02
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,03	0,08
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,07
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,06)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,02
Devisenterminkontrakte	(0,54)	(0,32)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,87	1,80
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,39)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(6,75)	(16,30)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income 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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>			
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>				<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>			
Advanz Pharma Corp. 6,500 % fällig am 06.09.2024	\$	191	0,02	Starfruit Finco BV 3,153 % fällig am 01.10.2025	\$	96	0,01	Blackstone Property Partners Europe Holdings SARRL 1,750 % fällig am 12.03.2029	€	100	0,01
AI Convoy (Luxembourg) SARL 4,500 % fällig am 17.01.2027		23	0,00	Sunshine Luxembourg SARL 3,500 % fällig am 01.10.2026	€	5.000	0,64	BNP Paribas S.A. 4,400 % fällig am 14.08.2028	\$	200	0,03
Altice France S.A. 4,237 % fällig am 14.08.2026		196	0,02	4,254 % fällig am 01.10.2026	\$	430	0,04	BOC Aviation Ltd. 1,376 % fällig am 26.09.2023		200	0,02
API Group, Inc. 2,647 % fällig am 01.10.2026		99	0,01	Syniverse Holdings, Inc. 6,000 % fällig am 09.03.2023		92	0,01	Cantor Fitzgerald LP 4,875 % fällig am 01.05.2024		15	0,00
Banijay Entertainment S.A.S. 3,903 % fällig am 01.03.2025		14	0,00	U.S. Renal Care, Inc. 5,147 % fällig am 26.06.2026		68	0,01	CBL & Associates LP 5,950 % fällig am 15.12.2026 ^		73	0,00
Bausch Health Cos., Inc. 2,898 % fällig am 27.11.2025	1.380	1.370	0,14	Univision Communications, Inc. 3,750 % fällig am 15.03.2024		345	0,04	CDBL Funding 1,471 % fällig am 15.11.2021		500	0,05
Caesars Resort Collection LLC 2,897 % fällig am 23.12.2024	1.791	1.761	0,18	Valaris PLC TBD% fällig am 17.08.2021		23	0,00	China Construction Bank Corp. 0,061 % fällig am 24.09.2021	€	200	0,03
4,647 % fällig am 21.07.2025	1.995	2.001	0,21	Westmoreland Mining Holdings LLC 9,250 % fällig am 15.03.2022		3	0,00	CIT Group, Inc. 4,125 % fällig am 09.03.2021	\$	174	0,02
CommScope, Inc. 3,397 % fällig am 06.04.2026		99	0,01	Westmoreland Mining Holdings LLC (15,000 % PIK) TBD% fällig am 15.03.2029 (b)		11	0,00	5,000 % fällig am 01.08.2023		838	0,10
Delta Air Lines, Inc. 5,750 % fällig am 29.04.2023		187	0,02	Whatabrands LLC 2,970 % fällig am 31.07.2026		15	0,00	Cooperative Rabobank UA 6,625 % fällig am 29.06.2021 (g)(i)	€	6.600	0,87
Diamond Resorts International, Inc. 4,750 % fällig am 02.09.2023	294	280	0,03	Windstream Services LLC 7,250 % fällig am 21.09.2027		3	0,00	CPI Property Group S.A. 1,625 % fällig am 23.04.2021		200	0,03
Emerald TopCo, Inc. 3,714 % fällig am 24.07.2026		74	0,01	Zayo Group Holdings, Inc. 3,147 % fällig am 09.03.2027		356	0,04	2,750 % fällig am 12.05.2026		200	0,03
Envision Healthcare Corp. 3,897 % fällig am 10.10.2025	410	344	0,04					4,750 % fällig am 08.03.2023	\$	500	0,06
EyeCare Partners LLC 3,750 % - 3,897 % fällig am 18.02.2027	47	46	0,00	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)		400	0,05
Finacial & Risk U.S. Holdings, Inc. 3,250 % fällig am 01.10.2025	€	990	0,13	<b>BANKEN UND FINANZEN</b>				Credit Suisse Group AG 4,194 % fällig am 01.04.2031		5.000	0,61
3,397 % fällig am 01.10.2025	\$	357	0,04	AerCap Ireland Capital DAC 3,500 % fällig am 26.05.2022		228	0,03	7,500 % fällig am 17.07.2023 (g)(i)		200	0,02
Forest City Enterprises LP 3,647 % fällig am 08.12.2025	1.271	1.220	0,13	4,625 % fällig am 01.07.2022		700	0,08	7,500 % fällig am 11.12.2023 (g)(i)		500	0,06
Froneri International PLC 2,397 % fällig am 31.01.2027		90	0,01	AIB Group PLC 4,263 % fällig am 10.04.2025		300	0,03	Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	€	3.761	0,49
Genesee & Wyoming, Inc. 2,254 % fällig am 30.12.2026	56	55	0,01	Air Lease Corp. 2,500 % fällig am 01.03.2021		52	0,01	Deutsche Bank AG 1,510 % fällig am 04.02.2021	\$	160	0,02
Gray Television, Inc. 2,655 % fällig am 02.01.2026	932	927	0,10	3,875 % fällig am 01.04.2021		25	0,00	1,625 % fällig am 20.01.2027	€	2.700	0,36
iHeartCommunications, Inc. 3,147 % fällig am 01.05.2026	4.932	4.860	0,51	Altarea S.C.A. 1,875 % fällig am 17.01.2028	€	300	0,04	2,625 % fällig am 16.12.2024	£	5.500	0,83
4,750 % fällig am 01.05.2026	2.488	2.482	0,26	Ambac LSNJ LLC 6,000 % fällig am 12.02.2023	\$	650	0,07	3,375 % fällig am 12.05.2021	\$	1.415	0,15
Ingersoll Rand Co. Ltd. 1,897 % fällig am 01.03.2027	80	79	0,01	Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029		400	0,05	3,961 % fällig am 26.11.2025		480	0,06
Intelsat Jackson Holdings S.A. 3,600 % - 6,500 % fällig am 13.07.2022	444	454	0,05	Atrium European Real Estate Ltd. 3,000 % fällig am 11.09.2025	€	1.000	0,13	4,250 % fällig am 14.10.2021		1.600	0,17
8,000 % fällig am 27.11.2023	7.680	7.784	0,81	Aviation Capital Group LLC 2,875 % fällig am 20.01.2022	\$	96	0,01	5,000 % fällig am 14.02.2022		150	0,02
Jefferies Finance LLC 3,147 % fällig am 03.06.2026	33	32	0,00	3,875 % fällig am 01.05.2023		670	0,07	Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust 5,250 % fällig am 30.05.2025		152	0,02
Lealand Finance Company B.V. (1,147 % bar und 3,000 % PIK) 4,147 % fällig am 30.06.2025	22	15	0,00	Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025		138	0,02	5,125 % fällig am 30.11.2024		84	0,01
McDermott Technology Americas, Inc. TBD% fällig am 30.06.2024 (b)	8	7	0,00	3,250 % fällig am 15.02.2027		36	0,00	EPR Properties 4,750 % fällig am 15.12.2026		8	0,00
Nascar Holdings, Inc. 2,897 % fällig am 19.10.2026	110	110	0,01	5,125 % fällig am 01.10.2023		346	0,04	4,950 % fällig am 15.04.2028		34	0,00
Neiman Marcus Group Ltd. LLC 13,000 % fällig am 25.09.2025	406	434	0,04	5,500 % fällig am 15.01.2023		1.077	0,12	Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % fällig am 29.04.2030		411	0,05
Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 3,398 % fällig am 30.06.2025	1.693	1.672	0,17	Banca Carige SpA 0,877 % fällig am 25.02.2021	€	700	0,09	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 14.05.2021	€	100	0,01
Parexel International Corp. 2,897 % fällig am 27.09.2024	7.800	7.682	0,80	1,189 % fällig am 25.10.2021	€	1.600	0,21	1,048 % fällig am 05.04.2021	\$	400	0,04
PetSmart, Inc. 4,500 % fällig am 11.03.2022	7.822	7.822	0,81	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 0,875 % fällig am 08.10.2027		300	0,04	1,104 % fällig am 12.10.2021		500	0,05
PUG LLC 3,647 % fällig am 12.02.2027	30	28	0,00	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 8,875 % fällig am 14.04.2021 (g)(i)		7.000	0,91	1,456 % fällig am 15.02.2023		200	0,02
Sequa Mezzanine Holdings LLC 7,750 % fällig am 28.11.2023	1.956	1.971	0,20	Banco Bradesco S.A. 2,850 % fällig am 27.01.2023	\$	200	0,02	1,744 % fällig am 19.07.2024	€	100	0,01
10,000 % fällig am 23.07.2025	2.860	2.774	0,29	3,200 % fällig am 27.01.2025		200	0,02	2,770 % fällig am 07.01.2021	\$	400	0,04
Sinclair Television Group, Inc. 2,650 % fällig am 30.09.2026	39	38	0,00	Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % fällig am 10.01.2025		200	0,02	3,087 % fällig am 09.01.2023		200	0,02
Sotera Health Holdings LLC 5,500 % fällig am 11.12.2026	96	97	0,01	Banco de Credito del Peru 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	600	0,02	3,339 % fällig am 28.03.2022		2.000	0,24
				Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025 (g)(i)	€	669	0,08	3,375 % fällig am 13.11.2025		3.000	0,32
				Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022 (i)	\$	3.452	0,40	3,550 % fällig am 07.10.2022		308	0,03
				10,000 % fällig am 21.05.2021	£	250	0,04	3,813 % fällig am 12.10.2021		3.104	0,33
				Barclays PLC 3,375 % fällig am 02.04.2025	€	3.800	0,53	5,085 % fällig am 07.01.2021		1.000	0,10
				6,125 % fällig am 15.12.2025 (g)(i)	\$	500	0,06	5,596 % fällig am 07.01.2022		1.300	0,14
				BGC Partners, Inc. 3,750 % fällig am 01.10.2024		54	0,01	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 6,500 % fällig am 01.10.2025		229	0,03
								6,750 % fällig am 15.03.2022		192	0,02
								GE Capital Funding LLC 4,400 % fällig am 15.05.2030		1.000	0,12
								General Motors Financial Co., Inc. 0,009 % fällig am 26.03.2022	€	100	0,01
								GLP Capital LP 5,300 % fällig am 15.01.2029	\$	88	0,01
								Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 5,800 % fällig am 21.02.2022		1.140	0,12
								Highwoods Realty LP 3,050 % fällig am 15.02.2030		300	0,03
								4,200 % fällig am 15.04.2029		152	0,02







# Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration 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
OAK Hill European Credit Partners Designated Activity Co. 0,730 % fällig am 20.01.2032	€ 2.800	\$3.423	0,36	3,680 % fällig am 26.02.2026 CNY	4.500	\$ 701	0,07	<b>BASISKONSUMGÜTER</b>			
Option One Mortgage Loan Trust 1,573 % fällig am 25.11.2034	\$ 1.195	1.208	0,13	3,740 % fällig am 10.09.2025	7.100	1.109	0,12	Neiman Marcus Group Ltd. LLC (c)(j)	5.145	\$ 467	0,05
Orwell Park CLO Designated Activity Co. 0,780 % fällig am 18.07.2029	€ 1.748	2.139	0,22	4,150 % fällig am 26.10.2025	7.000	1.113	0,12	<b>ENERGIE</b>			
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,723 % fällig am 25.02.2035	\$ 13.067	13.142	1,37	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,875 % fällig am 16.04.2050	\$ 600	733	0,08	Noble Corp. PLC (c)(j)	10.881	97	0,01
Residential Asset Mortgage Products Trust 1,228 % fällig am 25.03.2035	2.000	1.950	0,20	Guatemala Government International Bond 6,125 % fällig am 01.06.2050	200	265	0,03	<b>INDUSTRIEWERTE</b>			
SoFi Professional Loan Program LLC 0,998 % fällig am 25.07.2039	814	813	0,08	Indonesia Government International Bond 4,200 % fällig am 15.10.2050	200	240	0,02	Westmoreland Mining Holdings LLC (c)(j)	231	2	0,00
2,630 % fällig am 25.07.2040	2.245	2.287	0,24	Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	800	952	0,10			980	0,10
St Paul's CLO DAC 0,850 % fällig am 20.08.2030	€ 3.497	4.284	0,45	4,500 % fällig am 03.04.2120	200	265	0,03	<b>OPTIONSSCHEINE</b>			
Starwood Commercial Mortgage Trust 1,239 % fällig am 15.07.2038	\$ 10.000	9.963	1,04	Mexico Government International Bond 4,750 % fällig am 27.04.2032	200	241	0,02	iHeartMedia, Inc. 'A' - Exp. 01.05.2039	63.713	814	0,09
Structured Asset Investment Loan Trust 0,868 % fällig am 25.01.2036	844	832	0,09	5,000 % fällig am 27.04.2051	200	250	0,03	Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21.09.2055	361	7	0,00
1,148 % fällig am 25.09.2034	676	674	0,07	Peru Government International Bond 5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN 600	173	0,02			821	0,09
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 0,378 % fällig am 25.05.2047	394	385	0,04	5,400 % fällig am 12.08.2034	13	4	0,00	<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>			
1,123 % fällig am 25.05.2035	3.900	3.739	0,39	5,940 % fällig am 12.02.2029	4.109	1.417	0,15	Uniti Group, Inc.	284	3	0,00
Terwin Mortgage Trust 1,528 % fällig am 25.03.2035	710	652	0,07	6,150 % fällig am 12.08.2032	3.290	1.111	0,12				
Towd Point Mortgage Trust 4,750 % fällig am 25.10.2058	9.300	9.657	1,01	6,350 % fällig am 12.08.2028	1.711	601	0,06				
Tralee CLO Ltd. 1,328 % fällig am 20.10.2028	250	250	0,03	6,950 % fällig am 12.08.2031	472	170	0,02				
Vendome Funding CLO DAC 1,860 % fällig am 20.07.2031	€ 6.649	8.154	0,85	8,200 % fällig am 12.08.2026	2.513	944	0,10				
		135.770	14,13	Provincia de Buenos Aires 34,187 % fällig am 31.05.2022	ARS 48.490	295	0,03	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
				36,050 % fällig am 12.04.2025	6.240	31	0,00	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
				Qatar Government International Bond 4,400 % fällig am 16.04.2050	\$ 400	522	0,05	(3,480) % fällig am 13.09.2021 (d)(e)	ARS 88.910	648	0,07
				Russia Government International Bond 7,150 % fällig am 12.11.2025	RUB 19.414	283	0,03	(0,275) % fällig am 17.04.2021 (d)(e)	10.871	77	0,01
				7,950 % fällig am 07.10.2026	13.158	199	0,02	1,782 % fällig am 31.03.2021 (d)(e)	76.200	536	0,05
				Serbia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.05.2027	€ 196	270	0,03			1.261	0,13
				South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR 1.400	91	0,01	<b>MEXICO TREASURY BILLS</b>			
				8,750 % fällig am 28.02.2048	2.000	112	0,01	4,309 % fällig am 25.02.2021 (d)(e)	MXN 187.420	9.348	0,97
				10,500 % fällig am 21.12.2026	53.100	4.289	0,45	4,339 % fällig am 11.03.2021 (d)(e)	150.000	7.469	0,78
				Turkey Government International Bond 4,250 % fällig am 13.03.2025	\$ 1.200	1.206	0,13			16.817	1,75
				4,625 % fällig am 31.03.2025	€ 500	650	0,07	Summe kurzfristige Instrumente		18.078	1,88
				5,250 % fällig am 13.03.2030	\$ 1.000	1.006	0,10	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 1.264.313	131,62
				5,600 % fällig am 14.11.2024	900	945	0,10				
				5,750 % fällig am 22.03.2024	200	211	0,02	<b>AKTIEN</b>			
				5,750 % fällig am 11.05.2047	741	708	0,07	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
				Venezuela Government International Bond 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^	2.000	194	0,02	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
				9,000 % fällig am 07.05.2023 ^	1.600	155	0,02	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	9.366.877	93.313	9,71
						28.102	2,93				
								Summe Investmentfonds		\$ 93.313	9,71
				<b>STAMMAKTIEN</b>							
				<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>							
				Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)	173.174	286	0,03				
				iHeartMedia, Inc. 'A' (c)	9.783	127	0,01				
				iHeartMedia, Inc. 'B' (c)	130	1	0,00				
						414	0,04				

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettover-mögens
BOS	0,070	31.12.2020	04.01.2021	\$ 7.000	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.12.2027	\$ (7.142)	\$ 7.000	\$ 7.000	0,73
FICC	0,000	31.12.2020	04.01.2021	769	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	(784)	769	769	0,08
MBC	0,110	31.12.2020	04.01.2021	19.800	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 30.06.2023	(20.435)	19.800	19.800	2,06
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (28.361 )</b>	<b>\$ 27.569</b>	<b>\$ 27.569</b>	<b>2,87</b>

(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-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	86	\$ 70	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2021	81	(29)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	1.048	(195)	(0,02)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	18	26	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	93	385	0,04
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	2	(4)	0,00
				\$ 253	0,03

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettover- mögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	\$ 171,000	22.01.2021	4	\$ (3)	\$ (2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	179,000	22.01.2021	4	(4)	(1)	0,00
				\$ (7)	\$ (3)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 250	0,03

## 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
Airbus Group Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 7.600	\$ 258	0,03
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2025	\$ 700	28	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	3.100	8	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	400	34	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	€ 600	(10)	0,00
				\$ 318	0,03

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
CDX.IG-33 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2024	\$ 3.400	\$ 4	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000 %	20.06.2024	\$ 752	\$ 31	0,00
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	930	45	0,01
CDX.EM-33 5-Year Index	1,000	20.06.2025	665	81	0,01
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	800	30	0,00
CDX.HY-34 5-Year Index	5,000	20.06.2025	460	35	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 14.800	70	0,01
				\$ 292	0,03

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettover- mögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,840 %	03.01.2022	BRL 300	\$ 0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,848	03.01.2022	300	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022	1.500	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,865	03.01.2022	500	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	1.800	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,880	03.01.2022	1.800	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,883	03.01.2022	7.000	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,884	03.01.2022	1.500	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,886	03.01.2022	2.200	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,060	03.01.2022	33.900	17	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,830 %	02.01.2023	BRL 5.100	\$ 55	0,01	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,836	02.01.2023	4.600	49	0,01	
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,855	02.01.2023	1.500	16	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	17.06.2022	\$ 2.700	(64)	(0,01)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	18.900	417	0,04	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	4.400	(372)	(0,04)	
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,317	16.12.2050	400	0	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2021	500	(8)	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	1.200	(107)	(0,01)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	17.06.2050	7.700	917	0,09	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	06.01.2030	300	(18)	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.01.2030	4.600	(348)	(0,04)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,910	17.10.2049	400	(43)	(0,01)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.12.2029	21.000	(1.918)	(0,20)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.02.2030	2.500	(231)	(0,02)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.03.2030	1.200	(129)	(0,01)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	12.03.2050	15.700	(3.449)	(0,36)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,543	05.02.2024	1.000	(81)	(0,01)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,550	05.02.2024	1.000	(81)	(0,01)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,559	05.02.2024	1.000	(82)	(0,01)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,571	05.02.2024	500	(41)	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,580	05.02.2024	1.500	(123)	(0,01)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,605	05.02.2024	1.500	(125)	(0,01)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,607	05.02.2024	500	(42)	0,00	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	19.12.2023	19.100	(1.618)	(0,17)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2024	24.000	(1.531)	(0,16)	
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2026	12.700	(1.274)	(0,13)	
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	AUD 12.400	1.276	0,13	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	€ 2.500	(393)	(0,04)	
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050	600	(98)	(0,01)	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	17.03.2051	£ 800	(8)	0,00	
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR	0,000	15.03.2029	¥ 3.763.000	(18)	0,00	
						\$ (9.456)	(0,98)
						\$ (8.842)	(0,92)

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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### 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 <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000 %	20.01.2021	3.900	\$ (5)	\$ 0	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	4.000	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	4.000	(4)	(3)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	12.400	(10)	(7)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	6.500	(9)	(9)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	12.400	(12)	(14)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	3.900	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	3.900	(6)	(7)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	32.700	(23)	(2)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	32.700	(35)	(18)	0,00
GST	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	10.600	(7)	(6)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	10.600	(12)	(12)	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	3.900	(2)	(2)	0,00
MYC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	3.900	(4)	(2)	0,00
							\$ (133)	\$ (105)

## DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC USD versus CNH	CNH 6.520	14.01.2021	518	\$ (2)	\$ (3)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6.780	14.01.2021	518	(2)	0	0,00
GLM	Put - OTC USD versus CNH	6.534	15.01.2021	415	(2)	(3)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6.792	15.01.2021	415	(1)	0	0,00
HUS	Put - OTC USD versus CNH	6.530	05.02.2021	726	(4)	(7)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6.800	05.02.2021	726	(4)	0	0,00
	Put - OTC USD versus CNH	6.510	08.02.2021	546	(2)	(4)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6.810	08.02.2021	546	(2)	0	0,00
	Put - OTC USD versus CNH	6.450	19.02.2021	548	(2)	(3)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6.700	19.02.2021	548	(2)	(1)	0,00
SCX	Put - OTC USD versus CNH	6.400	09.03.2021	1.096	(4)	(4)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6.680	09.03.2021	1.096	(6)	(4)	0,00
					\$ (33)	\$ (29)	0,00

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,280 %	11.01.2021	9.300	\$ (46)	\$ (15)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,580	11.01.2021	9.300	(46)	(7)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,078	20.01.2021	9.000	(104)	(4)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,438	20.01.2021	9.000	(104)	(117)	(0,02)
						\$ (300)	\$ (143)	(0,02)	

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	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)	93	(7)	0,00
BPS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(2)	4	2	0,00
CBK	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(2)	4	2	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.700	(86)	80	(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)	7	5	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(3)	5	2	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(16)	10	(6)	0,00
NGF	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2023	5.500	(157)	233	76	0,01
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(9)	7	(2)	0,00
					\$ (410)	\$ 478	\$ 68	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500 %	16.12.2072	\$ 6.200	\$ 0	\$ 14	\$ 14	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	15.300	(74)	198	124	0,01
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	25.375	(78)	408	330	0,04
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	25.375	(194)	490	296	0,03
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	(2)	4	2	0,00
					\$ (348)	\$ 1.114	\$ 766	0,08

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	\$ (12)	\$ (12)	0,00
CBK	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,845	23.01.2025	2.000	0	3	3	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,850	23.01.2025	2.400	0	3	3	0,00
						\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

## DEWISENTERMINIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2021	BRL 1.618	\$ 311	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	
	01.2021	\$ 319	BRL 1.618	0	(7)	(7)	0,00	
	01.2021	ZAR 17.033	\$ 1.141	0	(16)	(16)	0,00	
	02.2021	£ 65.261	86.077	0	(3.160)	(3.160)	(0,33)	
	02.2021	\$ 3.392	€ 2.816	58	(1)	57	0,01	
	02.2021	2.333	NOK 21.745	207	0	207	0,02	
	02.2021	2.114	SEK 18.320	118	0	118	0,01	
	02.2021	262	TRY 2.016	6	0	6	0,00	
	03.2021	3.508	INR 263.920	76	0	76	0,01	
	01.2021	287	CLP 225.925	31	0	31	0,00	
BPS	01.2021	232	TRY 1.791	8	0	8	0,00	
	01.2021	ZAR 6.472	\$ 442	2	0	2	0,00	
	02.2021	\$ 2.556	AUD 3.527	167	0	167	0,02	
	01.2021	BRL 16.969	\$ 3.265	0	(2)	(2)	0,00	
BRC	01.2021	\$ 3.197	BRL 16.969	69	0	69	0,01	
	01.2021	693	TRY 5.358	23	0	23	0,00	
	01.2021	ZAR 3.435	\$ 235	1	0	1	0,00	
	02.2021	\$ 964	£ 722	23	0	23	0,00	
	02.2021	418	TRY 3.224	10	0	10	0,00	
	BSS	02.2021	MXN 187.420	\$ 9.356	5	0	5	0,00
		01.2021	\$ 242	RUB 18.648	9	0	9	0,00
	CBK	01.2021	330	TRY 2.549	12	0	12	0,00
		01.2021	1.295	ZAR 20.111	71	0	71	0,01
		01.2021	ZAR 8.206	\$ 548	0	(9)	(9)	0,00
02.2021		€ 7.843	9.348	1	(260)	(259)	(0,03)	
02.2021		\$ 742	€ 623	21	0	21	0,00	
02.2021		1.667	MXN 38.281	247	0	247	0,02	
02.2021		2.036	NOK 18.685	146	0	146	0,01	
02.2021		235	RUB 17.325	0	(2)	(2)	0,00	
02.2021		2.272	SEK 19.985	162	0	162	0,02	
02.2021		544	TRY 4.195	12	(1)	11	0,00	
GLM	03.2021	3.543	MXN 77.376	310	0	310	0,03	
	01.2021	BRL 1.618	\$ 318	7	0	7	0,00	
	01.2021	\$ 311	BRL 1.618	0	0	0	0,00	
	01.2021	303	RUB 23.215	10	0	10	0,00	
	01.2021	ZAR 6.831	\$ 461	1	(3)	(2)	0,00	
	02.2021	NZD 5.110	3.484	0	(196)	(196)	(0,02)	
	02.2021	\$ 318	BRL 1.618	0	(7)	(7)	0,00	
	02.2021	2.068	RUB 157.845	59	0	59	0,01	
	02.2021	279	TRY 2.093	0	(3)	(3)	0,00	
	HUS	01.2021	BRL 21.569	\$ 4.263	110	0	110	0,01
01.2021		\$ 4.169	BRL 21.569	1	(18)	(17)	0,00	
01.2021		1.557	ZAR 24.307	94	0	94	0,01	
01.2021		ZAR 3.193	\$ 218	0	0	0	0,00	
02.2021		€ 1.084	1.289	0	(38)	(38)	0,00	
02.2021		\$ 4.260	BRL 21.569	0	(109)	(109)	(0,01)	
02.2021		491	€ 403	3	0	3	0,00	
02.2021		594	PEN 2.166	5	0	5	0,00	
02.2021		1.564	RUB 116.773	9	(1)	8	0,00	
02.2021		39	TRY 290	0	0	0	0,00	
MYI	03.2021	MXN 150.000	\$ 7.525	53	0	53	0,01	
	03.2021	\$ 550	PEN 1.958	0	(9)	(9)	0,00	
	05.2021	1.924	MXN 39.857	48	0	48	0,01	
	01.2021	SGD 10	\$ 7	0	0	0	0,00	
	01.2021	\$ 465	TRY 3.600	18	0	18	0,00	
	01.2021	1.520	ZAR 23.479	74	0	74	0,01	
	02.2021	3.424	NZD 4.972	157	0	157	0,02	
	02.2021	260	TRY 1.976	1	0	1	0,00	
	01.2021	ZAR 3.913	\$ 266	0	0	0	0,00	
	01.2021	\$ 194	TRY 1.495	7	0	7	0,00	
RBC	01.2021	ZAR 15.594	\$ 1.057	2	(4)	(2)	0,00	
	02.2021	\$ 1.154	£ 864	27	0	27	0,00	
	02.2021	399	RUB 30.570	13	0	13	0,00	
	02.2021	435	TRY 3.313	5	(2)	3	0,00	
SSB	03.2021	3.561	IDR 51.271.717	64	0	64	0,01	
	01.2021	235	ZAR 3.606	10	0	10	0,00	
	01.2021	784	TRY 6.080	30	0	30	0,00	
	02.2021	€ 105.924	\$ 125.437	0	(4.304)	(4.304)	(0,45)	
UAG	02.2021	£ 147	194	0	(7)	(7)	0,00	
	02.2021	\$ 4.901	RUB 372.045	114	(2)	112	0,01	
	02.2021	40	TRY 313	1	0	1	0,00	
				\$ 2.718	\$ (8.161)	\$ (5.443)	(0,57)	

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 148	CHF 133	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
MYI	01.2021	157	142	4	0	4	0,00
SCX	01.2021	9	8	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	158	142	3	0	3	0,00
				\$ 11	\$ 0	\$ 11	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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
BPS	01.2021	€ 5	\$ 6	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 236.834	€ 197.756	5.130	0	5.130	0,53
	02.2021	334.304	273.037	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01.2021	216.585	180.848	4.691	0	4.691	0,49
CBK	01.2021	€ 24	\$ 30	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	29	35	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 12.868	€ 10.740	274	0	274	0,03
SCX	01.2021	251.187	209.741	5.441	0	5.441	0,56
	02.2021	386.058	315.307	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 15.536	\$ (3)	\$ 15.533	1,61

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 3.567	£ 2.671	\$ 84	\$ 0	\$ 84	0,01
CBK	01.2021	59.750	44.698	1.352	0	1.352	0,14
HUS	01.2021	65.433	48.925	1.447	0	1.447	0,15
SSB	01.2021	69.632	52.166	1.678	0	1.678	0,18
				\$ 4.561	\$ 0	\$ 4.561	0,48

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	SGD 451	\$ 340	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	02.2021	\$ 340	SGD 451	1	0	1	0,00
BRC	01.2021	72	97	1	0	1	0,00
	02.2021	36	48	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	226	304	4	0	4	0,00
GLM	02.2021	SGD 1	\$ 1	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	1	1	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 48	SGD 64	1	0	1	0,00
	02.2021	68	91	1	0	1	0,00
MYI	01.2021	SGD 189	\$ 142	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$ 142	SGD 189	1	0	1	0,00
NGF	01.2021	SGD 464	\$ 348	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	\$ 225	SGD 302	3	0	3	0,00
	02.2021	348	464	3	0	3	0,00
SCX	01.2021	103	138	1	0	1	0,00
SSB	01.2021	70	94	1	0	1	0,00
	02.2021	8	11	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	SGD 2	\$ 2	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 81	SGD 108	1	0	1	0,00
	02.2021	20	27	0	0	0	0,00
				\$ 18	\$ (6)	\$ 12	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 15.225 1,58

Summe Anlagen

\$ 1.391.828 144,89

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (431.189) (44,89)

Nettovermögen

\$ 960.639 100,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income 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) 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
General Motors Co. 6,800 % fällig am 01.10.2027	07.05.2020	\$ 50	\$ 64	0,01
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	166	467	0,05
Noble Corp. PLC	23.12.2020	0	97	0,01
Westmoreland Mining Holdings LLC	26.03.2019	1	2	0,00
		\$ 217	\$ 630	0,07

Barmittel in Höhe von USD 19.519 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 7.120 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	250	6.383	0	6.633
<b>Summen</b>	<b>\$ 93.979</b>	<b>\$ 1.291.625</b>	<b>\$ 6.224</b>	<b>\$ 1.391.828</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 661	\$ 557.004	\$ 749	\$ 558.414
Investmentfonds	46.349	0	0	46.349
Pensionsgeschäfte	0	55.829	0	55.829
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(528)	6.286	0	5.758
<b>Summen</b>	<b>\$ 46.482</b>	<b>\$ 619.119</b>	<b>\$ 749</b>	<b>\$ 666.350</b>

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

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

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

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (12)	\$ 0	\$ (12)
BOA	(2.724)	2.300	(424)
BPS	5.380	(6.460)	(1.080)
BRC	4.816	(5.890)	(1.074)
BSS	5	0	5
CBK	2.077	(1.803)	274
GLM	(135)	0	(135)
GST	(44)	0	(44)
HUS	1.857	(1.630)	227

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
MEI	\$ 124	\$ 0	\$ 124
MYC	482	(590)	(108)
MYI	254	(280)	(26)
NGF	76	0	76
SCX	5.544	(6.780)	(1.236)
SSB	1.692	(1.400)	292
UAG	(4.167)	4.820	653

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	47,16	52,30
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	79,40	64,33
Sonstige übertragbare Wertpapiere	5,06	k. A.
Investmentfonds	9,71	9,68
Pensionsgeschäfte	2,87	11,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,03	(0,11)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,92)	(0,54)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,58	1,85

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	5,87	2,95
Unternehmensanleihen und Wechsel	40,25	39,48
Wandelanleihen & Wechsel	0,00	0,00
US-Regierungsbehörden	46,86	39,90
US-Schatzobligationen	3,82	4,75
Non-Agency-MBS	15,69	12,25
Forderungsbesicherte Wertpapiere	14,13	11,19
Staatsemissionen	2,93	2,70
Stammaktien	0,10	0,14
Optionsscheine	0,09	0,23
Real Estate Investment Trusts	0,00	k. A.
Kurzfristige Instrumente	1,88	3,04
Investmentfonds	9,71	9,68
Pensionsgeschäfte	2,87	11,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,03	(0,11)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,03	0,01
Zinsswaps	(0,98)	(0,55)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	0,00
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,02)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,02
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,08	0,10
Zinsswaps	0,00	0,24
Devisenterminkontrakte	(0,57)	(0,26)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	2,09	1,75
Sonstige Aktiva und Passiva	(44,89)	(39,17)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

BESCHREIBUNG ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE	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
<b>KANADA STAMMAKTIE</b>				ONEOK, Inc.	95.230	\$ 3.655	4,71	0,089 % fällig am 27.05.2021 (c)(d)(f)	\$ 1.600	\$ 1.599	2,06
Enbridge, Inc.	47.900	\$ 1.531	1,97	Rattler Midstream LP	61.000	578	0,74	0,092 % fällig am 02.03.2021 (a)(c)(d)	12.600	12.598	16,23
Pembina Pipeline Corp.	87.000	2.055	2,65	Targa Resources Corp.	62.100	1.638	2,11	0,094 % fällig am 21.01.2021 (c)(d)	12.600	12.600	16,23
TC Energy Corp.	38.620	1.569	2,02	Williams Cos., Inc.	153.400	3.076	3,96	0,101 % fällig am 26.01.2021 (c)(d)(f)	1.500	1.500	1,93
Summe Kanada		5.155	6,64	Summe USA		17.290	22,27	Summe kurzfristige Instrumente		56.796	73,16
<b>USA STAMMAKTIE ENERGIE</b>				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE U.S. TREASURY BILLS</b>							
Cheniere Energy, Inc. (b)	35.200	2.113	2,72	0,062 % fällig am 12.01.2021 (c)(d)	\$ 3.500	3.500	4,51				
Equitrans Midstream Corp.	258.238	2.076	2,67	0,071 % fällig am 21.01.2021 (c)(d)	2.000	2.000	2,57				
Hess Midstream LP 'A'	60.905	1.192	1,54	0,073 % fällig am 21.01.2021 (c)(d)	2.800	2.800	3,61				
Kinder Morgan, Inc.	216.700	2.962	3,82	0,078 % fällig am 14.01.2021 (c)(d)	5.700	5.700	7,34				
				0,079 % fällig am 14.01.2021 (c)(d)	1.100	1.100	1,42				
				0,083 % fällig am 28.01.2021 (c)(d)	4.200	4.200	5,41				
				0,084 % fällig am 01.04.2021 (c)(d)	7.600	7.599	9,79				
				0,089 % fällig am 01.04.2021 (c)(d)	1.600	1.600	2,06				
								Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 79.241	102,07
								<b>INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
								PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	32.623	325	0,42
								Summe Investmentfonds		\$ 325	0,42

## 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	Gezahlt/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettover- mögens
CBK	Zahlung	AMX Index	5.259	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 4.439	22.04.2021	\$ 0	\$ (167)	\$ (167)	(0,21)

### TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlt/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BOA	Zahlung	Energy Transfer LP	373.869	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 2.613	15.01.2021	\$ 0	\$ (303)	\$ (303)	(0,39)
	Zahlung	Western Midstream Partners LP	139.061	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.076	15.01.2021	0	(155)	(155)	(0,20)
	Zahlung	Energy Transfer LP	396.220	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.449	15.04.2021	0	(1)	(1)	0,00
	Zahlung	Holly Energy Partners LP	69.471	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	986	15.04.2021	0	0	0	0,00
	Zahlung	Crestwood Equity Partners LP	30.700	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	583	17.05.2021	0	0	0	0,00
	Zahlung	Enable Midstream Partners LP	60.214	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	317	17.05.2021	0	0	0	0,00
	Zahlung	Equitrans Midstream Co rp.	181.199	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.457	17.05.2021	0	(1)	(1)	0,00
	Zahlung	Holly Energy Partners LP	41.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	579	17.05.2021	0	4	4	0,00
	Zahlung	MPLX LP	58.491	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.266	17.05.2021	0	(1)	(1)	0,00
	Zahlung	Enterprise Products Partners LP	51.500	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.109	15.09.2021	0	(101)	(101)	(0,13)
	Zahlung	Enterprise Products Partners LP	269.170	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.798	15.11.2021	0	(527)	(527)	(0,68)
	Zahlung	Genesis Energy LP	184.700	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.388	15.11.2021	0	(241)	(241)	(0,31)
	Zahlung	MPLX LP	240.909	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.589	15.11.2021	0	(375)	(375)	(0,48)
CBK	Zahlung	Plains All American Pipeline LP	264.156	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.351	15.11.2021	0	(175)	(175)	(0,23)
	Zahlung	DCP Midstream LP	159.800	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	3.223	16.02.2021	0	(263)	(263)	(0,34)
GST	Zahlung	Cheniere Energy Partners LP	52.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.833	17.05.2021	0	(1)	(1)	0,00
	Zahlung	Enable Midstream Partners LP	53.412	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	306	17.05.2021	0	(25)	(25)	(0,03)
MYI	Zahlung	Plains All American Pipeline LP	296.900	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.642	15.01.2021	0	(196)	(196)	(0,25)
	Zahlung	Crestwood Equity Partners LP	83.200	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.614	16.02.2021	0	(35)	(35)	(0,05)
	Zahlung	NuStar Energy LP	112.889	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.627	15.04.2021	0	(1)	(1)	0,00
	Zahlung	Western Midstream Partners LP	163.489	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.259	15.04.2021	0	(1)	(1)	0,00
	Zahlung	Magellan Midstream Partners LP	31.795	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.349	17.05.2021	0	(1)	(1)	0,00
	Zahlung	Cheniere Energy Partners LP	4.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	147	15.11.2021	0	(6)	(6)	(0,01)

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
	Zahlung	Crestwood Equity Partners LP	43.300	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 840	15.11.2021	\$ 0	\$ (18)	\$ (18)	(0,02)	
	Zahlung	Enable Midstream Partners LP	238.074	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.364	15.11.2021	0	(112)	(112)	(0,14)	
	Zahlung	Magellan Midstream Partners LP	14.305	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	659	15.11.2021	0	(52)	(52)	(0,07)	
	Zahlung	NuStar Energy LP	94.290	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.517	15.11.2021	0	(159)	(159)	(0,20)	
	Zahlung	Phillips 66 Partners LP	78.600	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.349	15.11.2021	0	(273)	(273)	(0,35)	
	Zahlung	Sunoco LP	59.900	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.784	15.11.2021	0	(60)	(60)	(0,08)	
	Zahlung	Western Midstream Partners LP	65.932	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	984	15.11.2021	0	(73)	(73)	(0,10)	
								\$ 0	\$ (3.152)	\$ (3.152)	(4,06)

## DEVISETERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	\$ 352	CAD 455	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,01
BPS	01.2021	£ 115	£ 86	3	0	3	0,00
HUS	01.2021	860	CAD 1.101	4	0	4	0,01
MYI	01.2021	€ 8	\$ 10	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 597	€ 486	0	(3)	(3)	(0,01)
	01.2021	3	£ 2	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	CAD 8.224	\$ 6.348	0	(108)	(108)	(0,14)
	01.2021	\$ 6.455	CAD 8.224	0	0	0	0,00
	02.2021	CAD 8.224	\$ 6.456	0	0	0	0,00
				\$ 13	\$ (111)	\$ (98)	(0,13)

## ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Investor 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	01.2021	€ 507	\$ 623	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BPS	01.2021	212	£ 258	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 4.414	€ 3.671	79	0	79	0,10
BRC	01.2021	15	£ 12	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	€ 400	\$ 483	0	(5)	(5)	(0,01)
	01.2021	\$ 85	€ 71	2	0	2	0,00
HUS	01.2021	€ 191	\$ 233	1	(1)	0	0,00
	01.2021	\$ 1.060	€ 876	12	0	12	0,02
JPM	01.2021	€ 363	\$ 443	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2021	196	£ 239	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2021	83	£ 102	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 4.078	€ 3.405	87	0	87	0,11
	02.2021	6.548	£ 5.348	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	3.845	£ 3.210	83	0	83	0,11
	02.2021	5.048	£ 4.123	0	0	0	0,00
				\$ 266	\$ (9)	\$ 257	0,33

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	£ 20	\$ 26	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2021	\$ 24	£ 18	1	0	1	0,00
BRC	01.2021	78	£ 58	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	£ 35	\$ 47	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 420	£ 314	9	0	9	0,01
HUS	01.2021	£ 66	\$ 88	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 523	£ 391	12	0	12	0,01
MYI	01.2021	1	£ 1	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	£ 46	\$ 62	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 63	£ 47	2	0	2	0,00
SSB	01.2021	495	£ 371	12	0	12	0,02
				\$ 37	\$ (5)	\$ 32	0,04

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (3.128) (4,03)

Summe Anlagen

\$ 76.438 98,46

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 1.193 1,54

Nettovermögen

\$ 77.631 100,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO MLP & Energy Infrastructure 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

- (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) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivative Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.051 und Barmittel in Höhe von USD 440 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	0	(3.128)	0	(3.128)
<b>Summen</b>	<b>\$ 22.770</b>	<b>\$ 53.668</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 76.438</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 64.667	\$ 149.945	\$ 0	\$ 214.612
Investmentfonds	22.045	0	0	22.045
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	2.752	0	2.752
<b>Summen</b>	<b>\$ 86.712</b>	<b>\$ 152.697</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 239.409</b>

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

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

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

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (1.868)	\$ 1.730	\$ (138)
BPS	81	0	81
BRC	1	0	1
CBK	(426)	321	(105)
GST	(25)	0	(25)
HUS	26	0	26
JPM	(1)	0	(1)
MYI	(991)	440	(551)
SCX	88	0	88
SSB	12	0	12
TOR	(25)	0	(25)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	28,91	57,53
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	73,16	32,57
Investmentfonds	0,42	9,26
Freiverkehrsfinanzderivate	(4,03)	1,16

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kanada	6,64	8,25
Frankreich	k. A.	1,44
Großbritannien	k. A.	1,40
USA	22,27	18,90
Kurzfristige Instrumente	73,16	60,11
Investmentfonds	0,42	9,26
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	(0,21)	k. A.
Total Return Swaps auf Wertpapiere	(4,06)	0,92
Devisenterminkontrakte	(0,13)	(0,27)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,37	0,51
Sonstige Aktiva und Passiva	1,54	(0,52)
Nettovermögen	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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>											
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>											
Santander UK Group Holdings PLC				6,452 % fällig am 25.09.2040 - 25.06.2041 (a)	\$ 5.395	\$ 603	0,03	6,541 % fällig am 15.09.2026 - 15.12.2042 (a)	\$ 5.078	\$ 1.061	0,05
6,750 % fällig am 24.06.2024 (e)(g)	£ 2.600	\$ 3.871	0,20	6,500 % fällig am 25.12.2034 (a)	2.322	439	0,02	6,571 % fällig am 15.09.2039 (a)	4.316	941	0,05
U.S. Capital Funding Ltd.				6,502 % fällig am 25.05.2034 - 25.03.2039 (a)	3.122	210	0,01	6,691 % fällig am 15.03.2038 (a)	642	122	0,01
0,504 % fällig am 10.07.2043	\$ 17.369	15.111	0,76	6,552 % fällig am 25.07.2026 (a)	5.288	300	0,02	7,422 % fällig am 15.07.2043	559	587	0,03
		18.982	0,96	6,652 % fällig am 25.12.2032 (a)	885	179	0,01	7,610 % fällig am 15.01.2041	1.357	1.425	0,07
				6,952 % fällig am 25.11.2033 - 25.10.2034 (a)	1.416	245	0,01	7,619 % fällig am 15.12.2043	331	357	0,02
				7,260 % fällig am 25.08.2033	396	461	0,02	7,741 % fällig am 15.12.2031 (a)	98	21	0,00
				7,327 % fällig am 25.08.2033	140	161	0,01	8,283 % fällig am 15.06.2037 - 15.06.2044	4.360	5.594	0,28
				7,452 % fällig am 25.11.2033 (a)	83	17	0,00	8,783 % fällig am 15.05.2041	767	925	0,05
				7,500 % fällig am 25.04.2042	629	742	0,04	9,067 % fällig am 15.12.2043	1.480	1.787	0,09
				7,604 % fällig am 25.10.2043	575	622	0,03	10,545 % fällig am 15.01.2041	1.068	1.433	0,07
				7,750 % fällig am 25.11.2042	190	222	0,01	11,321 % fällig am 15.08.2043	178	242	0,01
				8,972 % fällig am 25.11.2042	822	1.001	0,05	11,594 % fällig am 15.09.2032	480	619	0,03
				8,988 % fällig am 25.05.2043	225	232	0,01	13,036 % fällig am 15.03.2041	210	303	0,02
				11,321 % fällig am 25.08.2043	97	122	0,01	13,105 % fällig am 15.05.2041	1.425	2.096	0,11
				13,613 % fällig am 25.07.2023	254	276	0,01	Ginnie Mae			
				0,000 % fällig am 01.02.2035 - 15.10.2058 (b)(c)	77.413	69.754	3,53	0,000 % fällig am 20.08.2033 - 20.01.2044 (b)(c)	6.331	6.198	0,31
				0,412 % fällig am 25.08.2024 (a)	63.089	777	0,04	1,018 % fällig am 20.03.2058	289	292	0,02
				1,648 % fällig am 25.08.2050	3.542	3.554	0,18	1,050 % fällig am 20.01.2066	121	123	0,01
				2,483 % fällig am 15.09.2042	1.604	1.520	0,08	2,000 % fällig am 16.05.2041	2.612	2.631	0,13
				2,499 % fällig am 15.07.2042	18.732	959	0,05	2,068 % fällig am 20.08.2047 (a)	8.536	392	0,02
				2,500 % fällig am 15.11.2027 - 25.09.2050 (a)	24.652	1.587	0,08	2,102 % fällig am 20.06.2046 (a)	11.510	549	0,03
				2,594 % fällig am 15.10.2032	148	152	0,01	2,128 % fällig am 20.05.2047 (a)	14.115	669	0,03
				2,663 % fällig am 15.01.2038 (a)	385	23	0,00	2,131 % fällig am 20.11.2046 (a)	9.265	397	0,02
				2,920 % fällig am 01.09.2036	1.542	1.668	0,08	2,243 % fällig am 20.01.2047 (a)	9.030	391	0,02
				3,000 % fällig am 15.12.2027 - 25.07.2050 (a)	65.877	6.668	0,34	2,265 % fällig am 20.07.2046 (a)	9.474	473	0,02
				3,000 % fällig am 15.12.2046 - 15.04.2049 (a)	1.702	190	0,01	2,276 % fällig am 20.10.2046 (a)	9.141	406	0,02
				3,314 % fällig am 15.12.2027 (a)	1.513	94	0,01	2,293 % fällig am 20.07.2041 (a)	2.270	109	0,01
				3,439 % fällig am 25.09.2024	6.100	5.582	0,28	2,306 % fällig am 20.05.2040 (a)	7.812	343	0,02
				3,500 % fällig am 15.03.2029 - 25.07.2050 (a)	31.892	3.312	0,17	2,307 % fällig am 20.11.2046 (a)	13.527	721	0,04
				3,500 % fällig am 01.01.2038 - 01.12.2046	4.950	5.169	0,26	2,358 % fällig am 20.06.2043 (a)	2.556	118	0,01
				3,898 % fällig am 25.08.2050	2.000	2.038	0,10	2,376 % fällig am 20.06.2042 (a)	2.953	143	0,01
				4,000 % fällig am 15.10.2041 - 25.07.2050 (a)	37.476	5.148	0,26	2,426 % fällig am 20.06.2042 (a)	2.720	131	0,01
				4,000 % fällig am 15.01.2043 - 15.05.2048	38.639	41.846	2,12	2,480 % fällig am 20.04.2043 (a)	12.416	621	0,03
				4,171 % fällig am 15.11.2048 (a)	47.047	4.864	0,25	2,500 % fällig am 20.09.2027 (a)	8.493	459	0,02
				4,341 % fällig am 15.08.2040 (a)	3.218	396	0,02	2,500 % fällig am 20.12.2050	7.980	8.458	0,43
				4,414 % fällig am 15.12.2048	6.988	7.229	0,37	3,000 % fällig am 20.12.2047 - 20.08.2050	31.486	33.094	1,67
				4,500 % fällig am 15.02.2037 - 25.06.2050 (a)	10.200	1.240	0,06	3,000 % fällig am 20.12.2049 (a)	12.134	1.293	0,07
				4,500 % fällig am 15.08.2043 - 01.02.2048	2.419	2.687	0,14	3,250 % fällig am 20.01.2047	1.200	1.275	0,07
				4,841 % fällig am 15.04.2042 (a)	2.687	374	0,02	3,500 % fällig am 20.09.2029 - 20.09.2046 (a)	2.202	276	0,01
				5,000 % fällig am 15.05.2025 - 25.05.2048 (a)	4.557	558	0,03	3,500 % fällig am 20.03.2042 - 20.02.2048	13.380	15.013	0,76
				5,000 % fällig am 15.10.2042 - 01.03.2049	8.228	9.250	0,47	4,000 % fällig am 20.03.2047 - 15.08.2048	11.701	12.713	0,64
				5,274 % fällig am 15.11.2032	31	32	0,00	4,500 % fällig am 20.05.2043 - 20.09.2047 (a)	3.721	748	0,04
				5,691 % fällig am 15.02.2041 (a)	441	88	0,00	4,500 % fällig am 20.04.2048 - 20.02.2049	6.651	7.150	0,36
				5,731 % fällig am 15.09.2043 (a)	1.487	331	0,02	5,000 % fällig am 20.09.2040 - 20.11.2048	3.738	2.963	0,15
				5,762 % fällig am 15.05.2043	111	118	0,01	5,398 % fällig am 20.09.2043 (a)	1.933	258	0,01
				5,791 % fällig am 15.07.2041 (a)	4.881	716	0,04	5,568 % fällig am 20.09.2045 (a)	4.399	766	0,04
				5,841 % fällig am 15.10.2041 - 15.08.2042 (a)	21.814	4.084	0,21	5,897 % fällig am 16.04.2040 - 16.08.2042 (a)	3.344	649	0,03
				5,891 % fällig am 15.08.2041 - 15.09.2044 (a)	14.589	2.666	0,14	5,898 % fällig am 20.11.2049 (a)	10.109	1.275	0,07
				5,902 % fällig am 25.11.2049 - 25.06.2050 (a)	48.178	8.358	0,42	5,948 % fällig am 20.01.2035 - 20.08.2049 (a)	27.063	3.795	0,19
				5,941 % fällig am 15.02.2044 (a)	425	57	0,00	6,000 % fällig am 20.02.2047	32	37	0,00
				5,952 % fällig am 25.06.2050 (a)	18.539	3.637	0,18	6,048 % fällig am 20.03.2035 - 20.09.2048 (a)	6.109	912	0,05
				5,991 % fällig am 15.08.2025 - 15.10.2048 (a)	36.951	4.603	0,23	6,098 % fällig am 20.07.2044 (a)	2.278	819	0,04
				6,002 % fällig am 25.05.2050 (a)	5.237	1.001	0,05	6,247 % fällig am 16.01.2038 (a)	65	6	0,00
				6,041 % fällig am 15.03.2048 (a)	8.798	1.266	0,06	6,297 % fällig am 16.02.2040 (a)	2.938	520	0,03
				6,091 % fällig am 15.09.2042 (a)	1.585	295	0,02	6,548 % fällig am 20.05.2041 (a)	2.533	428	0,02
				6,141 % fällig am 15.10.2036 (a)	1.907	361	0,02	13,500 % fällig am 20.11.2045	534	1.021	0,05
				6,311 % fällig am 15.11.2037 (a)	350	67	0,00	Ginnie Mae, TBA			
				6,331 % fällig am 15.01.2042 (a)	11.806	2.247	0,11	2,000 % fällig am 01.03.2051	105.800	110.297	5,58
				6,341 % fällig am 15.01.2039 (a)	147	2	0,00	2,500 % fällig am 01.03.2051	42.550	44.879	2,27
				6,441 % fällig am 15.07.2023 - 15.11.2041 (a)	324	41	0,00	3,000 % fällig am 01.03.2051	99.800	104.431	5,28
				6,491 % fällig am 15.07.2026 (a)	2.033	215	0,01	4,000 % fällig am 01.01.2051	45.500	48.517	2,45
								Uniform Mortgage-Backed Security			
								2,500 % fällig am 01.01.2033 - 01.11.2050	40.076	42.614	2,16
								2,950 % fällig am 01.02.2030	4.936	5.509	0,28
								3,000 % fällig am 01.01.2038 - 01.04.2059	168.184	179.492	9,08
								3,270 % fällig am 01.12.2027	5.680	6.328	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
3,500 % fällig am 01.02.2030 - 01.10.2050	\$ 123.791	\$ 132.546	6,70	CIM Trust	\$ 8.583	\$ 8.606	0,44	Asset Securitization Corp. Trust	\$ 1.100	\$ 1.062	0,05
3,510 % fällig am 01.03.2029	1.153	1.283	0,07	3,015 % fällig am 25.06.2057				1,108 % fällig am 25.07.2035			
3,513 % fällig am 01.08.2049	2.714	2.827	0,14	Citigroup Commercial Mortgage Trust	750	722	0,04	IndyMac Mortgage Loan Trust	4.244	3.462	0,17
3,598 % fällig am 01.12.2048	2.657	2.776	0,14	1,259 % fällig am 15.07.2030				2,960 % fällig am 25.12.2035 ^	521	462	0,02
3,870 % fällig am 01.07.2027	1.600	1.849	0,09	Citigroup Mortgage Loan Trust	2.380	2.403	0,12	2,964 % fällig am 25.12.2035			
4,000 % fällig am 01.02.2037 - 01.08.2049	44.980	48.866	2,47	6,000 % fällig am 25.12.2035				JPMorgan Alternative Loan Trust	6.870	6.267	0,32
4,050 % fällig am 01.12.2028	1.950	2.305	0,12	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.	30	31	0,00	0,468 % fällig am 25.11.2036 ^			
4,500 % fällig am 01.12.2038 - 01.04.2059	15.186	17.127	0,87	3,007 % fällig am 25.08.2035				JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.	4.100	3.795	0,19
5,000 % fällig am 01.06.2048 - 01.03.2049	3.007	3.384	0,17	CitiMortgage Alternative Loan Trust	2.250	1.811	0,09	2,299 % fällig am 15.10.2032			
5,620 % fällig am 01.06.2041	496	568	0,03	0,698 % fällig am 25.01.2037				JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust	5.789	5.308	0,27
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA	27.500	28.255	1,43	6,000 % fällig am 25.11.2036				5,337 % fällig am 15.05.2047	1.337	1.345	0,07
1,500 % fällig am 01.02.2036				Countrywide Alternative Loan Trust	451	413	0,02	6,169 % fällig am 12.02.2051			
2,000 % fällig am 01.01.2036 - 01.03.2051	730.500	760.246	38,45	0,308 % fällig am 25.02.2047				JPMorgan Resecuritization Trust			
2,500 % fällig am 01.01.2036 - 01.03.2051	332.950	349.778	17,69	0,308 % fällig am 25.09.2047				5,519 % fällig am 26.09.2037	1.471	1.147	0,06
3,000 % fällig am 01.01.2036 - 01.02.2051	103.327	108.444	5,49	0,428 % fällig am 25.10.2046	3.413	3.257	0,16	5,750 % fällig am 26.04.2037	1.302	957	0,05
3,500 % fällig am 01.01.2036	25.000	26.512	1,34	0,572 % fällig am 20.03.2046	751	632	0,03	Lehman Mortgage Trust			
4,000 % fällig am 01.01.2036 - 01.01.2051	86.750	92.382	4,67	0,572 % fällig am 20.05.2046 ^	2.608	2.185	0,11	6,000 % fällig am 25.12.2036	2.304	2.298	0,12
4,500 % fällig am 01.01.2051	33.000	35.769	1,81	0,788 % fällig am 25.11.2035	5.200	4.541	0,23	Lehman XS Trust	8.870	7.931	0,40
		2.596.713	131,35	0,848 % fällig am 25.09.2035	2.744	2.548	0,13	0,388 % fällig am 25.06.2047			
				1,549 % fällig am 25.06.2046	2.750	2.418	0,12	MASTR Asset Securitization Trust			
				1,609 % fällig am 25.12.2035	1.996	1.881	0,09	6,000 % fällig am 25.10.2036	987	986	0,05
				1,989 % fällig am 25.11.2047 ^	4.779	4.195	0,21	MASTR Reperforming Loan Trust			
				5,500 % fällig am 25.06.2035	209	207	0,01	7,000 % fällig am 25.07.2035	1.535	1.418	0,07
				5,500 % fällig am 25.05.2036	3.131	2.851	0,14	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
				5,500 % fällig am 25.10.2035	1.672	1.573	0,08	6,250 % fällig am 25.08.2036	4.898	3.176	0,16
				5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	2.098	1.650	0,08	ML-CFC Commercial Mortgage Trust			
				5,500 % fällig am 25.12.2035	349	324	0,02	5,324 % fällig am 12.12.2049	1.330	818	0,04
				6,000 % fällig am 25.05.2036	4.510	3.565	0,18	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
				6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	1.679	1.034	0,05	5,500 % fällig am 25.11.2035	1.474	1.312	0,07
				6,250 % fällig am 25.05.2036	382	303	0,02	6,000 % fällig am 25.10.2037	7.503	5.659	0,29
				6,250 % fällig am 25.09.2037	694	600	0,03	Mortgage Equity Conversion Asset Trust			
								0,560 % fällig am 25.02.2042	1.335	1.320	0,07
								Motel 6 Trust			
								2,309 % fällig am 15.08.2034	241	239	0,01
								MSCG Trust			
								1,239 % fällig am 15.10.2037	3.400	3.402	0,17
								Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust			
								2,633 % fällig am 25.10.2035	1.263	1.248	0,06
								6,017 % fällig am 25.06.2037	1.705	1.703	0,09
								Nomura Resecuritization Trust			
								0,347 % fällig am 26.11.2036	2.686	2.266	0,11
								Ready Capital Mortgage Financing LLC			
								2,298 % fällig am 25.02.2035	7.800	7.859	0,40
								Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
								0,448 % fällig am 25.08.2036	1.382	1.044	0,05
								3,491 % fällig am 25.12.2035	1.443	861	0,04
								6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	254	249	0,01
								6,250 % fällig am 25.01.2037 ^	1.684	1.630	0,08
								Residential Asset Securitization Trust			
								0,598 % fällig am 25.03.2035	2.420	1.838	0,09
								0,618 % fällig am 25.10.2035	3.151	2.206	0,11
								6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	3.059	1.291	0,07
								Residential Mortgage Securities PLC			
								0,837 % fällig am 20.03.2050	£ 1.556	2.127	0,11
								RMAC PLC			
								1,011 % fällig am 12.06.2046	3.307	4.520	0,23
								Seasoned Loans Structured Transaction Trust			
								2,750 % fällig am 25.11.2029	\$ 19.420	20.556	1,04
								Sestante Finance SRL			
								0,000 % fällig am 23.07.2046	€ 1.155	1.286	0,07
								Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
								0,368 % fällig am 25.06.2037	\$ 551	522	0,03
								0,448 % fällig am 25.02.2037	914	881	0,04
								2,557 % fällig am 25.12.2034	3.083	3.203	0,16
								2,977 % fällig am 25.05.2035	1.475	1.223	0,06
								3,080 % fällig am 25.02.2034	16	16	0,00
								3,224 % fällig am 25.07.2035	2.097	1.399	0,07
								Structured Asset Mortgage Investments Trust			
								0,368 % fällig am 25.09.2047	5.001	4.457	0,23
								0,688 % fällig am 25.08.2035	744	771	0,04
								1,277 % fällig am 19.12.2033	790	738	0,04
								Structured Asset Securities Corp.			
								0,398 % fällig am 25.07.2035	1.891	1.740	0,09
								Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
								0,398 % fällig am 25.05.2036	2.720	2.160	0,11

# 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
Sutherland Commercial Mortgage Loans 3,192 % fällig am 25.05.2037	\$ 615	\$ 612	0,03	Capitalsource Real Estate Loan Trust 0,663 % fällig am 20.01.2037	\$ 58	\$ 58	0,00	Galaxy CLO Ltd. 1,437 % fällig am 15.10.2030	\$ 10.900	\$ 10.900	0,55
Twin Bridges PLC 0,821 % fällig am 12.09.2044	£ 3.564	4.864	0,25	0,923 % fällig am 20.01.2037	950	921	0,05	Goodgreen Trust 3,930 % fällig am 15.10.2053	4.855	5.190	0,26
0,921 % fällig am 12.09.2050	3.688	5.035	0,25	1,023 % fällig am 20.01.2037	350	336	0,02	GSAA Home Equity Trust 0,378 % fällig am 25.04.2047	5.064	3.049	0,15
UBS Commercial Mortgage Trust 4,241 % fällig am 15.06.2051	\$ 1.700	2.008	0,10	1,123 % fällig am 20.01.2037	200	192	0,01	0,868 % fällig am 25.10.2035	1.922	1.748	0,09
Uropa Securities PLC 0,296 % fällig am 10.10.2040	£ 86	109	0,01	Castelake Aircraft Securitization Trust 4,125 % fällig am 15.06.2043	4.688	4.479	0,23	GSAMP Trust 0,418 % fällig am 25.03.2047	1.208	1.139	0,06
0,396 % fällig am 10.10.2040	43	54	0,00	CBAM CLO Ltd. 1,238 % fällig am 17.04.2031	1.500	1.493	0,08	1,033 % fällig am 25.07.2045 ^	3.976	3.567	0,18
Verus Securitization Trust 1,977 % fällig am 25.03.2060	\$ 1.448	1.471	0,07	1,458 % fällig am 17.10.2029	4.200	4.198	0,21	Harley Marine Financing LLC 5,682 % fällig am 15.05.2043	1.559	1.325	0,07
3,035 % fällig am 25.03.2060	200	206	0,01	Centex Home Equity Loan Trust 0,468 % fällig am 25.06.2036	1.300	1.248	0,06	Harvest CLO DAC 0,630 % fällig am 18.11.2029	€ 199	243	0,01
3,889 % fällig am 25.03.2060	400	422	0,02	CIT Mortgage Loan Trust 1,598 % fällig am 25.10.2037 ^	2.948	2.969	0,15	Hayfin Emerald CLO DAC 1,450 % fällig am 15.02.2033	2.200	2.704	0,14
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 5,653 % fällig am 15.02.2051	797	611	0,03	1,648 % fällig am 25.10.2037	880	878	0,04	Holland Park CLO DAC 0,920 % fällig am 14.11.2032	1.700	2.068	0,10
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 1,379 % fällig am 25.04.2047 ^	98	86	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust 0,308 % fällig am 25.12.2036	4.337	3.029	0,15	Home Equity Asset Trust 0,308 % fällig am 25.08.2036	\$ 4.639	4.598	0,23
1,569 % fällig am 25.09.2046	1.412	1.293	0,07	0,548 % fällig am 25.03.2037	4.501	4.481	0,23	0,598 % fällig am 25.02.2036	1.400	1.349	0,07
1,753 % fällig am 25.01.2047	1.053	1.017	0,05	Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,123 % fällig am 25.05.2035	1.279	1.243	0,06	1,438 % fällig am 25.08.2033	552	551	0,03
2,003 % fällig am 25.11.2046	402	381	0,02	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 0,428 % fällig am 25.11.2036	1.271	1.267	0,06	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 0,388 % fällig am 25.08.2036	7.500	6.471	0,33
2,722 % fällig am 25.12.2036 ^	3.318	3.295	0,17	Columbia Cent CLO Ltd. 1,365 % fällig am 25.10.2028	5.000	4.995	0,25	0,388 % fällig am 25.04.2037	8.249	6.336	0,32
3,139 % fällig am 25.06.2037 ^	4.692	4.431	0,22	Conseco Finance Corp. 6,920 % fällig am 01.12.2030	4.414	4.699	0,24	1,393 % fällig am 25.03.2035	2.900	2.875	0,15
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 1,599 % fällig am 25.06.2046	2.629	2.255	0,11	Contego CLO BV 0,397 % fällig am 15.11.2026	€ 5.403	6.558	0,33	HSI Asset Securitization Corp. Trust 0,398 % fällig am 25.05.2037	4.600	4.416	0,22
		364.405	18,43	Cork Street CLO Designated Activity Co. 0,590 % fällig am 27.11.2028	4.445	5.442	0,28	Jamestown CLO Ltd. 1,438 % fällig am 17.01.2027	363	363	0,02
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Countrywide Asset-Backed Certificates 0,298 % fällig am 25.04.2047 ^	\$ 547	533	0,03	JPMorgan Mortgage Acquisition Corp. 0,688 % fällig am 25.03.2036	6.153	5.609	0,28
522 Funding CLO Ltd. 1,468 % fällig am 20.10.2029	4.000	3.998	0,20	0,298 % fällig am 25.06.2047 ^	448	444	0,02	0,793 % fällig am 25.10.2035	4.900	4.351	0,22
Aames Mortgage Investment Trust 0,708 % fällig am 25.04.2036	1.756	1.762	0,09	0,338 % fällig am 25.11.2037	768	763	0,04	1,168 % fällig am 25.07.2035	1.633	1.636	0,08
AccessLex Institute 0,507 % fällig am 25.05.2036	3.270	3.190	0,16	0,368 % fällig am 25.09.2037 ^	4.014	3.846	0,19	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,268 % fällig am 25.12.2036	7.168	4.652	0,24
Accredited Mortgage Loan Trust 0,728 % fällig am 25.09.2035	4.200	4.018	0,20	0,368 % fällig am 25.09.2047 ^	1.882	1.785	0,09	0,388 % fällig am 25.11.2036	266	240	0,01
1,168 % fällig am 25.07.2035	2.150	2.083	0,11	0,378 % fällig am 25.05.2037	5.600	4.985	0,25	0,418 % fällig am 25.07.2036	9.337	8.974	0,45
Aegis Asset-Backed Securities Trust 1,148 % fällig am 25.03.2035 ^	100	98	0,01	0,398 % fällig am 25.01.2046 ^	7.093	6.676	0,34	Jubilee CLO BV 0,334 % fällig am 12.07.2028	€ 471	572	0,03
AlbaCore EURO CLO DAC 1,530 % fällig am 18.07.2031	€ 500	616	0,03	0,673 % fällig am 25.04.2036	151	151	0,01	LCM LP 1,258 % fällig am 20.10.2027	\$ 1.000	1.000	0,05
Ameriquest Mortgage Securities Trust 0,528 % fällig am 25.04.2036	\$ 6.350	5.490	0,28	0,848 % fällig am 25.03.2036 ^	2.113	1.979	0,10	man XS Trust 0,358 % fällig am 25.06.2046	5.705	5.697	0,29
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 0,898 % fällig am 25.09.2035	483	483	0,02	1,123 % fällig am 25.01.2036	100	101	0,01	0,488 % fällig am 25.12.2036	363	515	0,03
1,243 % fällig am 25.09.2034	3.079	2.943	0,15	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 0,298 % fällig am 25.03.2047 ^	7.623	7.498	0,38	Long Beach Mortgage Loan Trust 0,748 % fällig am 25.02.2036	171	149	0,01
Argent Mortgage Loan Trust 0,628 % fällig am 25.05.2035	3.337	3.081	0,16	0,778 % fällig am 25.08.2035	88	88	0,00	M360 Advisors LLC 6,121 % fällig am 24.07.2028	8.777	8.820	0,45
Argent Securities Trust 0,298 % fällig am 25.07.2036	6.573	5.826	0,29	5,633 % fällig am 25.06.2035	92	96	0,00	Mackay Shields Euro CLO DAC 1,550 % fällig am 15.08.2033	€ 500	616	0,03
0,528 % fällig am 25.03.2036	5.915	5.492	0,28	5,859 % fällig am 25.10.2046 ^	36	36	0,00	MAPS Ltd. 4,212 % fällig am 15.05.2043	\$ 3.180	3.046	0,15
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,368 % fällig am 25.12.2036	4.731	4.199	0,21	Countrywide Revolving Home Equity Loan Trust 0,389 % fällig am 15.02.2036	3.227	3.047	0,15	MASTR Asset-Backed Securities Trust 0,718 % fällig am 25.01.2036	5.038	4.961	0,25
1,378 % fällig am 25.02.2035	946	904	0,05	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 0,448 % fällig am 25.05.2036	2.814	2.294	0,12	0,728 % fällig am 25.12.2035	991	986	0,05
Attentus CDO Ltd. 0,674 % fällig am 11.10.2042	10.621	8.603	0,44	0,928 % fällig am 25.03.2034	488	483	0,02	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 0,748 % fällig am 25.12.2036	3.700	3.417	0,17
Bavarian Sky S.A. 0,000 % fällig am 20.10.2024	€ 5	6	0,00	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust 3,831 % fällig am 25.02.2037	3.807	3.149	0,16	1,228 % fällig am 25.10.2035	969	964	0,05
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 0,388 % fällig am 25.07.2036	\$ 1.700	1.660	0,08	Dartry Park CLO DAC 0,830 % fällig am 28.04.2029	€ 2.874	3.521	0,18	MidOcean Credit CLO LLC 1,037 % fällig am 15.04.2027	5.432	5.420	0,27
0,688 % fällig am 25.04.2036	3.665	3.635	0,18	Denali Capital CLO LLC 1,265 % fällig am 26.10.2027	\$ 3.242	3.241	0,16	Monarch Grove CLO Ltd. 1,095 % fällig am 25.01.2028	2.071	2.056	0,10
1,198 % fällig am 25.08.2037	11.515	10.542	0,53	Dorchester Park CLO DAC 1,118 % fällig am 20.04.2028	6.780	6.769	0,34	Monroe Capital BSL CLO Ltd. 1,333 % fällig am 22.05.2027	421	421	0,02
1,228 % fällig am 25.12.2035	1.677	1.272	0,06	Driver Australia Four Trust 0,960 % fällig am 21.08.2025	AUD 159	123	0,01	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,288 % fällig am 25.10.2036	1.226	753	0,04
1,348 % fällig am 25.01.2045	174	175	0,01	ECMC Group Student Loan Trust 1,198 % fällig am 25.05.2067	\$ 1.297	1.304	0,07	0,398 % fällig am 25.07.2036	14.269	12.768	0,65
2,023 % fällig am 25.07.2034	363	369	0,02	Evans Grove CLO Ltd. 1,144 % fällig am 28.05.2028	11.177	11.128	0,56	0,448 % fällig am 25.07.2036	4.044	2.183	0,11
Benefit Street Partners CLO Ltd. 0,998 % fällig am 18.07.2027	227	226	0,01	First Franklin Mortgage Loan Trust 0,308 % fällig am 25.11.2036	7.906	7.718	0,39	0,648 % fällig am 25.07.2036	4.044	2.239	0,11
BSPRT Issuer Ltd. 1,209 % fällig am 15.03.2028	2.336	2.331	0,12	0,458 % fällig am 25.09.2036	7.465	6.463	0,33	0,718 % fällig am 25.12.2035	6.879	6.068	0,31
2,275 % fällig am 15.03.2028	2.140	2.083	0,11	0,808 % fällig am 25.01.2036	1.550	1.526	0,08	Morgan Stanley Capital, Inc. Trust 0,728 % fällig am 25.01.2036	3.425	3.360	0,17
3,625 % fällig am 15.03.2028	965	925	0,05	Fremont Home Loan Trust 0,428 % fällig am 25.02.2037	8.064	6.437	0,33	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 0,248 % fällig am 25.04.2037	176	117	0,01
Cairn CLO BV 0,650 % fällig am 20.10.2028	€ 2.862	3.500	0,18	1,078 % fällig am 25.07.2035	4.000	3.597	0,18				
0,790 % fällig am 25.07.2029	2.231	2.729	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
National Collegiate Student Loan Trust				0,928 % fällig am 25.06.2034	\$ 364	\$341	0,02	TICP CLO Ltd.			
0,458 % fällig am 25.05.2032	\$ 5.113	\$ 4.904	0,25	1,093 % fällig am 25.05.2035	862	858	0,04	1,018 % fällig am 20.07.2027	\$ 746	\$ 744	0,04
Navent Private Education Loan Trust				Sapphire Aviation Finance Ltd.				1,058 % fällig am 20.04.2028	12.146	12.081	0,61
2,650 % fällig am 15.12.2028	237	241	0,01	4,250 % fällig am 15.03.2040	8.472	8.241	0,42	Tralee CLO Ltd.			
2,740 % fällig am 15.02.2029	32	33	0,00	Saxon Asset Securities Trust				1,328 % fällig am 20.10.2028	5.000	5.000	0,25
Neuberger Berman CLO Ltd.				0,808 % fällig am 25.11.2037	663	662	0,03	TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
1,037 % fällig am 15.07.2027	1.882	1.875	0,09	SLC Student Loan Trust				1,809 % fällig am 20.09.2039	4.358	4.183	0,21
NovaStar Mortgage Funding Trust				0,327 % fällig am 15.03.2027	836	832	0,04	Vendome Funding CLO DAC			
1,318 % fällig am 25.06.2035	2.000	1.940	0,10	SLM Private Credit Student Loan Trust				1,860 % fällig am 20.07.2031	€ 2.900	3.557	0,18
OCP CLO Ltd.				0,487 % fällig am 15.12.2039	2.772	2.657	0,13	Venture CLO Ltd.			
1,037 % fällig am 15.07.2027	547	545	0,03	SLM Student Loan Trust				1,024 % fällig am 28.02.2026	\$ 4.864	4.854	0,25
Option One Mortgage Loan Trust				0,000 % fällig am 25.01.2024	€ 20	24	0,00	1,087 % fällig am 15.01.2028	5.984	5.964	0,30
0,288 % fällig am 25.03.2037	7.122	6.600	0,33	0,000 % fällig am 17.06.2024	31	38	0,00	1,117 % fällig am 15.04.2027	5.718	5.689	0,29
OZLM Funding Ltd.				0,325 % fällig am 27.01.2025	\$ 85	85	0,00	Voya CLO Ltd.			
1,446 % fällig am 22.07.2029	10.680	10.669	0,54	1,417 % fällig am 15.12.2033	3.176	3.122	0,16	0,935 % fällig am 25.07.2026	723	723	0,04
Palmer Square Loan Funding Ltd.				SMB Private Education Loan Trust				Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
0,887 % fällig am 15.07.2026	3.780	3.772	0,19	0,998 % fällig am 15.09.2054	12.500	12.491	0,63	0,358 % fällig am 25.03.2037	2.561	2.405	0,12
1,287 % fällig am 15.07.2026	4.600	4.534	0,23	SoFi Consumer Loan Program LLC				0,468 % fällig am 25.07.2036	6.446	6.169	0,31
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				2,500 % fällig am 25.05.2026	40	40	0,00	0,658 % fällig am 25.05.2036	4.000	3.809	0,19
0,883 % fällig am 25.09.2035	5.100	5.024	0,25	2,770 % fällig am 25.05.2026	35	35	0,00	WhiteHorse Ltd.			
0,928 % fällig am 25.09.2035	7.700	7.225	0,37	3,260 % fällig am 25.08.2025	29	29	0,00	1,148 % fällig am 17.04.2027	2.581	2.580	0,13
1,723 % fällig am 25.02.2035	600	603	0,03	SoFi Professional Loan Program LLC				1,378 % fällig am 17.07.2026	474	475	0,02
1,798 % fällig am 25.12.2034	2.669	2.733	0,14	2,650 % fällig am 25.09.2040	165	170	0,01	Zais CLO Ltd.			
2,023 % fällig am 25.09.2034	1.293	1.298	0,07	Sorrento Park CLO DAC				1,387 % fällig am 15.04.2028	1.789	1.784	0,09
Penta CLO BV				0,437 % fällig am 16.11.2027	€ 418	511	0,03				
0,790 % fällig am 04.08.2028	€ 2.292	2.804	0,14	Soundview Home Loan Trust							
Pepper SPARKZ Trust No.3				0,318 % fällig am 25.07.2037	\$ 8.251	7.282	0,37				
1,067 % fällig am 17.08.2028	AUD 4.100	3.164	0,16	0,318 % fällig am 25.08.2037	8.573	7.862	0,40				
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				1,048 % fällig am 25.10.2037	9.156	7.996	0,40	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
0,398 % fällig am 25.06.2047 ^	\$ 1.042	1.033	0,05	1,138 % fällig am 25.06.2035	838	847	0,04	<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
0,478 % fällig am 25.07.2036	3.775	3.603	0,18	1,448 % fällig am 25.10.2037	7.380	6.315	0,32	0,079 % fällig am 26.01.2021 (c)(d)	10.000	10.000	0,51
0,538 % fällig am 25.02.2036	2.707	2.683	0,14	4,250 % fällig am 15.12.2037	1.576	1.495	0,08	0,089 % fällig am 04.02.2021 (c)(d)	20.000	19.999	1,01
0,688 % fällig am 25.05.2036 ^	670	634	0,03	Structured Asset Investment Loan Trust				Summe kurzfristige Instrumente		29.999	1,52
Pretium Mortgage Credit Partners LLC				0,748 % fällig am 25.04.2036	8.000	4.651	0,24	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 3.629.137	183,57
3,179 % fällig am 27.06.2069	3.182	3.198	0,16	1,048 % fällig am 25.05.2035	4.200	4.168	0,21				
RAAC Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust							
0,548 % fällig am 25.06.2047	21	21	0,00	0,278 % fällig am 25.05.2036	592	551	0,03				
Residential Asset Mortgage Products Trust				0,458 % fällig am 25.08.2046	6.429	5.709	0,29	<b>AKTIEN</b>			
0,688 % fällig am 25.02.2036	200	188	0,01	1,273 % fällig am 25.04.2035	195	189	0,01	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
1,198 % fällig am 25.08.2035	1.363	1.347	0,07	Taberna Preferred Funding Ltd.				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Residential Asset Securities Corp. Trust				0,704 % fällig am 05.07.2035	365	321	0,02	PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
0,368 % fällig am 25.02.2037	8.217	7.727	0,39	2,231 % fällig am 05.05.2038	9.471	8.714	0,44	US Dollar Short-Term	9.485.317	94.493	4,78
0,388 % fällig am 25.10.2036	3.458	3.374	0,17	Terwin Mortgage Trust				Floating NAV Fund (f)			
0,408 % fällig am 25.07.2036	3.135	3.115	0,16	1,093 % fällig am 25.06.2036	200	187	0,01	Summe Investmentfonds		\$ 94.493	4,78
0,583 % fällig am 25.06.2036	1.400	1.337	0,07	Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.							
0,838 % fällig am 25.11.2035	1.555	1.547	0,08	4,147 % fällig am 15.09.2038	8.966	8.638	0,44				

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 1.071	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (1.092)	\$ 1.071	\$ 1.071	0,05
	0,000	31.12.2020	04.01.2021	519	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	(529)	519	519	0,03
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.621)	\$ 1.590	\$ 1.590	0,08

(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 December Futures	Short	12.2022	555	\$ (175)	(0,01)
90-Day Eurodollar June Futures	Short	06.2022	310	(140)	(0,01)
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03.2021	2.914	(21.490)	(1,09)
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03.2022	1.854	391	0,02
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03.2023	555	(220)	(0,01)
90-Day Eurodollar September Futures	Short	09.2022	555	(186)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2021	1.073	(249)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2021	3.474	\$ (1.070)	(0,05)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	3.132	(214)	(0,01)
				\$ (23.353)	(1,18)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (23.353)	(1,18)

### 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 <sup>(1)</sup>	3-Month USD-LIBOR	0,400 %	30.03.2026	\$ 400	\$ 0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.12.2022	29.700	4	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,796	08.11.2029	12.000	1.032	0,05
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2022	54.200	1.264	0,06
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,915	09.07.2028	3.500	623	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,916	02.07.2028	6.100	1.087	0,06
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,920	16.07.2028	4.600	820	0,04
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,924	02.07.2028	45.300	8.103	0,41
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,987	12.06.2028	22.500	3.828	0,19
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	3,113	21.11.2028	5.800	1.090	0,06
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	3,142	20.11.2028	16.700	3.180	0,16
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	3,177	01.11.2028	12.700	2.462	0,13
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	€ 2.400	(377)	(0,02)
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	17.03.2051	£ 500	(5)	0,00
					\$ 23.111	1,17
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 23.111	1,17

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

#### 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettover- mögens
BOA	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,470 %	01.11.2021	135.700	\$ 95	\$ 83	0,01
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,068	08.02.2021	19.000	67	66	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,360	02.08.2021	4.500	27	34	0,00
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,500	26.02.2021	145.900	1.153	84	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	13.900	79	17	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,500	19.01.2021	44.500	116	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,585	06.08.2021	19.000	81	99	0,01
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,461	31.08.2021	144.900	100	54	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,470	01.11.2021	135.700	95	83	0,01
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,520	01.11.2021	143.600	111	78	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,381	10.02.2021	35.500	59	20	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,500	26.02.2021	246.900	1.528	142	0,01
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	20.000	107	24	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,413	20.08.2021	30.800	17	12	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,420	23.08.2021	155.000	108	60	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,446	31.08.2021	154.700	108	61	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,500	26.02.2021	53.700	349	31	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,300	21.01.2021	97.600	117	13	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,258	19.01.2021	35.100	319	7	0,00
							\$ 4.636	\$ 968	0,05

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettover- mögens
DUB	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 73.500	07.01.2021	15.000	\$ 1	\$ 0	0,00
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2051	60.000	07.01.2021	183.000	7	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2051	119.500	07.01.2021	45.000	2	0	0,00
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	70.000	07.01.2021	5.000	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	71.000	04.02.2021	172.000	7	0	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.02.2051	73.000	04.02.2021	59.000	2	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	65.000	07.01.2021	5.000	0	0	0,00
					\$ 19	\$ 0	0,00

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,400 %	19.01.2021	44.500	\$ (69)	\$ 0	0,00
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,200	21.01.2021	97.600	(50)	(2)	0,00
							\$ (119)	\$ (2)	0,00

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 101,563	07.01.2021	3.000	\$ (10)	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	101,672	07.01.2021	5.000	(17)	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,141	04.03.2021	2.500	(8)	(3)	0,00
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,906	11.03.2021	2.000	(7)	(14)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2050	103,367	14.01.2021	3.800	(17)	0	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2051	103,594	14.01.2021	4.500	(17)	0	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	6.000	(10)	(5)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	4.500	(11)	(20)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	2.000	(4)	(10)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	104,125	14.04.2021	2.000	(5)	(5)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	99,688	04.02.2021	5.000	(30)	(25)	(0,01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,188	04.02.2021	6.000	(15)	(13)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,266	04.02.2021	6.000	(14)	(14)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	2.000	(6)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,141	04.03.2021	2.500	(7)	(3)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	104,141	04.03.2021	2.500	(3)	(3)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,367	04.02.2021	2.000	(6)	(8)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,406	04.02.2021	6.500	(20)	(26)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,703	04.02.2021	1.500	(4)	(6)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,750	04.02.2021	3.500	(11)	(10)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	103,750	04.02.2021	3.500	(8)	(16)	0,00
					\$ (230)	\$ (183)	(0,01)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 1.100	\$ (26)	\$ 40	\$ 14	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	9.500	(44)	155	111	0,01
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	5.999	(87)	168	81	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	8.200	(42)	138	96	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)	95	92	0,01
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	2.500	(13)	42	29	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	30.000	(82)	472	390	0,02
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	40.100	(343)	810	467	0,02
SAL	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	70.900	(599)	1.425	826	0,04
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.600	(3)	16	13	0,00
					\$ (1.246)	\$ 3.370	\$ 2.124	0,11

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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) Abschluss- prämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettöver- mögens
JPS	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,430 %	17.02.2021	\$ 100.000	\$ 0	\$ (45)	\$ (45)	0,00
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,460	04.03.2021	60.000	0	(52)	(52)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,463	18.03.2021	200.000	0	(200)	(200)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,470	19.02.2021	50.000	0	(43)	(43)	0,00
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,473	08.02.2021	50.000	0	(40)	(40)	0,00
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,480	05.02.2021	150.000	0	(128)	(128)	(0,01)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Mortgage Opportunities 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 Nettovermögens
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,480 %	04.03.2021	\$ 42.500	\$ 0	\$ (46)	\$ (46)	0,00
	Erhalt	3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread	0,483	16.03.2021	185.000	0	(219)	(219)	(0,01)
						\$ 0	\$ (773)	\$ (773)	(0,04)

### DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2021	£ 38.409	\$ 51.298	\$ 0	\$ (1.206)	\$ (1.206)	(0,06)
HUS	01.2021	AUD 4.086	\$ 3.095	0	(58)	(58)	(0,01)
	01.2021	€ 33.357	39.968	0	(850)	(850)	(0,04)
MYI	01.2021	20	25	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 197	€ 161	0	0	0	0,00
	01.2021	65	£ 47	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (2.114)	\$ (2.114)	(0,11)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen 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	01.2021	\$ 3.073	CHF 2.775	\$ 67	\$ 0	\$ 67	0,00
BRC	01.2021	CHF 639	\$ 720	0	(4)	(4)	0,00
GLM	01.2021	\$ 21	CHF 19	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	CHF 103	\$ 115	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 3.015	CHF 2.731	74	0	74	0,01
SCX	01.2021	CHF 196	\$ 217	0	(5)	(5)	0,00
SSB	01.2021	\$ 3.033	CHF 2.733	59	0	59	0,00
UAG	01.2021	CHF 41	\$ 47	0	0	0	0,00
				\$ 200	\$ (11)	\$ 189	0,01

Zum 31. Dezember 2020 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 Nettovermögens
BOA	01.2021	\$ 29.817	€ 24.477	\$ 134	\$ 0	\$ 134	0,01
BPS	01.2021	€ 23.580	\$ 28.874	24	(3)	21	0,00
	01.2021	\$ 125.807	€ 105.043	2.719	0	2.719	0,14
CBK	01.2021	€ 30	\$ 36	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 4.376	€ 3.645	85	0	85	0,00
HUS	01.2021	€ 664	\$ 808	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	\$ 19.576	€ 16.260	330	(9)	321	0,02
JPM	01.2021	€ 42	\$ 52	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	\$ 142.385	€ 118.891	3.084	0	3.084	0,15
	02.2021	228.910	186.959	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2021	134.249	112.098	2.908	0	2.908	0,15
	02.2021	182.160	148.776	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 9.284	\$ (20)	\$ 9.264	0,47

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen 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	01.2021	\$ 210	£ 157	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
BRC	01.2021	£ 10	\$ 13	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 289	£ 212	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	£ 7	\$ 10	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 165.934	£ 124.134	3.756	0	3.756	0,19
HUS	01.2021	175.715	131.351	3.840	0	3.840	0,20
MYI	01.2021	268	199	4	0	4	0,00
SCX	01.2021	£ 182	\$ 241	0	(7)	(7)	0,00
	01.2021	\$ 7	£ 5	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	182.709	136.879	4.403	0	4.403	0,22
				\$ 12.009	\$ (7)	\$ 12.002	0,61

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Class E SGD (Hedged) thesaurierend und 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
BPS	01.2021	SGD 858	\$ 647	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	02.2021	\$ 647	SGD 858	2	0	2	0,00
CBK	01.2021	639	860	12	0	12	0,00
GLM	02.2021	SGD 3	\$ 2	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	418	314	0	(2)	(2)	0,00
	02.2021	\$ 314	SGD 418	2	0	2	0,00
NGF	01.2021	SGD 863	\$ 647	0	(5)	(5)	0,00
	01.2021	\$ 638	SGD 855	9	0	9	0,00
	02.2021	647	863	5	0	5	0,00
SCX	01.2021	316	424	5	0	5	0,00
SSB	01.2021	SGD 3	\$ 2	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 2	SGD 3	0	0	0	0,00
				\$ 35	\$ (9)	\$ 26	0,00
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ 21.501</b>	<b>1,09</b>

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Ginnie Mae, TBA			
3,000 % fällig am 01.02.2051	\$ 600	\$ (628)	(0,03)
3,500 % fällig am 01.02.2051	38.950	(41.272)	(2,09)
4,000 % fällig am 01.01.2051	500	(529)	(0,03)
4,500 % fällig am 01.01.2051	380	(407)	(0,02)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,000 % fällig am 01.01.2051	3.000	(3.143)	(0,16)
4,000 % fällig am 01.01.2051 (h)	56.299	(60.130)	(3,04)
4,000 % fällig am 01.02.2051	82.550	(88.292)	(4,47)
5,500 % fällig am 01.01.2051	5.000	(5.587)	(0,28)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (199.988)</b>	<b>(10,12)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 3.546.491</b>	<b>179,39</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (1.569.484)</b>	<b>(79,39)</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 1.977.007</b>	<b>100,00</b>

## 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) 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) Zum 31. Dezember 2020 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren abgedeckt.
- (i) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.220 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.
- (j) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 675 und Barmittel in Höhe von USD 12.408 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsengehandelte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 1.000 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(23.353)	44.617	(5)	21.259
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(199.988)	0	(199.988)
<b>Summen</b>	<b>\$ 71.140</b>	<b>\$ 3.474.031</b>	<b>\$ 1.320</b>	<b>\$ 3.546.491</b>

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 2.831.015	\$ 26.643	\$ 2.857.658
Investmentfonds	164.187	0	0	164.187
Pensionsgeschäfte	0	50.440	0	50.440
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(17.365)	40.799	0	23.434
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(262.313)	0	(262.313)
<b>Summen</b>	<b>\$ 146.822</b>	<b>\$ 2.659.941</b>	<b>\$ 26.643</b>	<b>\$ 2.833.406</b>

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

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

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

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	% des Nettover- mögens
TDM	0,180 %	30.12.2020	06.01.2021	\$ (2.224)	\$ (2.224)	(0,11)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (2.224)</b>	<b>(0,11)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 384	\$ (500)	\$ (116)
BPS	1.623	(2.300)	(677)
BRC	(3)	0	(3)
CBK	3.869	(3.158)	711
DUB	682	(1.530)	(848)
FAR	(3)	0	(3)
FBF	101	(220)	(119)
GLM	188	(340)	(152)
GST	121	0	121
HUS	3.248	(2.420)	828
JPM	(114)	270	156
JPS	(773)	730	(43)
MYC	875	(1.496)	(621)
MYI	76	(9)	67
NGF	9	0	9
SAL	773	(622)	151
SCX	3.076	(3.780)	(704)
SSB	4.462	(3.700)	762
TOR	2.907	(3.610)	(703)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	9,71	14,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	170,39	155,74
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,47	k. A.
Investmentfonds	4,78	9,80
Pensionsgeschäfte	0,08	3,01
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(1,18)	(1,04)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,17	1,44
Freiverkehrsfinanzderivate	1,09	1,00
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,12)	(15,66)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(28,02)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,11)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

<b>Anlagen zum Marktwert</b>	<b>31. Dez. 2020 (%)</b>	<b>31. Dez. 2019 (%)</b>
Unternehmensanleihen und Wechsel	0,97	1,19
Kommunalanleihen und Wechsel	0,08	0,12
US-Regierungsbehörden	131,35	109,58
US-Schatzobligationen	0,14	1,78
Non-Agency-MBS	18,43	19,34
Forderungsbesicherte Wertpapiere	31,08	38,59
Kurzfristige Instrumente	1,52	k. A.
Investmentfonds	4,78	9,80
Pensionsgeschäfte	0,08	3,01
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(1,18)	(1,04)
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	1,17	1,44
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswaptionen	0,05	0,11
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Zinsswaptionen	0,00	(0,01)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,11	0,09
Zinsswaps	(0,04)	(0,03)
Devisenterminkontrakte	(0,11)	(0,10)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,09	0,96
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,12)	(15,66)
Sonstige Aktiva und Passiva	(79,39)	(69,15)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



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
State Grid Overseas Investment Ltd. 3,750 % fällig am 02.05.2023 \$	5.200	5.548	0,15	3,000 % fällig am 31.10.2025 \$	9.600	10.824	0,31	Southern Pacific Financing PLC 0,211 % fällig am 10.06.2043 £	188	256	0,01
		13.090	0,37			373.125	10,55	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 2,009 % fällig am 25.01.2035 ^	26	25	0,00
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		345.144	9,75					3,080 % fällig am 25.02.2034	20	20	0,00
<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>				<b>NON-AGENCY-MBS</b>							
California State General Obligation Bonds, Series 2017 0,933 % fällig am 01.04.2047	3.900	3.899	0,11	American Home Mortgage Assets Trust 0,528 % fällig am 25.09.2046 ^	146	144	0,00	Structured Asset Mortgage Investments Trust 0,328 % fällig am 25.09.2047	963	948	0,03
				Banc of America Funding Trust 2,826 % fällig am 20.02.2036	25	24	0,00	0,652 % fällig am 19.07.2035	23	23	0,00
				3,506 % fällig am 25.05.2035	3	3	0,00	0,708 % fällig am 25.02.2036 ^	17	16	0,00
				Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 2,801 % fällig am 25.01.2034	8	9	0,00	2,009 % fällig am 25.12.2035 ^	77	75	0,00
				3,314 % fällig am 25.01.2034	1	1	0,00	Thornburg Mortgage Securities Trust 0,788 % fällig am 25.09.2043	558	558	0,02
				Bear Stearns ALT-A Trust 2,701 % fällig am 25.07.2035	1.334	1.101	0,03	Towd Point Mortgage Funding PLC 0,956 % fällig am 20.07.2045 £	29.476	40.300	1,14
				2,729 % fällig am 25.01.2036 ^	77	79	0,00	1,073 % fällig am 20.10.2045	5.671	7.782	0,22
				3,152 % fällig am 25.09.2035 ^	9	7	0,00	1,255 % fällig am 20.02.2054	357	489	0,01
				Bear Stearns Mortgage Funding Trust 0,318 % fällig am 25.06.2047	496	459	0,01	Trinity Square PLC 1,196 % fällig am 15.07.2051	1.210	1.656	0,05
				0,328 % fällig am 25.10.2036	2.054	1.796	0,05	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,688 % fällig am 25.12.2045 \$	10	10	0,00
				Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust 2,728 % fällig am 26.12.2046 ^	714	637	0,02	0,728 % fällig am 25.10.2045	6	5	0,00
				2,984 % fällig am 26.01.2036 ^	2.925	2.401	0,07	1,753 % fällig am 27.02.2034	7	7	0,00
				CD Mortgage Trust 5,648 % fällig am 15.10.2048	699	720	0,02	1,809 % fällig am 25.11.2042	3	3	0,00
				Citigroup Mortgage Loan Trust 2,570 % fällig am 25.05.2035	5	5	0,00	2,009 % fällig am 25.08.2042	5	4	0,00
				3,125 % fällig am 25.08.2035 ^	124	110	0,00	3,095 % fällig am 25.08.2046 ^	38	37	0,00
				3,880 % fällig am 25.10.2035 ^	67	69	0,00	3,768 % fällig am 25.03.2034	9	9	0,00
				Commercial Mortgage Trust 4,219 % fällig am 10.07.2045	1.000	1.082	0,03				
				Countrywide Alternative Loan Trust 0,308 % fällig am 25.02.2047	109	100	0,00	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>			
				0,347 % fällig am 20.12.2046 ^	82	69	0,00	Atlas Senior Loan Fund Ltd. 1,088 % fällig am 20.04.2028	5.607	5.570	0,16
				1,609 % fällig am 25.12.2035	1.043	965	0,03	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 0,793 % fällig am 25.12.2035	2.332	2.335	0,07
				Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 0,798 % fällig am 25.03.2032	2	2	0,00	Black Diamond CLO Designated Activity Co. 0,650 % fällig am 03.10.2029 €	1.094	1.337	0,04
				European Loan Conduit 1,000 % fällig am 17.02.2030 €	2.797	3.412	0,10	1,284 % fällig am 03.10.2029 \$	937	936	0,03
				Finsbury Square PLC 1,016 % fällig am 16.06.2069 £	1.587	2.173	0,06	Cairn CLO BV 0,670 % fällig am 31.01.2030 €	500	611	0,02
				FirstMac Mortgage Funding Trust 0,952 % fällig am 08.03.2049 \$	586	585	0,02	Catamaran CLO Ltd. 1,067 % fällig am 27.01.2028 \$	2.304	2.292	0,07
				GreenPoint Mortgage Funding Trust 0,688 % fällig am 25.11.2045	92	81	0,00	CBAM CLO Ltd. 1,338 % fällig am 20.10.2029	1.100	1.097	0,03
				GSR Mortgage Loan Trust 0,498 % fällig am 25.01.2034	1	1	0,00	Chase Funding Trust 0,888 % fällig am 25.10.2032	3	3	0,00
				HarborView Mortgage Loan Trust 0,592 % fällig am 19.05.2035	32	30	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 1,798 % fällig am 25.07.2037	1.963	1.980	0,06
				3,344 % fällig am 19.08.2036 ^	55	55	0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates 0,548 % fällig am 25.08.2034	168	162	0,00
				Hawksmoor Mortgages PLC 1,104 % fällig am 25.05.2053 £	9.386	12.850	0,36	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 0,768 % fällig am 25.01.2032	4	4	0,00
				Impac CMB Trust 0,908 % fällig am 25.10.2033 \$	1	1	0,00	Crown Point CLO Ltd. 1,388 % fällig am 20.10.2028	3.214	3.205	0,09
				Luminant Mortgage Trust 0,548 % fällig am 25.10.2046	228	215	0,01	CVC Cordatus Loan Fund DAC 0,650 % fällig am 21.07.2030 €	8.800	10.717	0,30
				Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 0,639 % fällig am 15.06.2030	10	10	0,00	Denali Capital CLO LLC 1,265 % fällig am 26.10.2027 \$	2.937	2.935	0,08
				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 0,568 % fällig am 25.02.2036	11	11	0,00	Dryden Senior Loan Fund 1,137 % fällig am 15.10.2027	2.524	2.518	0,07
				0,608 % fällig am 25.04.2029	250	245	0,01	Euro-Galaxy CLO BV 0,750 % fällig am 17.01.2031 €	200	245	0,01
				0,648 % fällig am 25.11.2035	6	6	0,00	0,820 % fällig am 10.11.2030	300	367	0,01
				0,914 % fällig am 25.12.2029	231	221	0,01	Gallatin CLO Ltd. 1,259 % fällig am 21.01.2028 \$	805	801	0,02
				1,757 % fällig am 25.12.2032	1	1	0,00	GSAMP Trust 0,288 % fällig am 25.12.2036	1.185	747	0,02
				2,529 % fällig am 25.12.2034	9	9	0,00	0,630 % fällig am 25.03.2046	1.500	1.474	0,04
				Prime Mortgage Trust 0,548 % fällig am 25.02.2034	37	36	0,00	Jamestown CLO Ltd. 0,927 % fällig am 15.07.2026	200	200	0,01
				Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 3,338 % fällig am 25.09.2035 ^	562	427	0,01	1,045 % fällig am 25.07.2027	838	835	0,02
				Ripon Mortgages PLC 0,851 % fällig am 20.08.2056 £	40.048	54.717	1,55	JMP Credit Advisors CLO Ltd. 1,068 % fällig am 17.01.2028	3.844	3.827	0,11
				Rochester Financing PLC 1,337 % fällig am 18.06.2045	2.560	3.503	0,10	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,408 % fällig am 25.06.2037	1.382	1.370	0,04
				Sequoia Mortgage Trust 0,752 % fällig am 20.12.2034 \$	503	502	0,02	Jubilee CLO BV 0,257 % fällig am 15.12.2029 €	1.900	2.314	0,07
3,000 % fällig am 30.09.2025	9.600	10.805	0,31								

# 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
KVK CLO Ltd. 1,129 % fällig am 14.01.2028	\$ 3.220	\$ 3.204	0,09	TICP CLO Ltd. 1,058 % fällig am 20.04.2028	\$ 8.062	\$ 8.019	0,23	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
LCM LP 1,258 % fällig am 20.10.2027	3.000	3.000	0,09	Toro European CLO DAC 0,650 % fällig am 15.04.2030	€ 3.500	4.276	0,12	<b>KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>			
Long Beach Mortgage Loan Trust 0,708 % fällig am 25.10.2034	5	4	0,00	Towd Point Mortgage Trust 2,750 % fällig am 25.10.2057	\$ 12.585	12.965	0,37	Federal Home Loan Bank 0,081 % fällig am 17.02.2021 (c)	\$ 195.900	\$ 195.883	5,53
Mackay Shields Euro CLO DAC 1,550 % fällig am 15.08.2033	€ 900	1.109	0,03	Tralee CLO Ltd. 1,328 % fällig am 20.10.2028	8.500	8.500	0,24	0,082 % fällig am 17.02.2021 (c)	500.000	499.957	14,13
Man GLG Euro CLO DAC 0,870 % fällig am 15.01.2030	600	732	0,02	Utah State Board of Regents 0,900 % fällig am 25.01.2057	1.761	1.763	0,05	Pacific Gas & Electric Co. 1,600 % fällig am 15.11.2021	8.100	8.106	0,23
Marathon CLO Ltd. 1,083 % fällig am 21.11.2027	\$ 1.858	1.845	0,05	Venture CLO Ltd. 1,117 % fällig am 15.04.2027	8.946	8.901	0,25				
MidOcean Credit CLO LLC 1,037 % fällig am 15.04.2027	803	802	0,02	WhiteHorse Ltd. 1,148 % fällig am 17.04.2027	1.229	1.229	0,03	<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>			
Mountain Hawk CLO Ltd. 1,418 % fällig am 18.04.2025	873	874	0,02	Z Capital Credit Partners CLO Ltd. 1,180 % fällig am 16.07.2027	2.037	2.027	0,06	(0,105) % fällig am 29.03.2021	¥ 7.220.000	69.947	1,98
Navient Student Loan Trust 1,198 % fällig am 27.12.2066	3.960	4.015	0,11	Zais CLO Ltd. 1,387 % fällig am 15.04.2028	4.962	4.946	0,14	(c)(d)			
OCP CLO Ltd. 1,035 % fällig am 26.10.2027	2.629	2.626	0,07			160.066	4,52	<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
1,037 % fällig am 15.07.2027	430	428	0,01	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				0,081 % fällig am 25.02.2021			
1,338 % fällig am 20.07.2029	1.100	1.101	0,03	Development Bank of Japan, Inc. 2,000 % fällig am 19.10.2021	5.000	5.066	0,14	(c)(d)	\$ 129.500	129.489	3,66
Octagon Investment Partners Ltd. 1,087 % fällig am 15.07.2027	3.173	3.167	0,09	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 2,500 % fällig am 11.10.2022	3.800	3.939	0,11	0,086 % fällig am 25.02.2021 (c)(d)	42.600	42.597	1,20
Option One Mortgage Loan Trust 0,368 % fällig am 25.04.2037	2.650	2.113	0,06	Japan Finance Organization for Municipalities 2,125 % fällig am 13.04.2021	2.200	2.211	0,06	0,091 % fällig am 01.04.2021 (c)(d)	46.800	46.792	1,32
OZLM Ltd. 1,264 % fällig am 30.04.2027	3.056	3.052	0,09	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 (e)	¥ 3.269.370	31.761	0,90	0,101 % fällig am 25.02.2021 (c)(d)	15.300	15.299	0,43
1,294 % fällig am 30.07.2027	9.754	9.742	0,28	Oman Government International Bond 3,875 % fällig am 08.03.2022	\$ 2.000	2.016	0,06	0,106 % fällig am 04.02.2021 (c)(d)	122.000	121.995	3,45
OZLME BV 0,820 % fällig am 18.01.2030	€ 500	612	0,02	Qatar Government International Bond 3,875 % fällig am 23.04.2023	5.600	6.025	0,17	0,112 % fällig am 13.05.2021 (c)(d)	226.000	225.942	6,39
Palmer Square Loan Funding Ltd. 0,887 % fällig am 15.07.2026	\$ 4.660	4.650	0,13	Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	2.900	2.947	0,08	0,122 % fällig am 09.02.2021 (c)(d)	110.000	109.996	3,11
1,121 % fällig am 15.11.2026	2.948	2.944	0,08	2,875 % fällig am 04.03.2023	500	524	0,02				
Pepper SPARKZ Trust No.3 1,067 % fällig am 17.08.2028	AUD 5.600	4.321	0,12	2,900 % fällig am 22.10.2025	1.700	1.835	0,05				
SLM Student Loan Trust 0,000 % fällig am 17.06.2024	€ 55	67	0,00	Tokyo Metropolitan Government 2,500 % fällig am 08.06.2022	3.200	3.293	0,09				
Sound Point CLO Ltd. 1,108 % fällig am 20.01.2028	\$ 856	856	0,02			61.287	1,73	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
South Carolina Student Loan Corp. 1,225 % fällig am 03.09.2024	64	64	0,00					<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 1,123 % fällig am 25.12.2035	277	277	0,01					PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (g)	31.908.922	317.877	8,98
THL Credit Wind River CLO Ltd. 1,107 % fällig am 15.10.2027	1.147	1.144	0,03								
								<b>Summe Investmentfonds</b>		\$317.877	8,98
								<b>Summe kurzfristige Instrumente</b>		1.466.003	41,43
								<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>		\$2.725.827	77,03
								<b>AKTIEN</b>			
								<b>Summe kurzfristige Instrumente</b>		1.466.003	41,43
								<b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>		\$2.725.827	77,03

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 9.369	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (9.556)	\$ 9.369	\$ 9.369	0,26
GSC	0,070	31.12.2020	04.01.2021	23.800	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.08.2049	(24.845)	23.800	23.800	0,67
MFK	0,100	04.01.2021	05.01.2021	200.000	U.S. Treasury Bonds 3,375 % - 4,375 % fällig am 15.05.2040 - 15.11.2048	(204.187)	200.000	200.001	5,65
	0,120	31.12.2020	04.01.2021	247.000	U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.08.2049	(253.902)	247.000	247.003	6,99
RVM	0,100	04.01.2021	05.01.2021	200.000	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.05.2026	(204.106)	200.000	200.001	5,65
	0,120	31.12.2020	04.01.2021	248.000	U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 30.09.2026	(253.278)	248.000	248.003	7,01
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (949.874)</b>	<b>\$ 928.169</b>	<b>\$ 928.177</b>	<b>26,23</b>

(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	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
E-mini S&P 500 Index March Futures	Long	03.2021	6.245	\$ 28.033	0,79
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	75	(5)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2021	187	39	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	1.940	467	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	2.407	(304)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2021	139	(309)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	249	938	0,03
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	7	(13)	0,00
				\$ 28.846	0,82
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					
				\$ 28.846	0,82

## 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000 %	20.12.2021	\$ 1.900	\$ (2)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.06.2022	700	(1)	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
Kinder Morgan, Inc.	1,000	20.06.2021	900	(1)	0,00
Kinder Morgan, Inc.	1,000	20.12.2021	100	0	0,00
				\$ (4)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-33 5-Year Index	1,000 %	20.12.2024	\$ 4.000	\$ 43	0,00
CDX.IG-34 5-Year Index	1,000	20.06.2025	1.200	14	0,00
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	4.000	12	0,00
iTraxx Crossover 34 5-Year Index	5,000	20.12.2025	€ 3.300	8	0,00
				\$ 77	0,00

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	0,562 %	21.10.2030	\$ 416	\$ 0	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,533	21.10.2030	416	0	0,00
Zahlung	3-Month CAD Bank Bill	0,636	21.12.2023	CAD 28.700	29	0,00
Zahlung	3-Month CAD Bank Bill	0,637	21.12.2023	34.400	36	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	17.06.2023	\$ 284.900	(107)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025	107.800	51	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	220.900	(1.889)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	06.01.2030	13.600	21	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	22.01.2050	5.100	196	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,875	07.02.2050	300	12	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.01.2050	900	35	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.03.2050	1.900	80	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2021	688.200	2.684	0,07
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,380	18.06.2028	¥ 3.070.000	14	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,667	19.06.2024	\$ 23.200	352	0,01
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	£ 43.600	704	0,02
					\$ 2.218	0,06
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						
					\$ 2.291	0,06

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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 StocksPLUS™ 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,350 %	01.11.2021	363.900	\$ 896	\$ 1.559	0,04
MYC	Call - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,017	02.07.2021	413.500	1.579	9.019	0,26
	Call - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,036	19.07.2021	188.500	693	4.185	0,12
							\$ 3.168	\$ 14.763	0,42

## VERKAUFSoPTIONEN

### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,122 %	01.11.2021	23.600	\$ (281)	\$ (520)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,164	01.11.2021	48.400	(616)	(915)	(0,03)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,491	02.07.2021	132.300	(1.579)	(6.975)	(0,20)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,453	19.07.2021	60.300	(674)	(2.974)	(0,08)
							\$ (3.150)	\$ (11.384)	(0,32)

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	AXA Equitable Holdings, Inc.	1,000 %	20.06.2023	\$ 3.000	\$ (82)	\$ 123	\$ 41	0,00
MYC	Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2021	€ 2.800	20	7	27	0,00
NGF	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2023	\$ 16.700	111	185	296	0,01
					\$ 49	\$ 315	\$ 364	0,01

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

## 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	20.268	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 136.502	21.07.2021	\$ 0	\$ 20.694	\$ 20.694	0,58
BPS	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	10.820	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	77.597	13.10.2021	0	6.298	6.298	0,18
BRC	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	5.558	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	43.126	04.08.2021	0	(36)	(36)	0,00
CBK	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	37.283	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	251.095	24.02.2021	0	38.063	38.063	1,08
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	15.070	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	108.076	15.04.2021	0	8.813	8.813	0,25
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	22.039	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	171.008	15.09.2021	0	(171)	(171)	(0,01)
FAR	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	23.589	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	183.035	17.03.2021	0	(198)	(198)	(0,01)
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	5.558	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	39.860	07.04.2021	0	3.253	3.253	0,09
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	12.898	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	92.499	07.04.2021	0	7.539	7.539	0,21
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	14.589	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	104.627	21.04.2021	0	8.528	8.528	0,24
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	24.542	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	190.430	07.07.2021	0	(148)	(148)	0,00
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	5.558	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	43.126	04.08.2021	0	(36)	(36)	0,00
GST	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	2.164	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	16.791	24.02.2021	0	(10)	(10)	0,00
HUS	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	10.910	3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	78.242	13.01.2021	0	6.385	6.385	0,18
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	41.658	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	311.468	19.05.2021	0	11.643	11.643	0,33
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	12.596	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	96.086	09.06.2021	0	1.639	1.639	0,05
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	37.436	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	285.572	23.06.2021	0	4.870	4.870	0,14
							\$ 0	\$ 117.126	\$ 117.126	3,31

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	¥ 1.686.788	\$ 16.219	\$ 0	\$ (119)	\$ (119)	0,00
	01.2021	\$ 109	ZAR 1.708	7	0	7	0,00
BPS	02.2021	DKK 3.957	\$ 637	0	(14)	(14)	0,00
	03.2021	TWD 102.796	3.671	0	(34)	(34)	0,00
BRC	01.2021	BRL 26.299	4.956	0	(108)	(108)	0,00
	01.2021	£ 156	210	0	(4)	(4)	0,00
CBK	01.2021	\$ 5.061	BRL 26.299	2	0	2	0,00
	01.2021	225	TRY 1.772	12	0	12	0,00
	01.2021	BRL 26.299	\$ 5.061	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	¥ 164.447	1.579	0	(14)	(14)	0,00
GLM	01.2021	NZD 212	149	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 5.197	BRL 26.299	0	(134)	(134)	0,00
	01.2021	12	ZAR 192	1	0	1	0,00
	02.2021	BRL 26.299	\$ 5.195	133	0	133	0,00
HUS	01.2021	26.507	€ 4.221	61	0	61	0,00
	01.2021	€ 4.137	BRL 26.507	41	0	41	0,00
	01.2021	\$ 33.419	¥ 3.458.900	84	0	84	0,00
	02.2021	€ 4.216	BRL 26.507	0	(61)	(61)	0,00
JPM	02.2021	¥ 3.458.900	\$ 33.428	0	(85)	(85)	0,00
	01.2021	CAD 332	260	0	0	0	0,00
	01.2021	£ 88.836	118.810	0	(2.628)	(2.628)	(0,08)
	01.2021	¥ 303.799	2.915	0	(28)	(28)	0,00
MYI	01.2021	\$ 5.804	€ 4.769	32	0	32	0,00
	01.2021	1.148	£ 848	12	0	12	0,00
	01.2021	9	ZAR 135	1	0	1	0,00
	03.2021	18.362	SGD 24.627	272	0	272	0,01
RBC	01.2021	CLP 45.368	\$ 58	0	(6)	(6)	0,00
	01.2021	€ 32	39	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	\$ 7	€ 6	0	0	0	0,00
	01.2021	1.036	£ 763	7	0	7	0,00
	03.2021	TWD 412.507	\$ 14.685	0	(183)	(183)	(0,01)
	01.2021	€ 50.955	61.024	0	(1.322)	(1.322)	(0,04)
TOR	01.2021	€ 210	279	0	(8)	(8)	0,00
	02.2021	€ 50.955	62.388	0	(1)	(1)	0,00
	03.2021	¥ 7.220.000	69.841	0	(156)	(156)	(0,01)
	01.2021	CAD 32.951	25.435	0	(430)	(430)	(0,01)
TOR	01.2021	¥ 1.303.867	12.499	0	(131)	(131)	0,00
	01.2021	\$ 25.864	CAD 32.951	0	0	0	0,00
	02.2021	AUD 5.582	\$ 4.229	0	(80)	(80)	0,00
	02.2021	CAD 32.951	25.867	0	0	0	0,00
				\$ 665	\$ (5.551)	\$ (4.886)	(0,14)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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
BPS	01.2021	€ 79	\$ 96	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	€ 182.015	€ 151.736	3.653	(11)	3.642	0,10
CBK	01.2021	€ 20	\$ 24	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 26	€ 21	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	€ 523	\$ 640	1	(1)	0	0,00
	01.2021	\$ 32.003	€ 26.694	660	0	660	0,02
JPM	01.2021	€ 93	\$ 113	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	\$ 212.800	€ 177.687	4.609	0	4.609	0,13
	02.2021	340.749	278.302	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2021	200.640	167.534	4.347	0	4.347	0,12
	02.2021	254.231	207.639	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 13.270	\$ (14)	\$ 13.256	0,37
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 129.239	3,65
Summe Anlagen						\$ 4.132.249	116,77
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (593.416)	(16,77)
Nettovermögen						\$ 3.538.833	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 mit Sachwertausschüttung.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen StocksPLUS™ 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.

Barmittel in Höhe von USD 87.171 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 300 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	28.846	131.530	0	160.376
<b>Summen</b>	<b>\$ 346.723</b>	<b>\$ 3.785.526</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 4.132.249</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 2.291.240	\$ 0	\$ 2.291.240
Investmentfonds	296.063	0	0	296.063
Pensionsgeschäfte	0	1.110.926	0	1.110.926
Einlagen bei Kreditinstituten	0	8.820	0	8.820
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	17.530	57.053	0	74.583
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(222.667)	0	(222.667)
<b>Summen</b>	<b>\$ 313.593</b>	<b>\$ 3.245.372</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 3.558.965</b>

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

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

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 20.582	\$ (19.390)	\$ 1.192
BPS	9.892	(10.220)	(328)
BRC	(10)	(3.817)	(3.827)
CBK	46.727	(60.548)	(13.821)
FAR	18.938	(58.030)	(39.092)
GLM	40	0	40
GST	(10)	(1.660)	(1.670)
HUS	22.858	(18.330)	4.528
JPM	(6)	0	(6)
MYC	3.282	(4.270)	(988)
MYI	7	(43)	(36)
NGF	296	(260)	36
RBC	(183)	300	117
SCX	3.121	(3.890)	(769)
TOR	3.705	(4.820)	(1.115)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	22,23	28,92
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	54,64	47,20
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,16	0,00
Investmentfonds	8,98	9,84
Pensionsgeschäfte	26,23	36,91
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,82	0,58
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,06	(0,30)
Freiverkehrsfinanzderivate	3,65	2,20
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(7,40)
Einlagenzertifikate	k. A.	0,29
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,11)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	k. A.	0,00
Unternehmensanleihen und Wechsel	9,75	24,84
Kommunalanleihen und Wechsel	0,11	0,13
US-Regierungsbehörden	4,95	25,80
US-Schatzobligationen	10,55	7,86
Non-Agency-MBS	3,99	2,84
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,52	5,52
Staatsemissionen	1,73	2,65
Kurzfristige Instrumente	41,43	6,48
Investmentfonds	8,98	9,84
Pensionsgeschäfte	26,23	36,91
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,82	0,58
Verkaufsoptionen		
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	k. A.	(0,11)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,06	(0,19)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	0,42	0,08
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,32)	(0,10)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Total Return Swaps auf Indizes	3,31	2,07
Devisenterminkontrakte	(0,14)	(0,11)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,37	0,25
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(7,40)
Einlagenzertifikate	k. A.	0,29
Sonstige Aktiva und Passiva	(16,77)	(18,24)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO StocksPLUS™ AR 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	
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				2,500 % fällig am 01.03.2051	\$	150	1,88	GSA Home Equity Trust	\$	100	1,20	
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				4,000 % fällig am 01.01.2051		700	8,89	2,023 % fällig am 25.02.2035		101	1,20	
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>							1,599	18,99				
China Construction Bank New Zealand Ltd.				<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust		73	0,84	
0,989 % fällig am 20.12.2021	\$	100	1,19	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				0,358 % fällig am 25.10.2036		71	0,84	
CPI Property Group S.A.	€	100	1,58	0,375 % fällig am 15.01.2027				658		734	8,72	
2,750 % fällig am 12.05.2026				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Man GLG Euro CLO DAC	€	100	1,45	
Park Aerospace Holdings Ltd.	\$	50	0,62	Banc of America Alternative Loan Trust				0,870 % fällig am 15.01.2030		100	1,45	
5,250 % fällig am 15.08.2022				5,500 % fällig am 25.06.2034				8		7	0,08	
QNB Finance Ltd.		200	2,39	6,000 % fällig am 25.03.2021 ^				15		13	0,16	
1,310 % fällig am 12.02.2022				Banc of America Mortgage Trust				3,523 % fällig am 25.06.2034		8	0,08	
VICI Properties LP		100	1,21	4,034 % fällig am 25.05.2037				21		20	0,24	
3,750 % fällig am 15.02.2027				Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				4,034 % fällig am 25.05.2037		21	0,24	
Wells Fargo & Co.	€	100	1,52	Chase Mortgage Finance Trust				3,276 % fällig am 25.07.2037		3	0,04	
1,338 % fällig am 04.05.2025				716				8,51	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
				<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Peru Government International Bond				
Aker BP ASA	\$	150	1,88	Countrywide Alternative Loan Trust				5,400 % fällig am 12.08.2034				
3,000 % fällig am 15.01.2025				1,609 % fällig am 25.12.2035				PEN				
AP Moller - Maersk A/S		25	0,32	5,500 % fällig am 25.10.2020				100				
3,750 % fällig am 22.09.2024				6,000 % fällig am 25.03.2021 ^				30				
Boeing Co.		104	1,30	5,915 % fällig am 25.11.2035				0,36				
2,750 % fällig am 01.02.2026				Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				Summe kurzfristige Instrumente				
Dell Bank International DAC	€	100	1,47	0,575 % fällig am 25.11.2034				994				
0,625 % fällig am 17.10.2022				Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				11,80				
Fairstone Financial, Inc.	\$	12	0,15	0,810 % fällig am 27.12.2035				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				
7,875 % fällig am 15.07.2024				GSR Mortgage Loan Trust				<b>JAPAN TREASURY BILLS</b>				
				2,870 % fällig am 25.11.2035				0,105 % fällig am				
		431	5,12	Mortgage Equity Conversion Asset Trust				29.03.2021 (b)(c)				
				0,560 % fällig am 25.02.2042				¥				
				Structured Asset Mortgage Investments Trust				20.000				
				0,652 % fällig am 19.07.2035				194				
				0,768 % fällig am 25.09.2045				2,30				
				Structured Asset Securities Corp.				<b>U.S. TREASURY BILLS</b>				
				0,428 % fällig am 25.01.2036				0,074 % fällig am 14.01.2021 (b)(c)				
				0,498 % fällig am 25.03.2035				0,092 % fällig am				
								02.03.2021 (a)(b)(c)				
								0,101 % fällig am 26.01.2021 (b)(c)				
								300				
								100				
								800				
								9,50				
								Summe übertragbare Wertpapiere				
								\$ 5.839				
								69,37				
								<b>AKTIEN</b>				
								<b>INVESTMENTFONDS</b>				
								<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>				
								PIMCO Select Funds plc -				
								PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)				
								41.960				
								418				
								4,96				
								<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>				
								PIMCO ETFs plc - PIMCO				
								US Dollar Short Maturity				
								UCITS ETF (e)				
								3.800				
								386				
								4,59				
								Summe Investmentfonds				
								\$ 804				
								9,55				

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	0,090 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 1.400	Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.09.2044	\$ (1.443)	\$ 1.400	\$ 1.400	16,64
	0,090	31.12.2020	04.01.2021	1.500	U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.08.2049	(1.536)	1.500	1.500	17,82
SSB	0,000	31.12.2020	04.01.2021	139	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021	(142)	139	139	1,65
<b>Summe Pensionsgeschäfte</b>						<b>\$ (3.121)</b>	<b>\$ 3.039</b>	<b>\$ 3.039</b>	<b>36,11</b>

(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
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2021	3	\$ 1	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	10	3	0,04
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	5	(1)	(0,01)
				\$ 3	0,04
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ 3</b>	<b>0,04</b>

## 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
Zahlung	3-Month CAD Bank Bill		0,636 %	21.12.2023	CAD 100	\$ 0	0,00
Zahlung	3-Month CAD Bank Bill		0,637	21.12.2023	200	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,700	17.03.2026	CNY 200	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,705	17.03.2026	200	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,770	17.03.2026	200	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,810	17.03.2026	300	0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		0,740	15.02.2027	\$ 100	1	0,02
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	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2027	300	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,250	17.06.2030	200	2	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,500	18.12.2021	800	(13)	(0,15)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,500	18.12.2029	200	(16)	(0,20)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,500	18.12.2024	100	(3)	(0,04)
Erhalt	UKRPI		3,334	15.08.2025	£ 100	(1)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		3,475	15.08.2030	100	2	0,02
Zahlung	UKRPI		3,480	15.01.2030	100	5	0,05
Zahlung	UKRPI		3,490	15.09.2028	100	5	0,07
Zahlung	UKRPI		3,650	15.12.2030	100	4	0,05
						\$ (14)	(0,17)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ (14)</b>	<b>(0,17)</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
MYC	Call - OTC 3-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,036 %	19.07.2021	900	\$ 3	\$ 20	0,24

## VERKAUFSOPTIONEN

## DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
GLM	Put - OTC USD versus MXN	MXN 19,120	16.12.2021	94	\$ (2)	\$ (2)	(0,02)
	Call - OTC USD versus MXN	23,100	16.12.2021	94	(2)	(2)	(0,03)
MYI	Put - OTC USD versus CNH	CNH 6,400	16.12.2021	83	(1)	(1)	(0,01)
	Call - OTC USD versus CNH	7,000	16.12.2021	83	(1)	(1)	(0,01)
	Put - OTC USD versus MXN	MXN 19,000	09.12.2021	71	(1)	(1)	(0,01)
	Call - OTC USD versus MXN	23,000	09.12.2021	71	(1)	(1)	(0,02)
					\$ (8)	\$ (8)	(0,10)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,453 %	19.07.2021	300	\$ (4)	\$ (15)	(0,18)

<sup>(1)</sup> 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) Abschluss- sprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettver- mögens	
BRC	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	245	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 1.831	07.04.2021	\$ 0	\$ 70	\$ 70	0,83	
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	258	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.002	04.08.2021	0	(2)	(2)	(0,02)	
FAR	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	26	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	186	07.04.2021	0	15	15	0,18	
GST	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	496	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.849	24.02.2021	0	(2)	(2)	(0,03)	
	Zahlung	S&P 500 Total Return Index	63	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	481	22.09.2021	0	8	8	0,10	
								\$ 0	\$ 89	\$ 89	1,06

# 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 Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	01.2021	BRL 97	\$ 18	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 19	BRL 97	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	BRL 97	\$ 19	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 19	BRL 97	0	(1)	(1)	(0,01)
	02.2021	BRL 97	\$ 19	0	0	0	0,01
	02.2021	PEN 97	27	0	0	0	0,00
GLM	01.2021	BRL 101	€ 16	1	0	1	0,00
	01.2021	€ 16	BRL 101	0	0	0	0,00
	02.2021	16	101	0	0	0	0,00
MYI	02.2021	CAD 4	\$ 3	0	0	0	0,00
SCX	02.2021	£ 2	3	0	0	0	0,00
	03.2021	¥ 20.000	193	0	0	0	(0,01)
UAG	02.2021	€ 479	567	0	(20)	(20)	(0,23)
				\$ 1	\$ (21)	\$ (20)	(0,24)

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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 Nettowert- zunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	\$ 16	€ 13	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,01
JPM	01.2021	119	99	2	0	2	0,03
SCX	01.2021	126	105	3	0	3	0,03
	02.2021	129	105	0	0	0	0,00
SOG	01.2021	100	83	2	0	2	0,02
				\$ 7	\$ 0	\$ 7	0,09
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						\$ 73	0,87
<b>Summe Anlagen</b>						\$ 9.744	115,77
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						\$ (1.327)	(15,77)
<b>Nettovermögen</b>						\$ 8.417	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) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von USD 55 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	3	59	0	62
<b>Summen</b>	<b>\$ 421</b>	<b>\$ 9.323</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 9.744</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 5.786	\$ 100	\$ 5.886
Investmentfonds	503	0	0	503
Pensionsgeschäfte	0	969	0	969
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	3	351	0	354
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(148)	0	(148)
<b>Summen</b>	<b>\$ 506</b>	<b>\$ 6.958</b>	<b>\$ 100</b>	<b>\$ 7.564</b>

(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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BRC	\$ 68	\$ (227)	\$ (159)
CBK	(1)	0	(1)
FAR	15	0	15
GLM	(3)	0	(3)
GST	6	(280)	(274)
JPM	2	0	2
MYC	5	0	5
MYI	(4)	0	(4)
SCX	3	0	3
SOG	2	0	2
UAG	(20)	0	(20)

(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 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	23,43	20,08
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	41,19	78,40
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	4,75	0,00
Investmentfonds	9,55	8,42
Pensionsgeschäfte	36,11	16,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,17)	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate	0,87	5,77
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(2,48)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	15,55	26,70
US-Regierungsbehörden	18,99	30,60
US-Schatzobligationen	8,72	9,23
Non-Agency-MBS	6,13	12,18
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,82	10,42
Staatsemissionen	0,36	0,53
Kurzfristige Instrumente	11,80	8,82
Investmentfonds	9,55	8,42
Pensionsgeschäfte	36,11	16,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,04	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,17)	0,07
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,03
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,24	0,05
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,18)	(0,07)
Devisenoptionen	(0,10)	0,00
Total Return Swaps auf Indizes	1,06	5,91
Devisenterminkontrakte	(0,24)	(0,12)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,09	k. A.
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(2,48)
Sonstige Aktiva und Passiva	(15,77)	(26,55)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic 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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>											
<b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>											
MH Sub LLC				3,647 % fällig am 13.09.2024	\$ 87	\$ 86	0,01	Banco de Credito del Peru			
Nascars Holdings, Inc.				2,897 % fällig am 19.10.2026	37	37	0,00	4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 1.100	\$ 328	0,03
NCI Building Systems, Inc.				3,904 % fällig am 12.04.2025	283	283	0,03	Banco Espirito Santo S.A.	€ 100	19	0,00
Neiman Marcus Group Ltd. LLC				13,000 % fällig am 25.09.2025	682	730	0,08	2,625 % fällig am 08.05.2017 ^			
Ortho-Clinical Diagnostics S.A.				3,398 % fällig am 30.06.2025	17	17	0,00	Banco Santander S.A.	400	491	0,05
PetSmart, Inc.				4,500 % fällig am 11.03.2022	2.266	2.266	0,23	4,750 % fällig am 19.03.2025 (h)(j)	300	376	0,04
PUG LLC				3,647 % fällig am 12.02.2027	46	44	0,00	6,250 % fällig am 11.09.2021 (h)(j)			
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				3,897 % fällig am 16.11.2025	87	86	0,01	Bank of Ireland Group PLC	1.761	2.472	0,25
RPI Intermediate Finance Trust				1,897 % fällig am 11.02.2027	13	13	0,00	7,500 % fällig am 19.05.2025 (h)(j)			
Sequa Mezzanine Holdings LLC				7,750 % fällig am 28.11.2023	1.143	1.151	0,12	Barclays Bank PLC	\$ 349	388	0,04
10,000 % fällig am 23.07.2025				1,896	1.839	0,19	1,601 % fällig am 16.05.2024	400	405	0,04	
Sequa Mezzanine Holdings LLC (11,750 % bar und 6,750 % PIK)				164	143	0,02	1,849 % fällig am 10.01.2023	200	202	0,02	
Sinclair Television Group, Inc.				2,650 % fällig am 30.09.2026	79	78	0,01	2,375 % fällig am 06.10.2023	€ 300	422	0,04
Sotera Health Holdings LLC				5,500 % fällig am 11.12.2026	151	151	0,02	3,125 % fällig am 17.01.2024	€ 1.300	1.892	0,19
SS&C Technologies, Inc.				1,897 % fällig am 16.04.2025	165	163	0,02	3,250 % fällig am 12.02.2027	200	305	0,03
Starfruit Finco BV				3,153 % fällig am 01.10.2025	272	269	0,03	4,338 % fällig am 16.05.2024	\$ 400	433	0,04
Sunshine Luxembourg SARL				4,254 % fällig am 01.10.2026	322	323	0,03	4,972 % fällig am 16.05.2029	400	480	0,05
Syniverse Holdings, Inc.				6,000 % fällig am 09.03.2023	159	145	0,02	6,125 % fällig am 15.12.2025 (h)(j)	1.511	1.632	0,17
Univision Communications, Inc.				3,750 % fällig am 15.03.2024	1.155	1.149	0,12	6,375 % fällig am 15.12.2025 (h)(j)	€ 650	962	0,10
Valaris PLC				2,970 % fällig am 31.07.2026	30	30	0,00	7,125 % fällig am 15.06.2025 (h)(j)	200	306	0,03
TBD% fällig am 17.08.2021				20	20	0,00	7,250 % fällig am 15.03.2023 (h)(j)	1.200	1.744	0,18	
Whatabrands LLC				2,970 % fällig am 31.07.2026	30	30	0,00	7,750 % fällig am 15.09.2023 (h)(j)	\$ 1.200	1.293	0,13
Windstream Services LLC				7,250 % fällig am 21.09.2027	21	21	0,00	7,875 % fällig am 15.03.2022 (h)(j)	200	210	0,02
Wyndham Hotels & Resorts, Inc.				1,897 % fällig am 30.05.2025	98	97	0,01	7,875 % fällig am 15.09.2022 (h)(j)	€ 1.700	2.478	0,25
Zayo Group Holdings, Inc.				3,147 % fällig am 09.03.2027	534	532	0,05	BGC Partners, Inc.	\$ 96	101	0,01
								3,750 % fällig am 01.10.2024	44	48	0,01
								5,375 % fällig am 24.07.2023			
								BNP Paribas S.A.	200	237	0,02
								4,400 % fällig am 14.08.2028			
								BOC Aviation Ltd.	200	200	0,02
								1,264 % fällig am 02.05.2021			
								Brighthouse Financial, Inc.	17	18	0,00
								3,700 % fällig am 22.06.2027			
								Brixmor Operating Partnership LP	170	170	0,02
								1,264 % fällig am 01.02.2022			
								Brookfield Finance, Inc.	118	150	0,02
								4,700 % fällig am 20.09.2047			
								Cantor Fitzgerald LP	100	111	0,01
								4,875 % fällig am 01.05.2024			
								CBL & Associates LP	158	63	0,01
								5,950 % fällig am 15.12.2026 ^			
								China Construction Bank Corp.	€ 300	367	0,04
								0,061 % fällig am 24.09.2021			
								CIT Group, Inc.	\$ 48	48	0,01
								4,125 % fällig am 09.03.2021	260	276	0,03
								5,000 % fällig am 15.08.2022			
								Cooperative Rabobank UA	€ 5.000	6.297	0,65
								6,625 % fällig am 20.09.2021 (h)(j)			
								3,500 % fällig am 15.04.2023	700	715	0,07
								Corestate Capital Holding S.A.			
								3,500 % fällig am 15.04.2023			
								Corp. Andina de Fomento	MXN 1.678	85	0,01
								3,950 % fällig am 15.10.2021 (g)			
								CPI Property Group S.A.	€ 600	798	0,08
								2,750 % fällig am 12.05.2026			
								Credit Suisse AG	\$ 1.915	2.161	0,22
								6,500 % fällig am 08.08.2023 (j)			
								Credit Suisse Group AG	1.670	1.894	0,19
								3,869 % fällig am 12.01.2029	250	289	0,03
								4,282 % fällig am 09.01.2028	200	225	0,02
								7,250 % fällig am 12.09.2025 (h)(j)	400	437	0,05
								7,500 % fällig am 17.07.2023 (h)(j)			
								CTR Partnership LP	50	52	0,01
								5,250 % fällig am 01.06.2025			
								Deutsche Bank AG	€ 3.600	4.406	0,45
								0,375 % fällig am 18.01.2021	\$ 300	300	0,03
								1,510 % fällig am 04.02.2021	€ 800	1.024	0,11
								1,625 % fällig am 20.01.2027	€ 500	721	0,07
								2,625 % fällig am 16.12.2024	\$ 100	100	0,01
								3,150 % fällig am 22.01.2021	1.850	2.024	0,21
								3,961 % fällig am 26.11.2025	400	401	0,04
								4,250 % fällig am 04.02.2021	2.670	2.739	0,28
								4,250 % fällig am 14.10.2021			
								EPR Properties	200	200	0,02
								4,500 % fällig am 01.06.2027	15	15	0,00
								4,750 % fällig am 15.12.2026	24	24	0,00
								4,950 % fällig am 15.04.2028			







# 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
Banc of America Funding Trust 3,305 % fällig am 20.05.2036 ^	\$ 53	\$	52	Ameriquest Mortgage Securities Trust 0,488 % fällig am 25.04.2036	\$ 3.317	\$	3,290	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,468 % fällig am 25.01.2036 ^	\$ 5.365	\$	5,242
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust 1,409 % fällig am 15.02.2033	509		506	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,123 % fällig am 25.07.2035	3.990		3,822	Renaissance Home Equity Loan Trust 4,934 % fällig am 25.08.2035	48	50	0,01
2,209 % fällig am 15.02.2033	400		398	Argent Securities Trust 0,298 % fällig am 25.07.2036	7.001		6,206	Residential Asset Securities Corp. Trust 0,388 % fällig am 25.09.2036	1.634	1.624	0,17
3,259 % fällig am 15.02.2033	2.400		2,397	Asset-Backed Funding Certificates Trust 4,125 % fällig am 15.06.2043	237		236	0,733 % fällig am 25.03.2036	2.000	1.984	0,20
Bear Stearns Mortgage Funding Trust 0,368 % fällig am 25.08.2036	1.359	1.369	0,14	Basic Asset-Backed Securities Trust 0,768 % fällig am 25.04.2036	509	507	0,05	Saxon Asset Securities Trust 1,898 % fällig am 25.12.2037	3.086	3.091	0,32
CitiMortgage Alternative Loan Trust 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	318	320	0,03	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 0,318 % fällig am 25.10.2036	313	312	0,03	Soundview Home Loan Trust 0,458 % fällig am 25.06.2036 ^	5.508	4.997	0,51
Countrywide Alternative Loan Trust 0,288 % fällig am 25.06.2037	2.585	2.359	0,24	2,098 % fällig am 25.11.2039	637	638	0,07	1,148 % fällig am 25.09.2037	7.490	6.025	0,62
1,448 % fällig am 25.10.2035 ^	338	253	0,03	Castlelake Aircraft Securitization Trust 4,125 % fällig am 15.06.2043	1.257	1.201	0,12	1,183 % fällig am 25.05.2035	1.500	1.480	0,15
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	2.830	2.692	0,28	Conseco Finance Corp. 6,280 % fällig am 01.09.2030	1.020	1.075	0,11	Structured Asset Investment Loan Trust 0,928 % fällig am 25.07.2035	127	127	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0,808 % fällig am 25.02.2035	902	795	0,08	Countrywide Asset-Backed Certificates 1,144 % fällig am 25.05.2037	7.112	6.860	0,70	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 0,318 % fällig am 25.12.2036	324	317	0,03
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 6,500 % fällig am 25.11.2034 ^	408	409	0,04	1,213 % fällig am 25.08.2035	2.415	2.419	0,25	1,273 % fällig am 25.07.2035	1.220	1.163	0,12
Eurosaïi PLC 0,741 % fällig am 13.09.2045	£ 4.435	5.872	0,60	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 0,488 % fällig am 25.05.2036	11	11	0,00	TruPS Financials Note Securitization Ltd. 1,809 % fällig am 20.09.2039	2.698	2.590	0,27
0,991 % fällig am 13.06.2045	2.142	2.914	0,30	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. 1,723 % fällig am 25.05.2034	252	251	0,03	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 0,358 % fällig am 25.03.2037	16	15	0,00
GreenPoint Mortgage Funding Trust 0,348 % fällig am 25.10.2046	\$ 612	586	0,06	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 3,342 % fällig am 25.01.2037 ^	194	89	0,01				
Grifonas Finance No. 1 PLC 0,000 % fällig am 28.08.2039	€ 299	355	0,04	Evans Grove CLO Ltd. 1,144 % fällig am 28.05.2028	1.775	1.768	0,18	<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
GSMPS Mortgage Loan Trust 7,084 % fällig am 20.10.2032	\$ 1.936	1.973	0,20	Fieldstone Mortgage Investment Trust 0,390 % fällig am 25.11.2036	2.102	1.530	0,16	Angolan Government International Bond 0,125 % fällig am 09.07.2030	2.137	857	0,09
GSMSC Resecuritization Trust 4,425 % fällig am 26.04.2037	7.056	2.648	0,27	First Franklin Mortgage Loan Trust 0,268 % fällig am 25.12.2036	6.497	6.153	0,63	0,125 % fällig am 09.07.2035	1.920	690	0,07
HomeBanc Mortgage Trust 3,255 % fällig am 25.04.2037	53	49	0,01	0,823 % fällig am 25.11.2035	1.500	1.463	0,15	Argentina Government International Bond 0,125 % fällig am 09.07.2030	3.879	1.586	0,16
JPMorgan Mortgage Trust 3,013 % fällig am 25.01.2037 ^	144	131	0,01	0,828 % fällig am 25.01.2036	9	9	0,00	0,125 % fällig am 09.01.2038	1.959	722	0,07
3,222 % fällig am 25.08.2036 ^	53	48	0,00	Fremont Home Loan Trust 0,298 % fällig am 25.01.2037	1.717	986	0,10	0,125 % fällig am 09.01.2036	2.406	993	0,10
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 0,698 % fällig am 25.09.2037	7.300	3.314	0,34	0,508 % fällig am 25.04.2036	414	410	0,04	0,125 % fällig am 09.07.2041	2.096	798	0,08
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 0,408 % fällig am 25.04.2035	147	145	0,01	Gallatin CLO Ltd. 1,537 % fällig am 15.07.2027	3.821	3.815	0,39	0,125 % fällig am 09.07.2046	115	42	0,00
Paragon Mortgages PLC 1,105 % fällig am 15.05.2045	£ 8.179	11.235	1,15	1,887 % fällig am 15.07.2027	800	792	0,08	1,000 % fällig am 09.07.2029	377	165	0,02
RBSGC Mortgage Loan Trust 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	\$ 42	39	0,00	GSAMP Trust 0,518 % fällig am 25.03.2047	9.000	7.420	0,76	15,500 % fällig am 17.10.2026	ARS 3.906	9	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust 0,358 % fällig am 25.06.2037	70	67	0,01	Harley Marine Financing LLC 5,682 % fällig am 15.05.2043	275	234	0,02	34,109 % fällig am 04.10.2022	730	5	0,00
Ripon Mortgages PLC 0,851 % fällig am 20.08.2056	£ 3.972	5.427	0,56	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 0,308 % fällig am 25.11.2036	5.210	4.917	0,50	36,174 % fällig am 03.04.2022	54.986	367	0,04
Rochester Financing PLC 1,337 % fällig am 18.06.2045	823	1.126	0,11	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 0,398 % fällig am 25.07.2036	2.381	2.383	0,24	Argentina Treasury Bond 1,000 % fällig am 05.08.2021	8.598	61	0,01
Sandwell Commercial Finance PLC 1,161 % fällig am 30.09.2037	33	40	0,00	Legacy Mortgage Asset Trust 0,948 % fällig am 25.10.2035	95	95	0,01	1,500 % fällig am 25.03.2024	618	4	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 2,009 % fällig am 25.05.2035 ^	\$ 183	154	0,01	Lehman XS Trust 1,898 % fällig am 25.10.2035	95	95	0,01	2,500 % fällig am 22.07.2021	814	6	0,00
3,201 % fällig am 25.09.2035	79	64	0,01	Long Beach Mortgage Loan Trust 0,508 % fällig am 25.03.2046	4.435	3.789	0,39	Australia Government International Bond 1,750 % fällig am 21.06.2051	AUD 2.200	1.615	0,17
Sutherland Commercial Mortgage Loans 3,192 % fällig am 25.05.2037	659	656	0,07	0,748 % fällig am 25.01.2036	3.672	3.291	0,34	Autonomous City of Buenos Aires Argentina 37,424 % fällig am 29.03.2024	ARS37.022	216	0,02
Trinity Square PLC 1,196 % fällig am 15.07.2051	£ 40	55	0,01	1,873 % fällig am 25.06.2034	86	86	0,01	37,748 % fällig am 22.02.2028	27.495	154	0,02
Twin Bridges PLC 0,821 % fällig am 12.09.2044	1.928	2.632	0,27	LP Credit Card ABS Master Trust 1,740 % fällig am 20.08.2024	1.374	1.422	0,15	37,981 % fällig am 23.01.2022	5.410	36	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 1,564 % fällig am 25.12.2046 ^	\$ 3.395	3.088	0,32	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust 3,398 % fällig am 25.03.2032	1.677	1.684	0,17	China Development Bank 2,890 % fällig am 22.06.2025	CNY10.600	1.600	0,16
2,003 % fällig am 25.08.2046	1.118	1.069	0,11	Marlette Funding Trust 3,710 % fällig am 15.12.2028	9	9	0,00	3,300 % fällig am 01.02.2024	2.000	308	0,03
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 0,598 % fällig am 25.05.2035 ^	426	350	0,04	MASTR Asset-Backed Securities Trust 0,668 % fällig am 25.06.2036	501	464	0,05	3,430 % fällig am 14.01.2027	1.800	276	0,03
Wells Fargo Alternative Loan Trust 6,250 % fällig am 25.07.2037 ^	1.929	1.924	0,20	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,258 % fällig am 25.02.2037	866	544	0,06	3,680 % fällig am 26.02.2026	12.600	1.963	0,20
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 2,771 % fällig am 25.10.2036 ^	23	21	0,00	0,298 % fällig am 25.02.2037	2.687	1.697	0,17	3,740 % fällig am 10.09.2025	16.000	2.498	0,26
		63.301	6,49	0,398 % fällig am 25.03.2037	9.829	5.190	0,53	4,150 % fällig am 26.10.2025	8.900	1.415	0,15
				0,688 % fällig am 25.03.2036	2.927	2.879	0,30	Croatia Government International Bond 1,500 % fällig am 17.06.2031	€ 1.300	1.744	0,18
<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Navient Student Loan Trust 1,198 % fällig am 27.12.2066	4.019	4.074	0,42	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,875 % fällig am 16.04.2050	\$ 300	367	0,04
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 0,428 % fällig am 25.07.2036	7.623	7.296	0,75	New Century Home Equity Loan Trust 0,928 % fällig am 25.03.2035	72	68	0,01	Export-Credit Bank of Turkey 8,250 % fällig am 24.01.2024	200	217	0,02
Aegis Asset-Backed Securities Trust 1,148 % fällig am 25.03.2035 ^	958	937	0,10	2,173 % fällig am 25.05.2034 ^	1.150	1.159	0,12	Guatemala Government International Bond 5,375 % fällig am 24.04.2032	200	245	0,03
								6,125 % fällig am 01.06.2050	200	265	0,03
								Indonesia Government International Bond 4,200 % fällig am 15.10.2050	400	479	0,05
								Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	2.400	2.857	0,29
								4,500 % fällig am 03.04.2120	200	265	0,03
								Mexico Government International Bond 4,750 % fällig am 27.04.2032	400	482	0,05
								5,000 % fällig am 27.04.2051	200	250	0,03
								Paraguay Government International Bond 4,950 % fällig am 28.04.2031	200	243	0,02
								Peru Government International Bond 5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN 1.260	363	0,04



# Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income 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
CIT Group, Inc.	2.326	\$ 84	0,01	Merck & Co., Inc.	12.763	\$ 1.044	0,11	NetApp, Inc.	4.382	\$ 290	0,03
Citizens Financial Group, Inc.	1.930	69	0,01	Novartis AG	6.055	571	0,06	Nippon Electric Glass Co. Ltd.	10.200	223	0,02
Comerica, Inc.	3.176	177	0,02	Novo Nordisk A/S 'B'	1.927	135	0,01	QUALCOMM, Inc.	5.332	812	0,08
Commonwealth Bank of Australia	36.669	2.333	0,24	Pfizer, Inc.	132.118	4.863	0,50	Seagate Technology PLC	11.995	746	0,08
Danske Bank A/S	23.974	397	0,04	Roche Holding AG	3.362	1.173	0,12	Seiko Epson Corp.	22.400	333	0,03
Eurobank Ergasias S.A. 'A' (d)	712.189	501	0,05	Sanofi	3.024	293	0,03	Texas Instruments, Inc.	2.227	366	0,04
Fifth Third Bancorp	7.301	201	0,02	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.	7.100	257	0,03	Tokyo Electron Ltd.	500	187	0,02
Franklin Resources, Inc.	14.893	372	0,04			22.286	2,29	VTech Holdings Ltd.	12.900	100	0,01
HSBC Holdings PLC	32.133	166	0,02	<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Western Digital Corp.	2.153	119	0,01
Huntington Bancshares, Inc.	9.695	122	0,01	3M Co.	9.423	1.647	0,17	Xerox Corp.	5.077	118	0,01
ING Groep NV (d)	29.097	271	0,03	ABB Ltd.	22.108	621	0,06			15.892	1,63
Intesa Sanpaolo SpA (d)	845.214	2.001	0,20	ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.	22.112	736	0,08	<b>BAUSTOFFE</b>			
Invesco Ltd.	65.864	1.148	0,12	Adecco Group AG	9.629	642	0,07	Amcor PLC	14.345	169	0,02
Japan Post Holdings Co. Ltd.	80.800	629	0,06	AGC, Inc.	3.000	105	0,01	Aurubis AG	2.091	163	0,02
KeyCorp.	9.649	158	0,02	Amada Holdings Co. Ltd.	14.600	161	0,02	BASF SE	29.194	2.311	0,24
Legal & General Group PLC	64.597	235	0,02	Aurizon Holdings Ltd.	103.516	311	0,03	BHP Group Ltd.	240.621	7.869	0,81
M&G PLC	57.476	155	0,02	Bouygues S.A.	2.926	121	0,01	BHP Group PLC	42.010	1.109	0,11
Macquarie Group Ltd.	584	62	0,01	Caterpillar, Inc.	1.252	228	0,02	Boral Ltd. (d)	12.916	50	0,01
Mapfre S.A.	175.983	344	0,03	Cie de Saint-Gobain (d)	4.565	210	0,02	Covestro AG	5.674	350	0,04
MetLife, Inc.	8.945	420	0,04	CK Hutchison Holdings Ltd.	9.500	66	0,01	Dow, Inc.	14.746	818	0,08
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	262.000	1.160	0,12	Cummins, Inc.	844	192	0,02	Eastman Chemical Co.	1.712	172	0,02
Mizuho Financial Group, Inc.	42.750	543	0,05	Deutsche Lufthansa AG (d)	9.094	121	0,01	Evonik Industries AG	2.844	93	0,01
MS&AD Insurance Group Holdings, Inc.	11.400	347	0,03	Deutsche Post AG	2.952	146	0,01	Evrax PLC	77.709	496	0,05
Muenchener Ruckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	1.200	357	0,04	Eaton Corp. PLC	3.237	389	0,04	Fortescue Metals Group Ltd.	90.148	1.630	0,17
National Australia Bank Ltd.	53.335	931	0,09	Emerson Electric Co.	2.195	176	0,02	International Paper Co.	21.844	1.086	0,11
Natixis S.A. (d)	74.316	255	0,03	Hanwa Co. Ltd.	2.600	70	0,01	JFE Holdings, Inc. (d)	12.300	118	0,01
Navient Corp.	22.606	222	0,02	Hochtief AG	1.836	179	0,02	LyondellBasell Industries NV 'A'	26.901	2.466	0,25
NN Group NV	21.843	946	0,10	Illinois Tool Works, Inc.	623	127	0,01	Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	37.600	228	0,02
Nordea Bank Abp (d)	186.664	1.533	0,16	ITOCHU Corp.	13.600	391	0,04	Mitsubishi Gas Chemical Co., Inc.	6.200	143	0,01
ORIX Corp.	30.200	465	0,05	Kajima Corp.	12.200	164	0,02	Mitsui Chemicals, Inc.	1.900	56	0,01
PNC Financial Services Group, Inc.	1.280	191	0,02	Komatsu Ltd.	23.200	640	0,07	Nitto Denko Corp.	2.800	251	0,03
Power Corp. of Canada	22.124	508	0,05	Kone Oyj 'B'	634	52	0,01	Norsk Hydro ASA	18.010	84	0,01
Principal Financial Group, Inc.	11.090	550	0,06	ManpowerGroup, Inc.	909	82	0,01	Rio Tinto Ltd.	42.370	3.730	0,38
Prudential Financial, Inc.	10.041	784	0,08	Marubeni Corp.	136.800	912	0,09	Rio Tinto PLC	53.704	4.041	0,41
Resona Holdings, Inc.	25.600	90	0,01	Mitsubishi Corp.	125.200	3.087	0,32	Solvay S.A.	1.118	132	0,01
Sampo Oyj 'A'	5.857	251	0,03	Mitsubishi Electric Corp.	12.100	183	0,02	Sumitomo Chemical Co. Ltd.	47.000	189	0,02
Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' (d)	10.186	105	0,01	Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	14.300	438	0,04	Ternium S.A. SP - ADR (d)	3.106	90	0,01
Societe Generale S.A. (d)	20.666	430	0,04	Mitsui & Co. Ltd.	14.200	260	0,03	Ube Industries Ltd.	6.700	122	0,01
Standard Life Aberdeen PLC	116.734	447	0,05	Neilsen Holdings PLC	4.469	93	0,01	UPM-Kymmene Oyj	11.092	414	0,04
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	87.600	2.716	0,28	NSK Ltd.	34.100	297	0,03	voestalpine AG	2.826	101	0,01
Suncorp Group Ltd.	28.248	213	0,02	Rexel S.A. (d)	5.724	90	0,01	WestRock Co.	4.743	206	0,02
Swedbank AB 'A' (d)	71.226	1.252	0,13	Royal Mail PLC	131.842	607	0,06			28.687	2,94
Swiss Re AG	16.174	1.526	0,16	Schneider Electric SE	936	135	0,01	<b>IMMOBILIEN</b>			
U.S. Bancorp	4.173	194	0,02	Siemens AG	5.528	798	0,08	Daito Trust Construction Co. Ltd.	6.000	561	0,05
UnipolSai Assicurazioni SpA	34.492	92	0,01	Signify NV (d)	2.758	116	0,01	Daiwa House Industry Co. Ltd.	2.800	83	0,01
Unum Group	3.575	82	0,01	Sojitz Corp.	102.200	228	0,02			644	0,06
Wells Fargo & Co.	57.022	1.721	0,18	Sumitomo Corp.	93.200	1.235	0,13	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
Westpac Banking Corp.	85.570	1.275	0,13	Union Pacific Corp.	765	159	0,02	AGL Energy Ltd.	38.524	356	0,03
Zurich Insurance Group AG	4.106	1.733	0,18	United Parcel Service, Inc. 'B'	2.592	437	0,04	Centrica PLC (d)	498.228	316	0,03
		36.645	3,76	Wartsila Oyj Abp	28.011	281	0,03	Contact Energy Ltd.	8.430	54	0,01
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>				<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>							
AbbVie, Inc.	70.580	7.563	0,78	Broadcom, Inc.	1.016	445	0,05	Dominion Energy, Inc.	8.816	663	0,07
Amgen, Inc.	4.465	1.027	0,11	Canon, Inc.	175.500	3.400	0,35	Duke Energy Corp.	4.956	454	0,05
Astellas Pharma, Inc.	9.100	141	0,01	Cisco Systems, Inc.	21.921	981	0,10	E.ON SE	22.330	248	0,02
Bayer AG	2.330	137	0,01	Corning, Inc.	5.331	192	0,02	EDP - Energias de Portugal S.A.	19.003	119	0,01
Bristol-Myers Squibb Co.	7.640	474	0,05	Hewlett Packard Enterprise Co.	16.668	198	0,02	Endesa S.A.	21.403	588	0,06
Cardinal Health, Inc.	8.054	431	0,04	Hitachi Ltd.	5.900	233	0,02	Enel SpA	45.690	466	0,05
Eli Lilly & Co.	545	92	0,01	HP, Inc.	15.033	370	0,04	Exelon Corp.	5.726	242	0,02
Gilead Sciences, Inc.	39.813	2.319	0,24	International Business Machines Corp.	51.643	6.501	0,67	Naturgy Energy Group S.A.	36.303	845	0,09
Johnson & Johnson	11.220	1.766	0,18	Juniper Networks, Inc.	5.264	118	0,01	PPL Corp.	27.404	773	0,08
				Konica Minolta, Inc.	41.900	160	0,02	Red Electrica Corp. S.A.	8.509	175	0,02
								Southern Co.	7.404	455	0,05
								SSE PLC	8.321	170	0,02

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
Tohoku Electric Power Co., Inc.	14.500	\$ 120	0,01	<b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>				Weyerhaeuser Co.	5.275	177	0,02
		6.044	0,62	AGNC Investment Corp.	41.217	643	0,06			11.033	1,13
		231.582	23,76	Annaly Capital Management, Inc.	195.037	\$ 1.648	0,17	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
<b>RECHTE</b>				Host Hotels & Resorts, Inc.	6.110	89	0,01	<b>ARGENTINA TREASURY BILLS</b>			
Repsol S.A. - Exp. 26.01.2021	148.996	51	0,01	Iron Mountain, Inc.	33.420	985	0,10	(3,480) % fällig am 13.09.2021 (e)(f)	ARS 75.533	\$ 551	0,06
<b>OPTIONSSCHEINE</b>				Japan Retail Fund Investment Corp.	28	51	0,01	(1,117) % fällig am 21.05.2021 (e)(f)		74.700	550
iHeartMedia, Inc. 'A' - Exp. 01.05.2039	115.548	1.476	0,15	Klepierre S.A.	13.119	296	0,03	(0,275) % fällig am 17.04.2021 (e)(f)		22.687	161
Stearns Holdings LLC 'B' - Exp. 05.11.2039	148.737	0	0,00	Link REIT	5.900	54	0,01	1,782 % fällig am 31.03.2021 (e)(f)		2.800	0,00
Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21.09.2055	2.586	47	0,01	New Residential Investment Corp.	67.566	672	0,07	Summe kurzfristige Instrumente		1.282	0,13
		1.523	0,16	Park Hotels & Resorts, Inc.	38.667	663	0,06	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	1.262.487	129,53
<b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>				RioCan Real Estate Investment Trust	4.335	57	0,01	<b>AKTIEN</b>			
Nationwide Building Society 10,250 %	6.220	1.506	0,15	Simon Property Group, Inc.	5.710	487	0,05	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Schaeffler AG	28.942	242	0,03	Stockland	31.106	100	0,01	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
		1.748	0,18	Unibail-Rodamco-Westfield	18.748	1.464	0,15	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	478.617	4.768	0,49
				Uniti Group, Inc.	2.036	24	0,00	Summe Investmentfonds	\$	4.768	0,49
				Ventas, Inc.	10.558	518	0,05				
				VEREIT, Inc.	4.839	183	0,02				
				VICI Properties, Inc.	114.584	2.922	0,30				

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,00 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 528	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (539)	\$ 528	\$ 528	0,05
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (539)	\$ 528	\$ 528	0,05

(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 March Futures	Short	03.2021	103	\$ (64)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	110	150	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	965	(24)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	14	20	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	76	314	0,03
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2021	9	(17)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 379	0,04

**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<sup>(1)</sup>**

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 300	\$ 18	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2022	€ 1.400	(67)	(0,01)
				\$ (49)	(0,01)

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>**

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-33 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2024	\$ 6.300	\$ (2)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-28 5-Year Index	1,000 %	20.12.2022	\$ 1.880	\$ 84	0,01
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000	20.06.2023	940	25	0,00
CDX.EM-30 5-Year Index	1,000	20.12.2023	4.982	263	0,03
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000	20.06.2024	1.034	44	0,00
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	1.395	65	0,01
CDX.EM-33 5-Year Index	1,000	20.06.2025	2.185	228	0,02
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	2.400	93	0,01
CDX.HY-33 5-Year Index	5,000	20.12.2024	1.175	(16)	0,00
CDX.HY-34 5-Year Index	5,000	20.06.2025	276	25	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000	20.12.2025	2.300	56	0,01
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 11.900	56	0,01
				\$ 923	0,10

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,840 %	03.01.2022	BRL 1.900	\$ 0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,848	03.01.2022	1.600	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,859	03.01.2022	8.100	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,865	03.01.2022	2.900	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,870	03.01.2022	1.200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,880	03.01.2022	1.200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,883	03.01.2022	4.700	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,884	03.01.2022	1.000	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI		2,886	03.01.2022	1.500	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		3,060	03.01.2022	48.200	25	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,830	02.01.2023	10.900	117	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,836	02.01.2023	8.500	91	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI		5,855	02.01.2023	2.800	30	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	17.06.2022	\$ 6.300	(150)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,250	17.06.2027	12.000	31	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,250	17.06.2030	47.620	(3.734)	(0,38)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,500	18.12.2021	800	(14)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,500	18.12.2029	2.000	(179)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,625	16.01.2050	3.100	(189)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,625	03.02.2050	3.900	(228)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,740	16.12.2026	1.100	(73)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,750	15.01.2030	8.600	(650)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,750	22.01.2050	7.600	(672)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,875	07.02.2050	400	(49)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,895	18.10.2049	700	(71)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,910	17.10.2049	700	(75)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,000	10.12.2029	2.600	(263)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,000	12.02.2030	5.000	(461)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,000	10.03.2030	2.500	(269)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,000	15.01.2050	1.400	(212)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,250	11.12.2049	7.100	(1.488)	(0,15)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,250	12.03.2050	3.400	(739)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,500	18.12.2024	6.000	(191)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,500	20.12.2024	10.900	(1.211)	(0,12)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		3,000	19.06.2024	41.600	(2.576)	(0,26)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		3,000	19.06.2026	32.300	(3.448)	(0,35)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		7,250	19.09.2023	ZAR 86.800	(505)	(0,05)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		7,750	19.09.2028	78.300	647	0,07
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		8,000	15.03.2024	5.100	(44)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		8,250	15.03.2024	22.800	(189)	(0,02)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		2,750	17.06.2026	AUD 460	42	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		3,000	21.03.2027	18.640	1.918	0,20
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		3,250	17.12.2024	1.600	90	0,01
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		3,500	17.06.2025	19.492	1.187	0,12
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,250	17.12.2024	650	24	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,750	18.06.2024	400	7	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,150	18.03.2030	€ 6.200	(216)	(0,02)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,250	18.03.2050	2.300	(362)	(0,04)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,250	17.03.2031	£ 7.200	(53)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR		0,000	15.03.2029	¥ 3.500.000	(8)	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month JPY-LIBOR		0,020	20.09.2028	5.480.000	22	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE		4,580	10.06.2022	MXN 21.800	(5)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE		4,650	10.05.2022	84.100	(24)	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	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		5,095	05.02.2021	28.800	98	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIE		5,120	06.05.2025	10.800	12	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		5,160	06.06.2025	9.300	10	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		5,280	23.05.2025	3.700	5	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		5,280	30.05.2025	9.000	12	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		5,430	17.11.2021	2.900	11	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		5,535	04.05.2027	18.500	32	0,00

Zahlung/ Erhalt/ variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,610 %	07.07.2021	MXN 4.200	\$ 13	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,615	21.05.2021	12.600	38	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,680	28.05.2021	4.800	14	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,780	29.09.2022	12.930	59	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,795	02.06.2023	3.600	19	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,798	06.09.2021	20.000	63	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,810	02.05.2022	1.200	5	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,850	02.05.2022	5.300	21	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,900	20.07.2021	24.700	70	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,950	30.01.2026	12.300	95	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,980	26.08.2024	500	3	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,990	30.01.2026	15.000	115	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	10.03.2026	20.700	159	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,350	01.09.2023	3.300	16	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,490	08.09.2026	13.700	104	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,620	18.02.2030	600	5	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,710	20.09.2029	500	4	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,750	31.08.2021	7.900	14	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,150	11.06.2027	28.100	210	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,165	06.09.2032	3.000	28	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	22	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,350	17.11.2021	2.300	3	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,360	21.08.2037	3.100	31	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,370	11.10.2027	14.800	110	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,380	04.11.2026	400	3	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,380	14.08.2037	700	(8)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,388	17.11.2021	1.800	2	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,480	18.06.2037	1.300	13	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,520	18.04.2023	30.200	110	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,530	18.04.2023	24.900	90	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,530	21.04.2023	3.100	11	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,538	23.02.2022	9.800	13	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,545	18.04.2023	19.100	69	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,603	14.04.2025	49.000	292	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	23.01.2023	18.100	67	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	15.04.2025	3.000	18	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,640	03.01.2023	2.200	7	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,645	03.01.2023	4.900	17	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,670	05.03.2025	52.900	325	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,700	02.05.2023	7.100	29	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,710	07.03.2025	6.400	39	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,715	07.03.2025	6.300	38	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,745	05.01.2023	3.400	12	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,800	28.12.2027	2.900	(25)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,805	06.02.2023	7.800	29	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,818	17.02.2027	11.400	74	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,820	06.02.2023	7.900	31	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,865	27.12.2022	5.000	17	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,865	02.02.2027	11.900	78	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,875	16.12.2022	2.800	10	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,880	27.12.2022	79.700	242	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,910	30.12.2027	600	(5)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,984	10.12.2027	6.800	(61)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,990	21.12.2027	100	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,005	21.12.2027	37.500	(318)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,010	04.02.2027	5.200	33	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,030	31.01.2028	4.600	(43)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,050	31.01.2028	3.400	(33)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,090	15.01.2027	13.000	81	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,103	04.01.2038	5.600	(73)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,120	15.01.2027	2.700	17	0,00
					\$ (11.528)	(1,18)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (10.656)</b>	<b>(1,09)</b>

(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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

# 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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500 %	17.03.2021	3.038	\$ (2)	\$ 0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	3.584	(3)	0	0,00
						\$ (5)	\$ 0	0,00

### DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC USD versus CNH	CNH 6,520	14.01.2021	816	\$ (3)	\$ (5)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6,780	14.01.2021	816	(3)	0	0,00
GLM	Put - OTC USD versus CNH	6,534	15.01.2021	653	(3)	(5)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6,792	15.01.2021	653	(2)	0	0,00
HUS	Put - OTC USD versus CNH	6,530	05.02.2021	1.142	(6)	(10)	(0,01)
	Call - OTC USD versus CNH	6,800	05.02.2021	1.142	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC USD versus CNH	6,510	08.02.2021	858	(4)	(6)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6,810	08.02.2021	858	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC USD versus CNH	6,450	19.02.2021	852	(4)	(4)	0,00
SCX	Call - OTC USD versus CNH	6,700	19.02.2021	852	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC USD versus CNH	6,400	09.03.2021	1.705	(6)	(6)	0,00
	Call - OTC USD versus CNH	6,680	09.03.2021	1.705	(9)	(6)	0,00
					\$ (53)	\$ (46)	(0,01)

### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,131 %	19.01.2021	900	\$ (10)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,491	19.01.2021	900	(10)	(6)	0,00
							\$ (20)	\$ (7)	0,00

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	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
BPS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	(6)	13	7	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)	208	39	0,01
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	(9)	6	(3)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	200	(2)	5	3	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	2	5	7	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.300	(22)	46	24	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)	6	(3)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	(19)	36	17	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	(7)	21	14	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2021	13	(4)	4	0	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2022	3.920	(86)	136	50	0,01
	Russia Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.500	9	11	20	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(5)	4	(1)	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)	37	(1)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	3.200	(50)	111	61	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)	55	26	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	200	(3)	7	4	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.400	(87)	82	(5)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	800	(44)	36	(8)	0,00
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.800	(18)	67	49	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	1.800	(25)	42	17	0,00
	Russia Government International Bond	1,000	20.06.2023	2.800	(53)	92	39	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2022	4.600	(96)	106	10	0,00
					\$ (814)	\$ 1.186	\$ 372	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110 %	25.05.2046	\$ 476	\$ (94)	\$ 72	\$ (22)	0,00
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(6)	11	5	0,00
	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17.01.2047	397	(18)	22	4	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	2.200	(138)	165	27	0,00
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	823	(13)	18	5	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)	216	208	0,02
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	7.300	(38)	123	85	0,01
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	823	4	0	4	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	6.400	(361)	439	78	0,01
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	300	(12)	16	4	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	8	4	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)	55	8	0,00
MYC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	754	(148)	112	(36)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	8	4	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	366	(8)	10	2	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	10	27	0,01
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	1.200	6	8	14	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	0	2	2	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	15.498	15	195	210	0,02
UAG	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	7	1	0,00
					\$ (885)	\$ 1.523	\$ 638	0,07

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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
AZD	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,445 %	17.06.2025	CNY 17.500	\$ 0	\$ (22)	\$ (22)	0,00
CBK	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,845	23.01.2025	2.000	0	3	3	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,850	23.01.2025	2.900	0	4	4	0,00
UAG	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,833	23.01.2025	3.000	0	4	4	0,00
						\$ 0	\$ (11)	\$ (11)	0,00

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	BRL 1.684	\$ 324	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	¥ 38.058	\$ 366	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 332	BRL 1.684	0	(8)	(8)	0,00
	01.2021	243	MXN 5.119	14	0	14	0,00
	01.2021	779	ZAR 12.215	51	0	51	0,01
	02.2021	2.781	NOK 25.920	246	0	246	0,03
	02.2021	2.521	SEK 21.850	141	0	141	0,01
	02.2021	111	TRY 847	1	0	1	0,00
	03.2021	5.196	INR 390.876	115	0	115	0,01
BPS	01.2021	€ 535	\$ 655	1	0	1	0,00
	01.2021	\$ 3.184	AUD 4.329	156	0	156	0,02
	01.2021	146	TRY 1.127	5	0	5	0,00
	01.2021	ZAR 3.479	\$ 238	1	0	1	0,00
	03.2021	\$ 4.122	IDR 58.803.270	81	0	81	0,01
BRC	01.2021	374	TRY 2.905	14	0	14	0,00
	01.2021	ZAR 1.772	\$ 121	1	0	1	0,00
	02.2021	\$ 231	TRY 1.775	5	0	5	0,00
CBK	01.2021	¥ 3.710	\$ 36	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 487	RUB 37.454	19	0	19	0,00
	01.2021	8	TRY 60	0	0	0	0,00
	01.2021	1.618	ZAR 25.201	94	0	94	0,01
	01.2021	ZAR 9.480	\$ 634	0	(10)	(10)	0,00
	02.2021	PEN 1.285	\$ 359	3	0	3	0,00
	02.2021	\$ 2.306	MXN 52.970	342	0	342	0,04
	02.2021	2.431	NOK 22.305	174	0	174	0,02
	02.2021	591	RUB 43.511	0	(5)	(5)	0,00
	02.2021	2.711	SEK 23.840	194	0	194	0,02
	02.2021	195	TRY 1.493	3	(1)	2	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
FBF	05.2021	PEN 499	\$ 139	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	02.2021	\$ 561	TRY 4.361	16	0	16	0,00
GLM	01.2021	BRL 1.684	\$ 331	7	0	7	0,00
	01.2021	\$ 324	BRL 1.684	0	0	0	0,00
	01.2021	754	¥ 78.041	2	0	2	0,00
	01.2021	1.213	MXN 25.555	68	0	68	0,01
	01.2021	609	RUB 46.626	21	0	21	0,00
	01.2021	133	TRY 1.031	5	0	5	0,00
	01.2021	ZAR 9.168	\$ 614	0	(8)	(8)	0,00
	02.2021	¥ 78.041	754	0	(2)	(2)	0,00
	02.2021	NZD 10.557	7.198	0	(405)	(405)	(0,04)
	02.2021	\$ 331	BRL 1.684	0	(7)	(7)	0,00
	02.2021	697	RUB 53.199	20	0	20	0,00
	02.2021	196	TRY 1.495	3	(1)	2	0,00
	05.2021	167	MXN 3.596	10	0	10	0,00
HUS	01.2021	BRL 23.582	\$ 4.660	120	0	120	0,01
	01.2021	£ 40.492	54.155	0	(1.198)	(1.198)	(0,12)
	01.2021	¥ 6.854	66	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 4.558	BRL 23.582	1	(19)	(18)	0,00
	01.2021	4.161	€ 3.473	88	0	88	0,01
	01.2021	873	£ 645	9	0	9	0,00
	01.2021	2.013	ZAR 31.523	128	0	128	0,01
	01.2021	ZAR 1.716	\$ 117	0	0	0	0,00
	02.2021	PEN 5.830	1.600	0	(12)	(12)	0,00
	02.2021	\$ 4.658	BRL 23.582	0	(119)	(119)	(0,01)
	02.2021	1.579	RUB 117.591	8	(4)	4	0,00
	02.2021	38	TRY 283	0	0	0	0,00
	03.2021	6.917	MXN 150.429	578	0	578	0,06
	05.2021	4.914	103.154	189	0	189	0,02
JPM	01.2021	796	CLP 626.330	85	0	85	0,01
	01.2021	110	MXN 2.269	4	0	4	0,00
	01.2021	136	RUB 10.412	5	0	5	0,00
	01.2021	679	TRY 5.275	28	0	28	0,00
	01.2021	ZAR 1.888	\$ 129	0	0	0	0,00
	02.2021	\$ 622	TRY 4.812	14	(1)	13	0,00
	05.2021	788	MXN 16.918	48	0	48	0,01
MYI	01.2021	329	€ 268	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	293	TRY 2.266	12	0	12	0,00
	01.2021	860	ZAR 13.189	36	0	36	0,00
	02.2021	7.075	NZD 10.273	324	0	324	0,03
	02.2021	105	TRY 798	0	0	0	0,00
RBC	01.2021	ZAR 2.018	\$ 137	0	0	0	0,00
RYL	02.2021	\$ 218	TRY 1.657	1	0	1	0,00
SCX	05.2021	197	MXN 4.230	12	0	12	0,00
	01.2021	€ 52.048	\$ 62.332	0	(1.351)	(1.351)	(0,14)
	01.2021	227	TRY 1.746	7	0	7	0,00
	01.2021	ZAR 19.469	\$ 1.320	2	(5)	(3)	0,00
	02.2021	€ 52.048	63.726	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$ 188	RUB 14.407	6	0	6	0,00
	02.2021	315	TRY 2.384	2	(2)	0	0,00
SSB	01.2021	3.539	BRL 18.789	78	0	78	0,01
	01.2021	190	ZAR 2.915	8	0	8	0,00
TOR	01.2021	¥ 29.418	\$ 282	0	(3)	(3)	0,00
	02.2021	42	TRY 319	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	136	MXN 2.710	0	0	0	0,00
	01.2021	90	RUB 6.870	3	0	3	0,00
	01.2021	611	TRY 4.738	23	0	23	0,00
	01.2021	ZAR 4.681	\$ 315	0	(3)	(3)	0,00
	02.2021	\$ 3.046	RUB 228.919	42	(5)	37	0,00
	02.2021	38	TRY 297	1	0	1	0,00
				\$ 3.676	\$ (3.175)	\$ 501	0,05

### ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	€ 16.710	\$ 20.240	\$ 4	\$ (211)	\$ (207)	(0,02)
	01.2021	¥ 1.046.236	10.062	0	(72)	(72)	(0,01)
BPS	01.2021	\$ 15.975	€ 13.333	340	0	340	0,03
	01.2021	€ 3.664	\$ 4.466	1	(18)	(17)	0,00
	01.2021	\$ 241.928	€ 202.006	5.236	0	5.236	0,54
	01.2021	¥ 17.939	¥ 1.857.112	49	0	49	0,01
	01.2021	975	SGD 1.293	4	0	4	0,00
	02.2021	¥ 1.857.112	\$ 17.944	0	(49)	(49)	(0,01)
	02.2021	SGD 1.293	975	0	(4)	(4)	0,00
BRC	01.2021	€ 1.908	2.334	5	(6)	(1)	0,00
	01.2021	INR 14.778	197	0	(5)	(5)	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
	01.2021	\$ 201	INR 14.778	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	02.2021	INR 14.813	\$ 200	0	(2)	(2)	0,00
CBK	01.2021	¥ 110.820	\$ 1.064	0	(10)	(10)	0,00
	01.2021	SGD 1.293	960	0	(18)	(18)	0,00
	01.2021	ZAR 7.961	522	0	(19)	(19)	0,00
MYI	01.2021	CHF 7.653	8.450	0	(208)	(208)	(0,02)
	01.2021	€ 1.432	1.736	0	(16)	(16)	0,00
	01.2021	SEK 23.714	2.798	0	(90)	(90)	(0,01)
	01.2021	\$ 1.894	€ 1.553	6	0	6	0,00
RBC	01.2021	HKD 18.902	\$ 2.438	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 2.438	HKD 18.902	0	0	0	0,00
	02.2021	HKD 18.905	\$ 2.439	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	AUD 4.615	3.395	0	(167)	(167)	(0,02)
	01.2021	£ 6.844	9.148	0	(207)	(207)	(0,02)
	01.2021	\$ 308.645	€ 257.718	6.685	0	6.685	0,68
	02.2021	462.634	377.849	0	(2)	(2)	0,00
SSB	01.2021	€ 653	\$ 794	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	\$ 6.389	€ 5.266	55	0	55	0,01
	02.2021	DKK 9.487	\$ 1.531	0	(29)	(29)	0,00
TOR	01.2021	CAD 8.772	6.771	0	(114)	(114)	(0,01)
	01.2021	¥ 700.057	6.711	0	(70)	(70)	(0,01)
	01.2021	\$ 6.885	CAD 8.772	0	0	0	0,00
	01.2021	291.008	€ 242.991	6.303	0	6.303	0,64
	02.2021	CAD 8.772	\$ 6.886	0	0	0	0,00
	02.2021	\$ 395.852	€ 323.306	0	(2)	(2)	0,00
UAG	01.2021	AUD 1.473	\$ 1.082	0	(55)	(55)	(0,01)
	01.2021	€ 1.259	1.536	1	(5)	(4)	0,00
	01.2021	ILS 706	213	0	(7)	(7)	0,00
				\$ 18.691	\$ (1.390)	\$ 17.301	1,77
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 18.748	1,92
Summe Anlagen						\$ 1.276.254	130,94
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (301.590)	(30,94)
Nettovermogen						\$ 974.664	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) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
- (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.
- (i) Mit dem Fonds verbunden.
- (j) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (k) Eingeschrankte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
General Motors Co. 6,800 % fallig am 01.10.2027	07.05.2020	\$ 67	\$ 86	0,01
Morgan Stanley 7,500 % fallig am 02.04.2032	11.02.2020	598	603	0,06
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	278	784	0,08
Noble Corp. PLC	23.12.2020	0	86	0,01
		\$ 943	\$ 1.559	0,16

(l) Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 52.324 als Sicherheiten verpfandet.

(m) Gema den Rahmenvertragen fur Wertpapier-Termingeschafte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.856 als Sicherheiten fur verzogert gelieferte Wertpapiere oder Ruckkauf-Finanzierungsgeschafte verpfandet oder geliefert.

Barmittel in Hohe von USD 11.600 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Hohe von USD 304 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Strategic Income Fund (Forts.)

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	379	8.092	0	8.471
<b>Summen</b>	<b>\$ 129.632</b>	<b>\$ 1.140.908</b>	<b>\$ 5.714</b>	<b>\$ 1.276.254</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 140.807	\$ 1.146.009	\$ 2.272	\$ 1.289.088
Investmentfonds	84.639	0	0	84.639
Pensionsgeschäfte	0	3.161	0	3.161
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(899)	13.037	0	12.138
<b>Summen</b>	<b>\$ 224.547</b>	<b>\$ 1.162.207</b>	<b>\$ 2.272</b>	<b>\$ 1.389.026</b>

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
GRE	0,160 %	14.12.2020	25.01.2021	\$ (43.280)	\$ (43.284)	(4,44)
	0,160	17.12.2020	19.01.2021	(5.665)	(5.665)	(0,58)
	0,170	03.11.2020	03.02.2021	(3.592)	(3.593)	(0,37)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (52.542)</b>	<b>(5,39)</b>

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	% des Nettovermögens
BPG	0,140 %	24.11.2020	05.01.2021	\$ (746)	\$ (745)	(0,07)
MSC	0,140	14.12.2020	15.01.2021	(1.729)	(1.729)	(0,18)
TDM	0,160	15.12.2020	25.01.2021	(392)	(392)	(0,04)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (2.866)</b>	<b>(0,29)</b>

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
AZD	\$ (22)	\$ 0	\$ (22)
BOA	592	(380)	212
BPS	5.470	(6.520)	(1.050)
BRC	15	0	15
CBK	844	(840)	4
DUB	36	(290)	(254)
FBF	22	0	22
GLM	(292)	300	8
GST	476	(340)	136
HUS	(192)	(70)	(262)
JPM	200	0	200
MEI	14	0	14
MYC	79	(76)	3
MYI	63	(20)	43
RYL	13	0	13
SAL	253	(260)	(7)
SCX	4.955	(6.240)	(1.285)
SSB	108	0	108
TOR	6.114	(7.650)	(1.536)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	64,44	59,58
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	59,53	50,60
Sonstige übertragbare Wertpapiere	5,56	k. A.
Investmentfonds	0,49	7,24
Pensionsgeschäfte	0,05	0,27
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	(0,08)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,09)	(0,19)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,92	1,31
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(5,39)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,29)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	3,18	1,67
Unternehmensanleihen und Wechsel	28,81	19,39
Wandelanleihen & Wechsel	k. A.	0,02
Kommunalanleihen und Wechsel	0,22	0,27
US-Regierungsbehörden	32,58	22,26
US-Schatzobligationen	13,05	12,09
Non-Agency-MBS	6,49	7,61
Forderungsbesicherte Wertpapiere	13,56	13,86
Staatsemissionen	6,27	3,06
Stammaktien	23,76	24,50
Bezugsrechte	0,01	k. A.
Optionsscheine	0,16	0,17
Vorzugswertpapiere	0,18	0,30
Real Estate Investment Trusts	1,13	0,38
Kurzfristige Instrumente	0,13	4,60
Investmentfonds	0,49	7,24
Pensionsgeschäfte	0,05	0,27
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,04	(0,08)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,10	(0,04)
Zinsswaps	(1,18)	(0,14)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Devisenoptionen	(0,01)	k. A.
Zinsswapoptionen	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,07	0,06
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,05	(0,10)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,77	1,32
Sonstige Aktiva und Passiva	(30,94)	(18,73)
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
SATO Oyj 1,375 % fällig am 24.02.2028	€	2.600	0,05	Boardwalk Pipelines LP 3,400 % fällig am 15.02.2031	\$	7.700	0,12	Johnson & Johnson 0,550 % fällig am 01.09.2025	\$	9.400	0,15
Shinhan Bank Co. Ltd. 0,250 % fällig am 16.10.2024		14.000	0,27	Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026		19.000	0,31	Kansas City Southern 3,125 % fällig am 01.06.2026		7.050	0,12
SMBC Trust Account 1,430 % fällig am 09.04.2021	\$	30.000	0,47	Broadcom, Inc. 3,459 % fällig am 15.09.2026		12.716	0,22	Latam Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.08.2029		15.916	0,23
Societe Generale S.A. 1,488 % fällig am 14.12.2026		14.100	0,22	4,110 % fällig am 15.09.2028		12.732	0,23	Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	£	7.500	0,16
Society of Lloyd's 4,750 % fällig am 30.10.2024	£	19.600	0,47	4,300 % fällig am 15.11.2032		5.400	0,09	Microchip Technology, Inc. 3,922 % fällig am 01.06.2021	\$	6.200	0,10
Standard Chartered PLC 4,247 % fällig am 20.01.2023	\$	1.800	0,03	5,000 % fällig am 15.04.2030		2.200	0,04	Motorola Solutions, Inc. 2,300 % fällig am 15.11.2030		12.400	0,20
Stifel Financial Corp. 4,000 % fällig am 15.05.2030		12.900	0,23	Burberry Group PLC 1,125 % fällig am 21.09.2025	£	4.000	0,09	NetApp, Inc. 1,875 % fällig am 22.06.2025		9.154	0,15
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,474 % fällig am 08.07.2025		15.500	0,25	Campbell Soup Co. 4,150 % fällig am 15.03.2028	\$	1.600	0,03	2,700 % fällig am 22.06.2030		5.200	0,09
Tesco Property Finance PLC 5,744 % fällig am 13.04.2040	£	4.982	0,15	Centene Corp. 4,625 % fällig am 15.12.2029		5.000	0,09	Netflix, Inc. 4,625 % fällig am 15.05.2029	€	1.700	0,04
5,801 % fällig am 13.10.2040		2.233	0,07	CenterPoint Energy Resources Corp. 3,550 % fällig am 01.04.2023		9.000	0,15	Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % fällig am 17.09.2030	\$	15.800	0,28
UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)	\$	21.200	0,36	Central Nippon Expressway Co. Ltd. 0,681 % fällig am 15.02.2022		27.200	0,42	Novartis Finance S.A. 0,000 % fällig am 23.09.2028 (d)	€	8.000	0,15
UBS Group AG 5,125 % fällig am 29.07.2026 (f)(h)		1.300	0,02	0,774 % fällig am 02.11.2021		8.750	0,14	Nutrition & Biosciences, Inc. 2,300 % fällig am 01.11.2030	\$	11.900	0,19
UDR, Inc. 4,000 % fällig am 01.10.2025		4.500	0,08	2,362 % fällig am 28.05.2021		20.400	0,32	NXP BV 3,875 % fällig am 18.06.2026		9.900	0,18
UniCredit SpA 2,200 % fällig am 22.07.2027	€	9.700	0,20	2,567 % fällig am 02.11.2021		46.600	0,74	4,625 % fällig am 01.06.2023		1.979	0,03
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$	26.900	0,50	Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	€	17.000	0,33	Pan American Energy LLC 38,606 % fällig am 26.02.2021	ARS	2.186	0,00
Unipol Gruppo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2030	€	20.900	0,42	1,000 % fällig am 31.07.2031		10.200	0,20	Pearson Funding PLC 3,750 % fällig am 04.06.2030	£	4.500	0,11
Vesteda Finance BV 1,500 % fällig am 24.05.2027		3.400	0,07	Charter Communications Operating LLC 4,464 % fällig am 23.07.2022	\$	14.700	0,24	Royalty Pharma PLC 1,200 % fällig am 02.09.2025	\$	3.000	0,05
Volkswagen Bank GmbH 0,955 % fällig am 01.08.2022		1.300	0,02	4,908 % fällig am 23.07.2025		17.900	0,32	SEB S.A. 1,375 % fällig am 16.06.2025	€	5.000	0,10
1,250 % fällig am 01.08.2022		4.800	0,09	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5,125 % fällig am 30.06.2027		8.700	0,16	Sprint Spectrum Co. LLC 4,738 % fällig am 20.09.2029	\$	2.925	0,05
1,875 % fällig am 31.01.2024		34.600	0,69	Choice Hotels International, Inc. 3,700 % fällig am 01.12.2029		1.500	0,03	Stora Enso Oyj 0,625 % fällig am 02.12.2030	€	4.400	0,08
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£	15.400	0,33	Conagra Brands, Inc. 4,300 % fällig am 01.05.2024		4.800	0,08	Sutter Health 2,294 % fällig am 15.08.2030		12.700	0,21
1,625 % fällig am 30.11.2022		7.600	0,16	CVS Health Corp. 2,625 % fällig am 15.08.2024		5.300	0,09	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€	12.200	0,25
Volkswagen Leasing GmbH 1,000 % fällig am 16.02.2023	€	2.100	0,04	3,000 % fällig am 15.08.2026		3.600	0,06	4,738 % fällig am 20.09.2029	\$	6.100	0,10
Wells Fargo & Co. 2,393 % fällig am 02.06.2028	\$	5.500	0,09	D.R. Horton, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2023		4.900	0,08	4,441 % fällig am 24.04.2023		3.600	0,06
3,000 % fällig am 22.04.2026		1.600	0,03	Daimler Finance North America LLC 2,300 % fällig am 12.02.2021		25.500	0,40	Sysco Corp. 5,650 % fällig am 01.04.2025		8.097	0,15
3,750 % fällig am 24.01.2024		11.900	0,20	2,550 % fällig am 15.08.2022		18.900	0,30	T-Mobile USA, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2030		3.175	0,06
		1.692.795	26,34	3,350 % fällig am 04.05.2021		15.300	0,24	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 2,050 % fällig am 31.03.2030		7.700	0,12
				Dell International LLC 5,450 % fällig am 15.06.2023		17.200	0,30	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,250 % fällig am 31.03.2023	€	3.400	0,06
				Delta Air Lines Pass-Through Trust 2,000 % fällig am 10.12.2029		3.589	0,06	6,000 % fällig am 15.04.2024	\$	15.700	0,26
				Emory University 2,143 % fällig am 01.09.2030		10.400	0,17	Tornator Oyj 1,250 % fällig am 14.10.2026	€	5.600	0,11
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Energy Transfer Operating LP 4,500 % fällig am 15.04.2024		5.300	0,09	United Airlines Pass-Through Trust 2,875 % fällig am 07.04.2030	\$	3.702	0,06
AbbVie, Inc. 0,691 % fällig am 19.11.2021		7.600	0,12	EQM Midstream Partners LP 4,750 % fällig am 15.07.2023		8.660	0,14	VMware, Inc. 2,950 % fällig am 21.08.2022		17.000	0,27
2,150 % fällig am 19.11.2021		7.600	0,12	Expedia Group, Inc. 3,800 % fällig am 15.02.2028		3.790	0,06	Volkswagen Group of America Finance LLC 4,750 % fällig am 13.11.2028		3.000	0,06
3,450 % fällig am 15.03.2022		3.600	0,06	Full House Resorts, Inc. 8,575 % fällig am 02.02.2024		2.909	0,04	Walt Disney Co. 2,650 % fällig am 13.01.2031		6.200	0,11
Activision Blizzard, Inc. 2,500 % fällig am 15.09.2050		2.900	0,04	9,738 % fällig am 02.02.2024		243	0,00	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 0,989 % fällig am 19.03.2021		2.694	0,04
Altice France S.A. 7,375 % fällig am 01.05.2026		500	0,01	General Motors Co. 6,125 % fällig am 01.10.2025 (i)		11.900	0,22			883.991	13,76
Amdocs Ltd. 2,538 % fällig am 15.06.2030		7.600	0,12	Global Switch Finance BV 1,375 % fällig am 07.10.2030	€	1.700	0,03	<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>			
Amgen, Inc. 2,800 % fällig am 19.08.2026		11.750	0,20	Gray Oak Pipeline LLC 3,450 % fällig am 15.10.2027	\$	12.600	0,20	Alabama Power Co. 1,450 % fällig am 15.09.2030		4.500	0,07
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,500 % fällig am 01.06.2050		12.700	0,25	Hyatt Hotels Corp. 3,225 % fällig am 01.09.2022		6.000	0,09	AT&T, Inc. 1,650 % fällig am 01.02.2028		18.100	0,29
Arrow Electronics, Inc. 4,500 % fällig am 01.03.2023		7.300	0,12	Imperial Brands Finance PLC 3,125 % fällig am 26.07.2024		12.000	0,20	2,300 % fällig am 01.06.2027		9.500	0,16
Auchan Holding S.A. 3,250 % fällig am 23.07.2027	€	1.300	0,03	Informa PLC 2,125 % fällig am 06.10.2025	€	15.300	0,31	2,750 % fällig am 01.06.2031		4.800	0,08
Babcock International Group PLC 1,375 % fällig am 13.09.2027		8.300	0,16	International Flavors & Fragrances, Inc. 3,200 % fällig am 01.05.2023	\$	5.400	0,09	3,300 % fällig am 01.02.2052		11.900	0,18
Bacardi Ltd. 4,450 % fällig am 15.05.2025	\$	15.300	0,27	Japan Tobacco, Inc. 2,000 % fällig am 13.04.2021		1.000	0,02				
Bayer U.S. Finance LLC 1,227 % fällig am 15.12.2023		8.000	0,13								
3,500 % fällig am 25.06.2021		2.000	0,03								
BMW Finance NV 2,250 % fällig am 12.08.2022		4.800	0,08								







BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (g)	20.179.454	\$ 201.028	3,13
		294.026	4,58
<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	3.260.360	331.536	5,16
Summe Investmentfonds		\$625.562	9,74

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOS	0,100 %	04.01.2021	05.01.2021	\$ 56.200	U.S. Treasury Bonds 1,125 % fällig am 15.08.2040	\$ (57.402)	\$ 56.200	\$ 56.200	0,87
	0,110	31.12.2020	04.01.2021	58.200	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045	(59.613)	58.200	58.201	0,91
FICC	0,000	31.12.2020	04.01.2021	5.063	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	(5.164)	5.063	5.063	0,08
RDR	0,070	31.12.2020	04.01.2021	8.200	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 15.02.2022	(8.377)	8.200	8.200	0,13
SAL	0,070	31.12.2020	04.01.2021	8.500	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 31.12.2022	(8.674)	8.500	8.500	0,13
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (139.230)	\$ 136.163	\$ 136.164	2,12

(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 March Futures	Short	03.2021	1.831	\$ 585	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2021	505	122	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	8.234	137	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2021	166	368	0,01
				\$ 1.212	0,02
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 1.212	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<sup>(1)</sup>**

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 8.300	\$ 507	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	4.700	60	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	5.500	134	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 14.500	1.176	0,02
Ryder System, Inc.	1,000	20.12.2023	\$ 1.500	53	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2022	€ 5.000	177	0,00
				\$ 2.107	0,03

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>**

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 15.500	\$ (342)	(0,01)
CDX.IG-35 5-Year Index	(1,000)	20.12.2025	128.000	(352)	(0,01)
				\$ (694)	(0,02)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Total Return Bond Fund (Forts.)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 34 5-Year Index	5,000 %	20.12.2025	€ 39.300	\$ 2.628	0,04
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	26.500	196	0,01
				\$ 2.824	0,05

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,850 %	03.01.2022	BRL 230.200	\$ (5)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859	03.01.2022	154.000	(11)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,870	03.01.2022	52.100	(3)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,871	03.01.2022	83.000	(6)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,883	03.01.2022	90.000	(11)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	3.119.300	4.267	0,07
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	CAD 15.700	276	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,800	22.08.2023	\$ 134.700	13.590	0,22
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051	£ 86.500	(213)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,036	10.03.2038	¥ 1.365.000	(409)	(0,01)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,040	10.03.2038	1.365.000	(400)	(0,01)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,062	18.09.2026	3.550.000	(60)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,063	19.09.2026	1.337.000	(24)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,064	19.09.2026	1.337.000	(24)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,068	18.09.2026	2.220.000	(46)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,087	20.09.2026	669.000	(21)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,088	17.09.2026	1.980.000	(61)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,092	13.09.2026	1.330.000	(45)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,095	13.09.2026	2.670.000	(95)	0,00
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,097	24.09.2026	1.627.000	(63)	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	18.03.2026	14.320.000	(1.743)	(0,03)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	3.540.000	(1.058)	(0,02)
Zahlung	6-Month JPY-LIBOR	0,380	18.06.2028	9.710.000	2.376	0,04
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,399	18.06.2028	1.270.000	(376)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,450	20.03.2029	2.460.000	(721)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,705	31.10.2038	1.180.000	(1.051)	(0,02)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,750	20.03.2038	8.106.000	(7.998)	(0,12)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,750	20.12.2038	1.947.000	(1.795)	(0,03)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,785	12.11.2038	600.000	(580)	(0,01)
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,800	22.10.2038	400.000	(397)	(0,01)
					\$ 3.293	0,06
					\$ 7.530	0,12

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 in Höhe des Nennwerts 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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	13.500	\$ 1.520	\$ 1.490	0,02

### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175 %	15.03.2023	40.500	\$ (1.490)	\$ (1.486)	(0,02)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 101,563	07.01.2021	7,600	\$ (26)	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	101,672	07.01.2021	19,000	(64)	0	0,00
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,906	11.03.2021	5,500	(19)	(38)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2051	103,594	14.01.2021	19,000	(73)	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	9,600	(16)	(9)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	13,900	(33)	(63)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	99,688	04.02.2021	11,500	(69)	(58)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,266	04.02.2021	11,800	(28)	(27)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,125	04.03.2021	12,400	(39)	(13)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,141	04.03.2021	2,800	(9)	(3)	0,00
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	104,141	04.03.2021	2,800	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,406	04.02.2021	18,400	(57)	(74)	0,00
					\$ (437)	\$ (289)	0,00

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

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	Russia Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 10,900	\$ 70	\$ 76	\$ 146	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	11,600	(496)	285	(211)	0,00
JPM	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(5)	4	(1)	0,00
					\$ (431)	\$ 365	\$ (66)	0,00

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	01.2021	AUD	\$	10.537	\$ 0	\$ (475)	(0,01)
	01.2021	CZK		1.883	81	(7)	0,00
	01.2021	\$	PLN	39	151	2	0,00
	02.2021	CZK	\$	3.977	178	(7)	0,00
	02.2021	NOK		65.310	7.268	(359)	(0,01)
	03.2021	HKD		18.256	2.355	0	0,00
	03.2021	INR		8.768	117	(3)	0,00
BPS	01.2021	£		576	774	(13)	(13)
	01.2021	\$	CAD	9.472	12.178	87	87
	01.2021		€	1.216	1.003	11	11
	01.2021		£	4.407	3.265	57	57
	01.2021		MXN	4.216	83.603	0	(28)
	01.2021		PLN	13	51	1	1
	03.2021	SGD	\$	321	238	(5)	(5)
BRC	01.2021	£		1.044	1.402	(25)	(25)
	01.2021	\$	£	3.847	2.856	57	57
CBK	01.2021	CZK	\$	1.753	76	(6)	(6)
	01.2021	PEN		63.121	17.519	66	66
	01.2021	\$	€	1.431	1.186	20	20
	01.2021		£	3.265	2.443	74	74
	01.2021		PLN	3	12	0	0
	02.2021	PEN	\$	3.696	1.026	4	4
	03.2021	\$	MXN	291	5.951	5	5
DUB	03.2021	PEN	\$	37.546	10.479	98	98
GLM	01.2021	\$	MXN	2.152	42.725	0	(12)
	02.2021		NOK	7.194	63.235	191	191
	02.2021		RUB	8	621	0	0
	03.2021	PEN	\$	30.660	8.485	8	8
HUS	01.2021	€		5.089	6.098	0	(130)
	01.2021	£		370.508	495.414	0	(11.068)
	01.2021	HKD		100	13	0	0
	01.2021	MXN		154.445	7.649	0	(87)
	01.2021	\$	AUD	13.057	17.616	537	537
	01.2021		CAD	8.195	10.496	44	44
	01.2021		PLN	33	127	1	1
	02.2021	¥	\$	486.377	4.634	0	(79)
	02.2021	\$	RUB	6	413	0	0
	02.2021		CZK	4	80	0	0
IND	01.2021	AUD	\$	16.653	12.253	0	(598)
JPM	01.2021	\$	CAD	3.610	4.617	14	14
	01.2021		€	30	25	0	0

## 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	01.2021	CHF	28	32	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	€	1.754	2.155	8	0	0,00
	01.2021	£	1.208	1.640	0	(11)	0,00
	01.2021	HKD	108	14	0	0	0,00
	01.2021	SGD	51	39	0	0	0,00
	01.2021	\$	77	€ 63	0	0	0,00
	01.2021		199	£ 146	1	0	0,00
	01.2021		17	SGD 23	0	0	0,00
	01.2021		3.077	MXN 61.297	0	(7)	0,00
	03.2021	TWD	4.330	\$ 154	0	(2)	0,00
SCX	01.2021	AUD	9.724	7.163	0	(340)	(0,01)
	01.2021	\$	1.642	£ 1.216	20	0	0,00
	02.2021		145	ILS 498	10	0	0,00
SSB	03.2021		126	KRW 140.304	3	0	0,00
	01.2021	CAD	61.420	\$ 47.410	0	(801)	(0,01)
TOR	01.2021	€	704.777	844.036	0	(18.293)	(0,28)
	01.2021	\$	48.210	CAD 61.420	0	0	0,00
	02.2021	CAD	61.420	\$ 48.215	0	(1)	0,00
	02.2021	€	704.777	862.910	0	(7)	0,00
	01.2021	AUD	32.724	24.060	0	(1.192)	(0,02)
UAG	01.2021	MXN	50.724	2.502	0	(39)	0,00
	02.2021	\$	6	CZK 128	0	0	0,00
	02.2021		18	RUB 1.366	0	0	0,00
				\$ 1.319	\$ (33.595)	\$ (32.276)	(0,50)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse 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	01.2021	\$	4.113	CAD 5.331	\$ 72	\$ 0	0,00
BPS	01.2021		334	432	4	0	0,00
CBK	01.2021		7.663	9.959	154	0	0,01
GLM	01.2021	CAD	115	\$ 90	0	0	0,00
HUS	01.2021		15	12	0	0	0,00
JPM	01.2021	\$	1.691	CAD 2.192	30	0	0,00
MYI	01.2021	CAD	115	\$ 90	0	0	0,00
RBC	01.2021		8	6	0	0	0,00
SSB	01.2021		2.738	2.120	0	(29)	0,00
	01.2021	\$	1.298	CAD 1.688	27	0	0,00
TOR	01.2021	CAD	9.993	\$ 7.844	0	0	0,00
	01.2021	\$	7.714	CAD 9.993	130	0	0,00
	02.2021		7.845	9.993	0	0	0,00
				\$ 417	\$ (29)	\$ 388	0,01

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Investor 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	01.2021	CHF	15	\$ 17	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$	9.735	CHF 8.791	211	0	0,00
BPS	01.2021	CHF	61	\$ 69	0	0	0,00
	01.2021	\$	2.277	CHF 2.022	10	0	0,00
BRC	01.2021	CHF	32	\$ 36	0	(1)	0,00
	01.2021	\$	27	CHF 24	0	0	0,00
FBF	01.2021		407	363	3	0	0,00
MYI	01.2021		9.967	9.027	245	0	0,01
SCX	01.2021	CHF	8	\$ 9	0	0	0,00
	01.2021	\$	327	CHF 296	8	0	0,00
SSB	01.2021		10.017	9.027	196	0	0,00
UAG	01.2021		227	201	0	0	0,00
				\$ 673	\$ (1)	\$ 672	0,01

Zum 31. Dezember 2020 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, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend 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	01.2021	\$	1.159	€ 944	\$ 0	\$ (4)	0,00
BPS	01.2021	€	2.737	\$ 3.324	0	(25)	0,00
	01.2021	\$	618.162	€ 515.888	13.065	(10)	0,20
BRC	01.2021		107	87	0	0	0,00
CBK	01.2021		6.920	5.756	124	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	01.2021	€ 578	\$ 701	\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00
	01.2021	\$ 16.173	€ 13.443	277	0	277	0,01
JPM	01.2021	102	84	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	1.985	1.627	6	0	6	0,00
SCX	01.2021	691.237	577.181	14.973	0	14.973	0,22
	02.2021	1.059.208	865.091	0	(4)	(4)	0,00
TOR	01.2021	651.737	544.199	14.117	0	14.117	0,22
	02.2021	929.661	759.286	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 42.562	\$ (53)	\$ 42.509	0,65

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 771	£ 577	\$ 18	\$ 0	\$ 18	0,00
BRC	01.2021	£ 218	\$ 293	0	(5)	(5)	(0,01)
CBK	01.2021	173	236	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 20.045	£ 14.996	454	0	454	0,01
HUS	01.2021	£ 218	\$ 290	0	(8)	(8)	0,00
	01.2021	\$ 21.504	£ 16.079	476	0	476	0,01
MYI	01.2021	56	42	1	0	1	0,00
SCX	01.2021	£ 20	\$ 27	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$ 939	£ 706	27	0	27	0,00
SSB	01.2021	22.745	17.040	548	0	548	0,01
				\$ 1.524	\$ (15)	\$ 1.509	0,02

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 56	ILS 185	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
HUS	01.2021	58	192	2	0	2	0,00
UAG	01.2021	60	198	2	0	2	0,00
				\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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
BPS	01.2021	SGD 24.693	\$ 18.614	\$ 0	\$ (70)	\$ (70)	0,00
	02.2021	\$ 18.615	SGD 24.693	70	0	70	0,00
BRC	01.2021	59	80	1	0	1	0,00
	02.2021	42	56	0	0	0	0,00
GLM	02.2021	33	43	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	SGD 346	\$ 259	0	(3)	(3)	0,00
	01.2021	\$ 22	SGD 29	0	0	0	0,00
	02.2021	SGD 119	\$ 89	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$ 62	SGD 82	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	SGD 12.125	\$ 9.112	0	(62)	(62)	0,00
	01.2021	\$ 9.257	SGD 12.379	110	0	110	0,00
	02.2021	9.112	12.125	62	0	62	0,00
NGF	01.2021	SGD 24.770	\$ 18.589	0	(153)	(153)	0,00
	01.2021	\$ 18.312	SGD 24.547	261	0	261	0,00
	02.2021	18.590	24.770	153	0	153	0,00
SCX	01.2021	17.908	24.031	275	0	275	0,01
SSB	01.2021	629	844	9	0	9	0,00
	02.2021	53	70	0	0	0	0,00
UAG	01.2021	SGD 217	\$ 163	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 182	SGD 243	2	0	2	0,00
	02.2021	SGD 68	\$ 51	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$ 29	SGD 38	0	0	0	0,00
				\$ 943	\$ (292)	\$ 651	0,01
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ 13.107</b>	<b>0,20</b>

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Total Return Bond Fund (Forts.)

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
Ginnie Mae, TBA 5,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 12.000	\$ (13.102)	(0,21)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.01.2036	20.000	(21.209)	(0,32)
<b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b>		<b>\$ (34.311)</b>	<b>(0,53)</b>
<b>Summe Anlagen</b>		<b>\$ 7.675.404</b>	<b>119,48</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>		<b>\$ (1.251.351)</b>	<b>(19,48)</b>
<b>Nettovermögen</b>		<b>\$ 6.424.053</b>	<b>100,00</b>

## 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) 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	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	2,572 %	03.06.2031	26.05.2020	\$ 4.000	\$ 4.267	0,07
General Motors Co.	6,125	01.10.2025	07.05.2020 - 28.05.2020	12.018	14.446	0,22
				<b>\$ 16.018</b>	<b>\$ 18.713</b>	<b>0,29</b>

(i) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 8.659 und Barmittel in Höhe von USD 7.250 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 63.908 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	1.212	20.637	0	21.849
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(34.311)	0	(34.311)
<b>Summen</b>	<b>\$ 295.238</b>	<b>\$ 7.348.187</b>	<b>\$ 31.979</b>	<b>\$ 7.675.404</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 7.381.456	\$ 0	\$ 7.381.456
Investmentfonds	500.721	0	0	500.721
Pensionsgeschäfte	0	94.132	0	94.132
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(5.309)	4.498	0	(811)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(304.023)	0	(304.023)
<b>Summen</b>	<b>\$ 495.412</b>	<b>\$ 7.176.063</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 7.671.475</b>

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

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

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

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (569)	\$ 522	\$ (47)
BPS	13.176	(16.020)	(2.844)
BRC	27	0	27
CBK	894	(830)	64
DUB	98	(160)	(62)
FAR	0	90	90
FBF	3	0	3
GLM	187	0	187
GST	(65)	0	(65)
HUS	(10.045)	8.106	(1.939)
JPM	(770)	530	(240)
MYI	360	(290)	70
NGF	261	(20)	241
RBC	(9)	0	(9)
SAL	(74)	0	(74)
SCX	14.968	(18.350)	(3.382)
SSB	754	(680)	74
TOR	(4.859)	5.780	921
UAG	(1.230)	881	(349)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	53,86	64,28
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	51,34	79,35
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,61	k. A.
Investmentfonds	9,74	9,74
Pensionsgeschäfte	2,12	1,83
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,02	(0,10)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,12	0,01
Freiverkehrsfinauzderivate	0,20	0,07
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,53)	(5,92)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(20,69)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	44,27	54,02
Kommunalanleihen und Wechsel	0,64	0,29
US-Regierungsbehörden	29,02	48,17
US-Schatzobligationen	13,38	18,29
Non-Agency-MBS	9,89	10,44
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,83	7,35
Staatsemissionen	2,99	4,97
Wandelbare Vorzugswertpapiere	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,07	0,09
Kurzfristige Instrumente	0,72	0,01
Investmentfonds	9,74	9,74
Pensionsgeschäfte	2,12	1,83
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,02	(0,10)
Optionskauf		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,03	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzkauf	(0,02)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,05	k. A.
Zinsswaps	0,06	0,02
Freiverkehrsfinauzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,02	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,02)	k. A.
Inflation-Capped Options	k. A.	0,00
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	k. A.	0,01
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,50)	(0,53)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,70	0,58
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,53)	(5,92)
Sonstige Aktiva und Passiva	(19,48)	(49,26)
Nettovermögen	100,00	100,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy 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
<b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>				<b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>				Utah State Board of Regents 0,900 % fällig am 25.01.2057 \$ 416 \$ 416 0,88			
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>								Voya CLO Ltd. 0,935 % fällig am 25.07.2026 50 50 0,11			
<b>BANKEN UND FINANZEN</b>								<b>STAATSEMISSIONEN</b>			
Athene Global Funding 1,468 % fällig am 01.07.2022 \$ 300 \$ 302 0,64				AT&T, Inc. 1,111 % fällig am 15.02.2023 \$ 400 \$ 405 0,86				Export-Import Bank of India 1,213 % fällig am 21.08.2022 300 300 0,64			
Aviation Capital Group LLC 1,175 % fällig am 01.06.2021 100 99 0,21				Duke Energy Corp. 0,721 % fällig am 14.05.2021 300 300 0,63				<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
Bank of America Corp. 1,015 % fällig am 05.03.2024 100 101 0,21				Hydro One, Inc. 0,710 % fällig am 16.01.2023 CAD 300 237 0,50				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
Brixmor Operating Partnership LP 1,264 % fällig am 01.02.2022 100 100 0,21				Sempra Energy 0,667 % fällig am 15.03.2021 \$ 300 300 0,64				Pacific Gas & Electric Co. 1,600 % fällig am 15.11.2021 300 300 0,64			
Citigroup, Inc. 1,322 % fällig am 17.05.2024 300 304 0,64				Summe Unternehmensanleihen und Wechsel 6.042 12,79				<b>U.S. TREASURY BILLS</b>			
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 2,508 % fällig am 16.04.2021 250 252 0,53				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				0,078 % fällig am 14.01.2021 (b)(c) 4.400 4.400 9,32			
Goldman Sachs Group, Inc. 0,994 % fällig am 31.10.2022 220 221 0,47				Ginnie Mae 0,940 % fällig am 20.05.2066 1.486 1.506 3,19				0,091 % fällig am 25.03.2021 (b)(c) 7.500 7.500 15,87			
JPMorgan Chase & Co. 1,445 % fällig am 24.10.2023 100 102 0,22				754 766 1,62				0,092 % fällig am 12.01.2021 (b)(c) 300 300 0,63			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 1,005 % fällig am 25.07.2022 300 303 0,64				772 830 1,76				0,096 % fällig am 04.02.2021 (b)(c) 600 600 1,27			
Nissan Motor Acceptance Corp. 0,874 % fällig am 13.07.2022 300 298 0,63				Summe 3.102 6,57				0,096 % fällig am 18.02.2021 (a)(b)(c) 2.200 2.200 4,66			
ORIX Corp. 2,650 % fällig am 13.04.2021 300 302 0,64				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				Summe kurzfristige Instrumente 15.300 31,75			
Standard Chartered PLC 1,335 % fällig am 14.10.2023 200 201 0,43				BX Commercial Mortgage Trust 0,909 % fällig am 15.11.2035 118 118 0,25				Summe Übertragbare Wertpapiere \$ 26.952 57,07			
2.585 5,47				<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				<b>AKTIEN</b>			
<b>INDUSTRIEWERTE</b>				Cent CLO Ltd. 1,543 % fällig am 29.10.2025 \$ 118 118 0,25				<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Central Nippon Expressway Co. Ltd. 1,070 % fällig am 14.09.2021 500 502 1,06				EFS Volunteer LLC 1,065 % fällig am 25.10.2035 342 342 0,72				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
1,224 % fällig am 28.05.2021 1.000 1.003 2,13				Gallatin CLO Ltd. 1,537 % fällig am 15.07.2027 466 465 0,99				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d) 180.973 1.803 3,82			
GATX Corp. 0,945 % fällig am 05.11.2021 100 100 0,21				SMB Private Education Loan Trust 0,448 % fällig am 15.09.2054 104 104 0,22				<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
Imperial Brands Finance PLC 3,750 % fällig am 21.07.2022 200 209 0,44				Towd Point Mortgage Trust 0,748 % fällig am 25.02.2057 322 321 0,68				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d) 20.400 2.074 4,39			
Woodside Finance Ltd. 4,600 % fällig am 10.05.2021 400 401 0,85				2.215 4,69				Summe Investmentfonds \$ 3.877 8,21			

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOS	0,070 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 6.900	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.12.2027	\$ (7.040)	\$ 6.900	\$ 6.900	14,61
BPS	0,090	31.12.2020	04.01.2021	3.100	Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.09.2044	(3.194)	3.100	3.100	6,57
	0,090	31.12.2020	04.01.2021	3.100	U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.08.2049	(3.174)	3.100	3.100	6,57
SSB	0,000	31.12.2020	04.01.2021	545	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021	(556)	545	545	1,15
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (13.964)	\$ 13.645	\$ 13.645	28,90

(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
3-Month Canada Bankers' Acceptance December Futures	Long	12.2021	20	\$ 1	0,00
90-Day Eurodollar March Futures	Long	03.2022	81	3	0,01
Australia Government 3-Year Note March Futures	Long	03.2021	12	1	0,00
CAC 40 Index January Futures	Long	01.2021	1	1	0,00
DAX Index March Futures	Long	03.2021	1	5	0,01
E-mini NASDAQ 100 Index March Futures	Long	03.2021	1	9	0,02
E-Mini Russell 2000 Index March Futures	Long	03.2021	3	9	0,02
E-mini S&P 500 Index March Futures	Long	03.2021	1	6	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2021	22	5	0,01
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2021	1	0	0,00
FTSE 100 Index March Futures	Long	03.2021	4	(9)	(0,02)
FTSE China A50 Index January Futures	Long	01.2021	42	24	0,05

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
FTSE Taiwan Index January Futures	Long	01.2021	11	\$ 8	0,02
FTSE/JSE Index March Futures	Long	03.2021	13	(2)	0,00
FTSE/MIB Index March Futures	Long	03.2021	2	6	0,01
Hang Seng China Enterprises Index January Futures	Long	01.2021	4	6	0,01
Hang Seng Index January Futures	Long	01.2021	1	4	0,01
MEXBOL Index March Futures	Long	03.2021	10	1	0,00
MSCI Singapore Index January Futures	Long	01.2021	15	(2)	0,00
Nikkei 225 Index March Futures	Long	03.2021	2	10	0,02
S&P CNX Nifty Index January Futures	Long	01.2021	24	2	0,01
S&P/Toronto Stock Exchange 60 March Futures	Long	03.2021	5	(6)	(0,01)
SPI 200 Index March Futures	Long	03.2021	7	(5)	(0,01)
Topix Index March Futures	Long	03.2021	4	14	0,03
Volatility S&P 500 Index January Futures	Short	01.2021	7	1	0,00
VSTOXX Mini January Futures	Short	01.2021	35	(5)	(0,01)
WIG20 Index March Futures	Long	03.2021	24	6	0,01
				\$ 93	0,20
<b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b>				<b>\$ 93</b>	<b>0,20</b>

**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	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	4,175 %	16.09.2025	INR 33.800	\$ 7	0,02
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	4,313	16.12.2025	200	0	0,00
Erhalt <sup>(1)</sup>	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	4,710	17.03.2026	50.700	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,770	02.01.2025	BRL 3.300	6	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,840	02.01.2025	11.400	28	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,877	02.01.2025	3.000	17	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,620	02.01.2025	5.500	(46)	(0,10)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,630	02.01.2025	4.900	(42)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,550	02.01.2025	700	2	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	CAD 2.100	(14)	(0,03)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,268	16.09.2025	CNY 3.000	8	0,02
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,295	16.09.2025	17.900	8	0,02
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,345	16.09.2025	6.000	12	0,03
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,630	16.12.2025	2.400	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,645	16.12.2025	8.600	0	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,645	16.12.2025	7.400	(13)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,663	17.03.2026	4.200	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,700	17.03.2026	7.000	1	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	(2)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,780	16.12.2025	15.900	(15)	(0,03)
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,790	17.03.2026	2.800	2	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,823	17.03.2026	4.500	5	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,828	17.03.2026	4.300	(5)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,220	11.12.2025	COP 1.542.400	(3)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,295	09.10.2025	1.638.900	7	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,400	28.08.2025	1.571.400	(8)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,850	24.04.2025	2.558.800	31	0,07
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,350	27.03.2025	625.600	(11)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,360	30.03.2025	836.600	(14)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,850	08.01.2025	2.507.300	54	0,12
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,150	13.03.2025	121.800	(3)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	0,830	16.09.2025	KRW 950.500	(11)	(0,02)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,888	16.12.2025	509.100	5	0,01
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,910	16.09.2025	737.100	5	0,01
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,994	16.12.2025	450.000	2	0,01
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,000	16.12.2025	907.600	(5)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month KRW-KORIBOR	1,120	17.03.2026	4.208.600	5	0,01
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	0,481	11.08.2025	PLN 3.400	2	0,01
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	0,560	17.04.2025	1.900	3	0,01
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	0,585	22.09.2025	2.600	0	0,00
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	0,635	08.05.2025	1.100	3	0,01
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	1,636	29.11.2024	700	9	0,02
Zahlung	3-Month PLN-WIBOR	2,000	19.06.2024	2.400	38	0,08
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month SGD-SOR	0,480	17.03.2026	SGD 2.300	0	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month SGD-SOR	0,483	17.03.2026	2.300	0	0,00
Zahlung	3-Month SGD-SOR	0,498	16.12.2025	1.100	2	0,01
Zahlung	3-Month SGD-SOR	0,501	16.12.2025	1.630	4	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month SGD-SOR	0,503	17.03.2026	1.900	(2)	0,00
Erhalt	3-Month SGD-SOR	0,515	16.12.2025	3.000	(9)	(0,02)
Zahlung	3-Month SGD-SOR	0,522	16.09.2025	2.200	10	0,02
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month SGD-SOR	0,525	17.03.2026	800	1	0,00
Erhalt	3-Month SGD-SOR	0,544	16.09.2025	800	(4)	(0,01)
Erhalt <sup>(1)</sup>	3-Month SGD-SOR	0,547	17.03.2026	800	(2)	0,00

# 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
Erhalt	3-Month SGD-SOR	0,561 %	16.09.2025	SGD	1.700	\$ (10)	(0,02)
Zahlung	3-Month SGD-SOR	0,571	16.12.2025		600	3	0,01
Zahlung	3-Month SGD-SOR	0,575	16.09.2025		600	4	0,01
Zahlung	3-Month SGD-SOR	0,585	16.09.2025		800	5	0,01
Zahlung <sup>(1)</sup>	3-Month SGD-SOR	0,585	17.03.2026		2.400	10	0,02
Erhalt	3-Month SGD-SOR	0,623	16.09.2025		1.100	(9)	(0,02)
Erhalt	3-Month SGD-SOR	0,660	17.06.2025		600	(5)	(0,01)
Erhalt	3-Month SGD-SOR	0,850	18.03.2025		800	(13)	(0,03)
Erhalt	3-Month SGD-SOR	1,110	17.06.2025		700	(17)	(0,04)
Erhalt	3-Month SGD-SOR	1,168	17.06.2025		500	(13)	(0,03)
Zahlung	3-Month SGD-SOR	1,210	18.03.2025		900	26	0,06
Zahlung	3-Month SGD-SOR	1,296	18.03.2025		3.100	99	0,21
Zahlung	3-Month SGD-SOR	1,423	18.03.2025		900	32	0,07
Zahlung	3-Month SGD-SOR	1,450	18.12.2024		300	10	0,02
Zahlung	3-Month SGD-SOR	1,530	17.06.2025		900	35	0,07
Erhalt	3-Month SGD-SOR	1,546	18.03.2025		2.000	(81)	(0,17)
Zahlung	3-Month SGD-SOR	2,240	19.12.2023		2.600	118	0,25
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025	\$	2.500	(8)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.03.2050		400	11	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,750	18.12.2029		200	(8)	(0,02)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	4,900	12.11.2025	ZAR	300	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	4,938	18.09.2025		7.000	(8)	(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	0,05
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,375	27.05.2025		7.800	20	0,04
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,200	22.04.2025		7.800	40	0,08
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,320	23.04.2025		5.600	31	0,06
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,835	28.08.2024		100	(1)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,600	19.06.2024		7.100	(56)	(0,12)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	20.03.2024		9.180	64	0,13
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,800	19.12.2023		3.100	25	0,05
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,130	31.07.2025	CLP	332.000	4	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
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,915	09.03.2025		325.300	14	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,280	14.02.2025		317.700	22	0,05
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	(8)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,637	24.07.2025		7.700	(8)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,665	22.09.2025		5.100	(3)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,690	04.05.2025		4.100	(4)	(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	(1)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,100	31.12.2025		57.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,124	13.03.2025		12.000	7	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	17.06.2030	€	700	2	0,00
Zahlung	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.12.2030	£	900	11	0,02
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month HKD-HIBOR	0,500	17.03.2026	HKD	6.300	0	0,00
Erhalt	6-Month HKD-HIBOR	0,550	16.12.2025		4.700	(2)	0,00
Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month HKD-HIBOR	0,560	17.03.2026		3.200	1	0,00
Zahlung	6-Month HKD-HIBOR	0,565	16.12.2025		7.800	4	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month HKD-HIBOR	0,568	17.03.2026		6.300	(2)	(0,01)
Zahlung	6-Month HKD-HIBOR	0,583	16.12.2025		7.900	5	0,01
Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month HKD-HIBOR	0,607	17.03.2026		9.400	(6)	(0,01)
Zahlung	6-Month HKD-HIBOR	0,618	16.09.2025		7.800	7	0,02
Zahlung	6-Month HKD-HIBOR	0,680	16.12.2025		3.200	4	0,01
Erhalt	6-Month HKD-HIBOR	0,698	16.12.2025		3.100	(4)	(0,01)
Erhalt	6-Month HKD-HIBOR	0,700	16.09.2025		11.100	(16)	(0,03)
Zahlung	6-Month HKD-HIBOR	0,790	16.09.2025		4.700	9	0,02
Erhalt	6-Month HKD-HIBOR	1,085	16.09.2025		11.200	(43)	(0,09)
Erhalt	6-Month HKD-HIBOR	1,120	17.06.2025		3.200	(12)	(0,03)
Zahlung	6-Month HKD-HIBOR	1,340	18.03.2025		8.000	40	0,08
Zahlung	6-Month HKD-HIBOR	1,593	18.12.2024		6.600	40	0,08
Zahlung	6-Month HKD-HIBOR	1,600	17.06.2025		5.900	39	0,08
Zahlung	6-Month HKD-HIBOR	1,715	18.03.2025		10.800	76	0,16
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,085	14.08.2025	HUF	186.300	(4)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,775	26.06.2025	MXN	4.900	(2)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,080	09.10.2025		14.500	7	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,120	06.05.2025		15.800	17	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,443	17.04.2025		5.700	9	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,210	28.03.2025		4.300	14	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,230	07.04.2025		16.700	54	0,11
						\$ 661	1,40
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 661</b>	<b>1,40</b>

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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	1-Year ILS-TELBOR	0,230 %	02.12.2025	ILS	2.100	\$ 0	\$ 0	0,00	
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,250	20.08.2025	ILS	2.100	3	(5)	(2)	
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,265	29.05.2025		3.700	0	5	5	
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,270	04.11.2025		2.900	0	2	2	
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,305	15.05.2025		2.900	0	6	6	
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,330	14.02.2025		2.900	0	8	8	
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,335	29.11.2024		2.200	0	5	5	
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,403	31.01.2025		2.900	0	11	11	
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,405	30.10.2024		1.500	0	(5)	(5)	
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,345	23.11.2023		5.900	0	68	68	
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,288	18.12.2024	KRW	707.600	0	(7)	(7)	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,315	18.03.2025		3.367.800	0	34	34	
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,372	18.03.2025		706.600	0	(9)	(9)	
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,425	28.01.2025		2.375.600	0	(37)	(37)	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,755	07.02.2024		2.627.800	23	40	63	
	Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,965	20.03.2024		974.800	(12)	(17)	(29)	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,100	19.09.2023		2.442.500	11	61	72	
	BPS	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,200	06.03.2025	ILS	2.900	0	(2)	(2)
		Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,285	19.05.2025		1.500	0	3	3
Zahlung		1-Year ILS-TELBOR	0,375	13.03.2025		1.500	0	5	5	
Erhalt		1-Year ILS-TELBOR	0,410	18.10.2024		2.200	0	(7)	(7)	
Erhalt		1-Year ILS-TELBOR	0,710	25.03.2025		3.300	0	(28)	(28)	
Erhalt		1-Year ILS-TELBOR	1,480	30.11.2023		6.000	0	(75)	(75)	
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	17.06.2025		2.900	0	(3)	(3)	
Erhalt		3-Month KRW-KORIBOR	1,213	18.12.2024	KRW	1.947.200	0	(13)	(13)	
Zahlung		3-Month KRW-KORIBOR	1,330	18.03.2025		708.700	0	8	8	
Erhalt		3-Month KRW-KORIBOR	1,965	20.03.2024		1.592.000	(14)	(33)	(47)	
CBK		Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,257	11.12.2025	ILS	1.300	0	(1)	(1)
		Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,293	18.05.2025		3.000	0	6	6
		Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,406	01.11.2024		1.500	0	5	5
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,413	08.11.2024		2.200	0	(7)	(7)	
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	1,202	19.09.2023		10.400	0	106	106	
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	1,373	07.09.2023		11.032	0	(130)	(130)	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	0,805	16.09.2025	KRW	725.900	0	(9)	(9)	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,328	18.03.2025		696.700	0	7	7	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	1,987	16.12.2025	MYR	1.800	0	(3)	(3)	
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	2,271	17.09.2025		2.700	0	(5)	(5)	
	CKL	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,970	18.03.2025	THB	33.800	0	20	20
Erhalt		1-Year ILS-TELBOR	1,060	15.02.2024	ILS	3.100	8	(45)	(37)	
GLM	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,220	23.10.2025		2.900	0	0	0,00	
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,233	02.12.2025		2.400	0	0	0,00	
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,250	20.08.2025		2.200	0	(2)	(2)	
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,370	28.08.2025		1.400	0	(4)	(4)	
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,393	02.01.2025		2.800	0	(11)	(11)	
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,635	27.03.2025		4.200	0	(31)	(31)	
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,650	26.03.2025		3.300	0	(25)	(25)	
	Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,967	19.06.2024		3.000	0	31	31	
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	1,026	19.02.2024		2.300	0	(26)	(26)	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,098	17.09.2025	MYR	1.800	0	0	0,00	
	Erhalt <sup>(1)</sup>	6-Month THB-THBFX	0,837	17.03.2026	THB	18.300	0	(4)	(4)	
	HUS	Zahlung	1-Day INR- MIBOR Compounded-OIS	5,195	18.03.2025	INR	82.600	0	35	35
		Zahlung	1-Year ILS-TELBOR	0,350	18.09.2024	ILS	1.400	0	4	4
Erhalt		1-Year ILS-TELBOR	1,035	25.03.2024		3.900	1	(46)	(45)	
Erhalt		3-Month KRW-KORIBOR	1,245	18.12.2024	KRW	474.900	0	(4)	(4)	
Erhalt		3-Month KRW-KORIBOR	1,773	20.03.2024		2.300.100	0	(54)	(54)	
Erhalt		3-Month KRW-KORIBOR	1,965	20.03.2024		1.147.000	(9)	(25)	(34)	
Zahlung		3-Month KRW-KORIBOR	2,100	19.09.2023		3.582.600	0	105	105	
Zahlung		1-Year ILS-TELBOR	1,030	19.06.2024	ILS	2.900	0	33	33	
Zahlung		1-Year ILS-TELBOR	1,280	11.01.2024		17.620	0	258	258	
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,525	20.03.2025	CNY	4.400	0	(3)	(3)	
Zahlung		3-Month CNY-CNREPOFIX	2,638	18.03.2025		23.900	0	1	1	
JPM	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,119	18.03.2025	KRW	1.454.600	0	4	4	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,200	20.03.2025		1.207.600	0	7	7	
	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,240	18.03.2025		477.300	0	3	3	
	Erhalt	1-Year ILS-TELBOR	0,266	16.11.2025	ILS	1.400	0	(1)	(1)	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	1,975	16.12.2025	MYR	1.800	0	(3)	(3)	
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,755	16.12.2025	THB	12.600	0	3	3	
	Zahlung <sup>(1)</sup>	6-Month THB-THBFX	0,766	17.03.2026		11.000	0	1	1	
	SCX	Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,200	03.04.2025	CNY	3.000	0	8	8
		Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,430	06.03.2025		5.900	0	7	7
		Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,965	27.03.2025	KRW	1.283.700	0	5	5
		Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,990	06.03.2025		710.900	0	2	2
Erhalt		3-Month KRW-KORIBOR	1,075	03.04.2025		499.000	0	(1)	(1)	
Zahlung		3-Month KRW-KORIBOR	1,160	11.10.2024		832.400	0	5	5	
Zahlung		3-Month KRW-KORIBOR	1,755	07.02.2024		1.943.000	11	36	47	
Erhalt		3-Month MYR-KLIBOR	2,033	16.12.2025	MYR	3.500	0	4	4	
Zahlung		3-Month MYR-KLIBOR	2,915	18.03.2025		4.400	0	37	37	

# 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 Nettovermögens
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	0,843 %	17.06.2025	THB 13.000	\$ 0	\$ 5	\$ 5	0,01
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,018	17.06.2025	19.600	0	(12)	(12)	(0,03)
						\$ 22	\$ 301	\$ 323	0,68

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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	BOVESPA Index	28	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	BRL 3.228	17.02.2021	\$ 0	\$ 21	\$ 21	0,05
	Zahlung	KOSPI 200 Index	1.500.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	KRW 546.338	11.03.2021	0	35	35	0,07
							\$ 0	\$ 56	\$ 56	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	01.2021	BRL	3.004	\$ 578	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$	593	BRL 3.004	(15)	(15)	(0,03)
	01.2021		1.631	CLP 1.234.202	106	106	0,23
	01.2021		90	¥ 9.323	1	1	0,00
	01.2021		4	ZAR 59	0	0	0,00
	01.2021	ZAR	5.813	\$ 371	(24)	(24)	(0,05)
	02.2021	BRL	3.004	593	15	15	0,03
	02.2021	\$	7	AUD 9	0	0	0,00
	02.2021		940	CZK 21.006	39	39	0,08
	02.2021		42	€ 35	1	1	0,00
	02.2021		7	£ 5	0	0	0,00
	02.2021		25	¥ 2.600	0	0	0,00
	02.2021		126	SEK 1.091	7	7	0,02
	03.2021	CNH	705	\$ 107	0	(1)	0,00
	03.2021	€	774	943	(5)	(5)	(0,01)
	03.2021	HKD	483	62	0	0	0,00
	03.2021	ILS	1.349	400	(20)	(20)	(0,04)
	03.2021	¥	37.500	360	(3)	(3)	(0,01)
	03.2021	PHP	74	2	0	0	0,00
	03.2021	RON	820	200	(6)	(6)	(0,01)
	03.2021	SEK	14.000	1.669	(38)	(37)	(0,08)
	03.2021	\$	1.010	HUF 303.343	13	13	0,03
	03.2021		117	INR 8.780	3	3	0,01
	03.2021		458	NOK 4.000	9	9	0,02
	03.2021		200	PEN 728	1	1	0,00
	03.2021		471	SEK 4.000	16	16	0,03
	03.2021		351	THB 10.621	4	4	0,01
	03.2021	ZAR	4.691	\$ 300	(17)	(17)	(0,04)
BPS	01.2021	£	200	267	(6)	(6)	(0,01)
	01.2021	\$	30	CLP 23.680	3	3	0,01
	02.2021		74	AUD 102	5	5	0,01
	02.2021		5	CAD 7	0	0	0,00
	02.2021		44	€ 37	1	1	0,00
	02.2021		3	£ 2	0	0	0,00
	02.2021		3	¥ 300	0	0	0,00
	03.2021	CAD	400	\$ 308	(6)	(6)	(0,01)
	03.2021	CHF	250	277	(6)	(6)	(0,01)
	03.2021	INR	29.950	400	(8)	(8)	(0,02)
	03.2021	KRW	221.010	200	(3)	(3)	(0,01)
	03.2021	SGD	268	200	(3)	(3)	(0,01)
	03.2021	TWD	1.228	44	0	0	0,00
	03.2021	\$	547	CAD 700	3	3	0,01
	03.2021		296	€ 250	11	11	0,02
	03.2021		1.399	£ 1.063	54	54	0,11
	03.2021		95	INR 7.157	2	2	0,00
	03.2021		258	KRW 285.546	5	5	0,01
	03.2021		1.100	NOK 10.000	68	68	0,14
	03.2021		1.862	NZD 2.700	82	82	0,17
	03.2021		300	PEN 1.081	0	(1)	0,00
	03.2021		979	PHP 47.213	1	1	0,00
BRC	01.2021	BRL	469	\$ 88	(2)	(2)	0,00
	01.2021	TRY	362	46	(3)	(3)	(0,01)
	01.2021	\$	90	BRL 469	0	0	0,00
	02.2021	CZK	5.593	\$ 255	(6)	(6)	(0,01)
	02.2021	ILS	82	25	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$	41	CZK 914	2	2	0,00
	02.2021		17	€ 14	0	0	0,00
	02.2021		5	£ 4	0	0	0,00
	02.2021		11	¥ 1.100	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens	
	03.2021	HUF	60.592	\$ 200	\$ 0	\$ (4)	(4)	(0,01)
	03.2021	SEK	4.000	466	0	(21)	(21)	(0,05)
	03.2021	\$	335	£ 250	7	0	7	0,02
	03.2021		200	ILS 662	6	0	6	0,01
	03.2021		833	¥ 87.500	15	0	15	0,03
	03.2021		230	NOK 2.000	3	0	3	0,01
	03.2021		100	PLN 375	1	0	1	0,00
	03.2021		5	SGD 7	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	BRL	3.277	\$ 621	0	(10)	(10)	(0,02)
	01.2021	¥	17.419	168	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	\$	648	BRL 3.277	0	(17)	(17)	(0,04)
	01.2021		179	CZK 4.150	14	0	14	0,03
	01.2021		890	HUF 272.820	31	0	31	0,07
	01.2021		30	MXN 613	1	0	1	0,00
	01.2021		527	PLN 1.987	7	0	7	0,01
	01.2021	ZAR	1.334	\$ 85	0	(6)	(6)	(0,01)
	02.2021	BRL	3.277	647	17	0	17	0,04
	02.2021	€	38	47	0	0	0	0,00
	02.2021	¥	4.100	39	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	PEN	1.559	430	0	(1)	(1)	0,00
	02.2021	\$	6	€ 5	0	0	0	0,00
	02.2021		4	£ 3	0	0	0	0,00
	02.2021		168	¥ 17.419	1	0	1	0,00
	02.2021		120	MXN 2.762	18	0	18	0,04
	02.2021		357	NOK 3.278	26	0	26	0,05
	02.2021		378	PEN 1.364	0	(1)	(1)	0,00
	03.2021	CNH	1.323	\$ 200	0	(3)	(3)	(0,01)
	03.2021	INR	14.945	200	0	(4)	(4)	(0,01)
	03.2021	\$	200	BRL 1.022	0	(4)	(4)	(0,01)
	03.2021		792	CNH 5.262	14	0	14	0,03
	03.2021		201	COP 733.453	13	0	13	0,03
	03.2021		500	CZK 11.198	22	0	22	0,05
	03.2021		200	HUF 59.361	0	0	0	0,00
	03.2021		114	MXN 2.536	12	0	12	0,02
	03.2021		700	PLN 2.659	14	0	14	0,03
	03.2021		500	RON 2.064	17	0	17	0,04
DUB	02.2021	PEN	705	\$ 196	1	0	1	0,00
	03.2021	\$	200	MXN 4.053	2	0	2	0,00
GLM	01.2021	MXN	1.687	\$ 82	0	(3)	(3)	(0,01)
	01.2021	\$	2	HUF 742	0	0	0	0,00
	01.2021		15	MXN 296	0	0	0	0,00
	02.2021	PEN	1.714	\$ 477	3	0	3	0,01
	02.2021	\$	932	NOK 8.522	64	0	64	0,14
	02.2021		688	RON 2.834	23	0	23	0,05
	02.2021		2.139	SEK 18.555	121	0	121	0,26
	03.2021	CAD	600	\$ 459	0	(12)	(12)	(0,03)
	03.2021	CHF	1.750	1.969	0	(14)	(14)	(0,03)
	03.2021	CLP	227.121	300	0	(20)	(20)	(0,04)
	03.2021	COP	362.748	100	0	(6)	(6)	(0,01)
	03.2021	ILS	2.421	742	0	(13)	(13)	(0,03)
	03.2021	KZT	11.250	26	0	(1)	(1)	0,00
	03.2021	MXN	6.145	300	0	(6)	(6)	(0,01)
	03.2021	MYR	2.072	507	0	(9)	(9)	(0,02)
	03.2021	PEN	731	204	2	0	2	0,00
	03.2021	RON	3.368	836	0	(8)	(8)	(0,02)
	03.2021	RUB	29.921	397	0	(5)	(5)	(0,01)
	03.2021	SGD	827	617	0	(9)	(9)	(0,02)
	03.2021	\$	508	AUD 700	32	0	32	0,07
	03.2021		1.400	BRL 7.563	54	0	54	0,12
	03.2021		1.296	CAD 1.700	39	0	39	0,08
	03.2021		400	CLP 303.103	27	0	27	0,06
	03.2021		103	CNH 680	2	0	2	0,00
	03.2021		399	COP 1.462.036	28	0	28	0,06
	03.2021		100	KZT 43.775	3	0	3	0,01
	03.2021		300	MXN 6.232	11	0	11	0,02
	03.2021		766	MYR 3.127	12	0	12	0,03
	03.2021		800	RUB 61.953	33	0	33	0,07
	03.2021		9	SGD 12	0	0	0	0,00
	03.2021		180	THB 5.442	2	0	2	0,00
	03.2021		100	TRY 759	0	0	0	0,00
HUS	04.2021	COP	561.279	\$ 153	0	(10)	(10)	(0,02)
	01.2021	CLP	567.017	734	0	(64)	(64)	(0,14)
	01.2021	\$	10	HUF 3.103	0	0	0	0,00
	01.2021		15	¥ 1.530	0	0	0	0,00
	01.2021		8	MXN 163	0	0	0	0,00
	01.2021		172	PLN 655	4	0	4	0,01
	01.2021		12	ZAR 195	1	0	1	0,00
	01.2021	ZAR	441	\$ 28	0	(2)	(2)	0,00
	02.2021	CAD	302	231	0	(7)	(7)	(0,01)
	02.2021	ILS	19	6	0	0	0	0,00
	02.2021	PEN	41	11	0	0	0	0,00
	02.2021	\$	26	AUD 35	1	0	1	0,00
	02.2021		162	CAD 213	5	0	5	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	
	02.2021	\$	4	€	3	\$	0	0,00
	03.2021	CAD	2.642	\$	2.050		0	(0,05)
	03.2021	£	188		254		(3)	(0,01)
	03.2021	THB	21.217		700		(8)	(0,02)
	03.2021	\$	366	AUD	500		20	0,04
	03.2021		1.083	CAD	1.400		16	0,03
	03.2021		1.402	CHF	1.250		14	0,03
	03.2021		585	£	438		13	0,03
	03.2021		190	HUF	57.039		3	0,01
	03.2021		101	KRW	112.415		2	0,01
	03.2021		100	MXN	2.006		0	0,00
	03.2021		235	SEK	2.000		8	0,02
	03.2021		831	SGD	1.114		12	0,03
	03.2021		200	TRY	1.623		13	0,03
	03.2021		1.384	ZAR	21.447		65	0,14
	03.2021	ZAR	1.474	\$	100		0	0,00
	05.2021	\$	67	MXN	1.397		2	0,00
IND	01.2021		16	PLN	62		0	0,00
	01.2021		17	ZAR	265		1	0,00
	02.2021	CZK	1.025	\$	46		(1)	0,00
JPM	02.2021	\$	32	CZK	682		0	0,00
	01.2021	PLN	186	\$	49		(1)	0,00
	01.2021	\$	39	¥	4.012		0	0,00
	01.2021		13	MXN	271		0	0,00
	02.2021	CZK	1.226	\$	56		(1)	0,00
	02.2021	\$	2.745	CAD	3.605		85	0,18
	02.2021		7	€	6		0	0,00
	02.2021		8	£	6		0	0,00
	02.2021		1.606	ILS	5.499		108	0,23
	02.2021		102	RON	423		4	0,01
	03.2021	IDR	2.849.000	\$	200		(4)	(0,01)
	03.2021	NOK	22.000		2.513		(56)	(0,12)
	03.2021	PHP	29.085		600		(4)	(0,01)
	03.2021	\$	549	CAD	700		1	0,00
	03.2021		424	CHF	375		1	0,00
	03.2021		601	¥	62.500		4	0,01
	03.2021		697	SEK	6.000		34	0,07
MYI	01.2021	PLN	168	\$	45		0	0,00
	01.2021	\$	37	HUF	11.123		1	0,00
	01.2021		118	PLN	450		2	0,00
	01.2021		8	ZAR	129		0	0,00
	02.2021	£	24	\$	32		(1)	0,00
	02.2021	ILS	9		3		0	0,00
	02.2021	\$	1.190	AUD	1.640		75	0,16
	02.2021		9	CAD	11		0	0,00
	02.2021		10	€	8		0	0,00
	02.2021		24	ILS	80		1	0,00
	03.2021	AUD	2.254	\$	1.678		(62)	(0,13)
	03.2021	CZK	27.815		1.282		(14)	(0,03)
	03.2021	KRW	442.575		400		(7)	(0,01)
	03.2021	NZD	2.000		1.416		(24)	(0,05)
	03.2021	\$	1.069	IDR	15.270.158		23	0,05
RBC	01.2021		144	MXN	3.038		9	0,02
	02.2021		81	AUD	111		5	0,01
	02.2021		3.259	¥	340.900		45	0,10
	03.2021	CAD	400	\$	312		(2)	(0,01)
	03.2021	CLP	229.551		300		(23)	(0,05)
	03.2021	HUF	559.545		1.901		14	0,03
	03.2021	¥	37.500		363		(1)	0,00
	03.2021	MXN	4.000		200		1	0,00
	03.2021	\$	200	COP	707.924		7	0,01
	03.2021		306	€	250		0	0,00
	03.2021		427	£	313		0	0,00
	03.2021		312	MXN	6.276		1	0,00
	03.2021		453	NOK	4.000		14	0,03
	03.2021		236	SEK	2.000		8	0,02
RYL	02.2021		364	€	307		12	0,03
	03.2021	¥	75.000	\$	722		(5)	(0,01)
	03.2021	\$	222	AUD	300		10	0,02
	03.2021		300	COP	1.076.507		14	0,03
	03.2021		301	€	250		6	0,01
	03.2021		502	£	375		11	0,02
SCX	01.2021	HUF	15.496	\$	51		(1)	0,00
	01.2021	\$	78	HUF	23.951		2	0,01
	01.2021		4	ZAR	62		0	0,00
	01.2021	ZAR	303	\$	20		(1)	0,00
	02.2021	\$	13	AUD	18		1	0,00
	02.2021		3	CAD	4		0	0,00
	02.2021		37	¥	3.800		0	0,00
	03.2021	£	2.753	\$	3.718		(47)	(0,10)
	03.2021	IDR	8.444.406		591		(13)	(0,03)
	03.2021	¥	87.500		845		(3)	(0,01)
	03.2021	PLN	5.080		1.382		18	0,04

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	03.2021	\$ 303	AUD 400	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,01
	03.2021	67	IDR 954.385	1	0	1	0,00
	03.2021	642	INR 48.132	12	0	12	0,02
	03.2021	606	¥ 62.500	0	0	0	0,00
	03.2021	1.000	THB 30.196	8	0	8	0,02
SOG	03.2021	487	SEK 4.000	0	0	0	0,00
SSB	01.2021	BRL 469	\$ 88	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 11	MXN 229	0	0	0	0,00
	02.2021	205	£ 156	8	0	8	0,02
	02.2021	1.777	NZD 2.599	95	0	95	0,20
	03.2021	CNY 1.322	\$ 200	0	(2)	(2)	0,00
	03.2021	MXN 2.004	100	0	0	0	0,00
	03.2021	SEK 2.000	236	0	(8)	(8)	(0,02)
	03.2021	\$ 242	¥ 25.100	1	0	1	0,00
	03.2021	617	KRW 687.261	14	0	14	0,03
TOR	01.2021	BRL 3.025	\$ 569	0	(13)	(13)	(0,03)
	01.2021	\$ 582	BRL 3.025	0	0	0	0,00
	01.2021	63	¥ 6.566	1	0	1	0,00
	01.2021	6	PLN 21	0	0	0	0,00
	02.2021	4	CAD 5	0	0	0	0,00
	03.2021	£ 188	\$ 250	0	(7)	(7)	(0,01)
	03.2021	NZD 400	282	0	(6)	(6)	(0,01)
	03.2021	\$ 500	SGD 674	10	0	10	0,02
	03.2021	ZAR 3.088	\$ 200	0	(9)	(9)	(0,02)
UAG	01.2021	\$ 42	MXN 846	0	0	0	0,00
	02.2021	CZK 2.168	\$ 99	0	(2)	(2)	(0,01)
	02.2021	\$ 5	CAD 7	0	0	0	0,00
	02.2021	2.609	CHF 2.375	81	0	81	0,17
	02.2021	68	€ 57	2	0	2	0,00
	02.2021	3.486	£ 2.648	135	0	135	0,29
	02.2021	37	ILS 128	3	0	3	0,01
	03.2021	200	INR 14.868	2	0	2	0,01
				\$ 2.227	\$ (791)	\$ 1.436	3,04

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 31. Dezember 2020 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 Nettovermögens
BOA	01.2021	\$ 154	€ 125	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
BPS	01.2021	€ 23	\$ 28	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 5.139	€ 4.290	110	0	110	0,23
CBK	01.2021	€ 5	\$ 6	0	0	0	0,00
HUS	01.2021	7	8	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 395	€ 327	5	0	5	0,01
JPM	01.2021	1	1	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	€ 123	\$ 150	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	\$ 5.599	€ 4.675	121	0	121	0,26
	02.2021	8.696	7.102	0	0	0	0,00
TOR	01.2021	5.279	4.408	115	0	115	0,24
	02.2021	7.574	6.186	0	0	0	0,00
				\$ 351	\$ (1)	\$ 350	0,74

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 2.165 4,58

Summe Anlagen

\$ 47.393 100,36

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (172) (0,36)

Nettovermögen

\$ 47.221 100,00

**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) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von USD 1.327 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	93	2.826	0	2.919
<b>Summen</b>	<b>\$ 1.896</b>	<b>\$ 45.497</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 47.393</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 16.984	\$ 0	\$ 16.984
Investmentfonds	2.560	0	0	2.560
Pensionsgeschäfte	0	5.141	0	5.141
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	80	1.082	0	1.162
<b>Summen</b>	<b>\$ 2.640</b>	<b>\$ 23.207</b>	<b>\$ 0</b>	<b>\$ 25.847</b>

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

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

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

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 271	\$ (260)	\$ 11
BPS	153	0	153
BRC	(3)	0	(3)
CBK	148	0	148
CKL	(37)	0	(37)
DUB	3	(10)	(7)
GLM	268	(340)	(72)
GST	56	0	56
HUS	83	0	83
JPM	474	(260)	214
MYC	(1)	0	(1)
MYI	(6)	0	(6)
NGF	1	0	1
RBC	78	0	78
RYL	48	0	48
SCX	211	(270)	(59)
SSB	106	0	106
TOR	91	0	91
UAG	221	0	221

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	5,74	20,85
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	51,33	45,19
Investmentfonds	8,21	9,96
Pensionsgeschäfte	28,90	19,99
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,20	0,31
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,40	2,78
Freiverkehrsfinanzderivate	4,58	1,43

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

<b>Anlagen zum Marktwert</b>	<b>31. Dez. 2020 (%)</b>	<b>31. Dez. 2019 (%)</b>
Unternehmensanleihen und Wechsel	12,79	34,31
US-Regierungsbehörden	6,57	13,48
Non-Agency-MBS	0,83	0,66
Forderungsbesicherte Wertpapiere	3,85	9,99
Staatsemissionen	0,64	1,17
Kurzfristige Instrumente	32,39	6,43
Investmentfonds	8,21	9,96
Pensionsgeschäfte	28,90	19,99
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,20	0,31
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	1,40	2,78
Freiverkehrsfinanzderivate		
Zinsswaps	0,68	0,76
Total Return Swaps auf Indizes	0,12	k. A.
Devisenterminkontrakte	3,04	(0,45)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,74	1,12
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,36)	(0,51)
Nettovermögen	100,00	100,00



BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS	% DES
<b>STAATSEMISSIONEN</b>					<b>NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>SINGAPUR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Cassa Depositi e Prestiti SpA 1,000 % fällig am 11.02.2030	€ 400	£ 370	0,05		ABN AMRO Bank NV 4,375 % fällig am 22.09.2025 (d)(f)	€ 2.800	£ 2.670	0,35		SingTel Group Treasury Pte. Ltd. 3,875 % fällig am 28.08.2028	\$ 1.500	£ 1.285	0,17	
Italy Government International Bond 6,000 % fällig am 04.08.2028	£ 2.500	3.291	0,43		Airbus SE 1,625 % fällig am 09.06.2030	800	788	0,10		Temasek Financial Ltd. 5,125 % fällig am 26.07.2040	£ 970	1.672	0,22	
		3.661	0,48		BMW International Investment BV 0,750 % fällig am 08.03.2024	£ 2.700	2.734	0,36		Summe Singapur		2.957	0,39	
Summe Italien		15.634	2,05		Cooperative Rabobank UA 1,250 % fällig am 14.01.2025	300	310	0,04		<b>SLOWENIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>JAPAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV</b>					<b>NOVA LJUBLJANSKA BANKA D.D.</b>				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,978 % fällig am 09.06.2024	€ 700	649	0,08		5,250 % fällig am 14.09.2027	1.050	1.304	0,17		3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 900	731	0,10	
		2.261	0,30		6,625 % fällig am 29.06.2021 (d)(f)	€ 1.600	1.474	0,19		<b>SPANIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Development Bank of Japan, Inc. 1,875 % fällig am 02.10.2024	\$ 2.000	1.535	0,20		Deutsche Telekom International Finance BV 2,500 % fällig am 10.10.2025	£ 600	659	0,09		Abertis Infraestructuras S.A. 3,375 % fällig am 27.11.2026	£ 4.400	4.844	0,63	
Japan Finance Organization for Municipalities 0,050 % fällig am 12.02.2027	€ 800	726	0,10		Digital Dutch Finco BV 1,000 % fällig am 15.01.2032	€ 700	649	0,08		Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (d)(f)	€ 200	188	0,03	
		2.910	0,38		1,500 % fällig am 15.03.2030	400	387	0,05		6,000 % fällig am 15.01.2026 (d)(f)	600	594	0,08	
Summe Japan					E.ON International Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034	£ 6.100	8.484	1,11		8,875 % fällig am 14.04.2021 (d)(f)	2.200	2.015	0,26	
<b>JERSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV</b>					<b>BANCO DE SABADELL S.A.</b>				
AA Bond Co. Ltd. 2,750 % fällig am 31.07.2043	£ 1.200	1.183	0,15		1,000 % fällig am 20.10.2027	3.900	3.960	0,52		1,125 % fällig am 11.03.2027	500	463	0,06	
		897	0,12		2,650 % fällig am 10.09.2024	\$ 3.800	2.967	0,39		Banco Santander S.A. 4,375 % fällig am 14.01.2026 (d)(f)	800	720	0,09	
		3.630	0,49		3,625 % fällig am 25.05.2027	1.550	1.289	0,17		6,750 % fällig am 25.04.2022 (d)(f)	200	190	0,03	
		431	0,06		4,625 % fällig am 14.09.2025	700	597	0,08		CaixaBank S.A. 0,750 % fällig am 10.07.2026	2.100	1.932	0,25	
Glencore Finance Europe Ltd. 3,125 % fällig am 26.03.2026	3.700	4.008	0,52		5,750 % fällig am 14.09.2040	£ 2.300	3.776	0,49				10.946	1,43	
Heathrow Funding Ltd. 2,750 % fällig am 13.10.2031	1.700	1.829	0,24		IMCD NV 2,500 % fällig am 26.03.2025	€ 500	466	0,06		<b>STAATSEMISSIONEN</b>				
		1.600	0,23		JAB Holdings BV 1,600 % fällig am 20.12.2027	400	374	0,05		Adif Alta Velocidad 0,550 % fällig am 30.04.2030	400	371	0,05	
		2.300	0,43		2,250 % fällig am 19.12.2039	1.100	1.103	0,14		Autonomous Community of Madrid 0,419 % fällig am 30.04.2030	100	92	0,01	
		400	0,08		2,500 % fällig am 25.06.2029	200	205	0,03		Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030	8.500	7.976	1,05	
		500	0,09		Koninklijke KPN NV 5,000 % fällig am 18.11.2026	£ 300	345	0,05				8.439	1,11	
		400	0,07		5,750 % fällig am 17.09.2029	100	123	0,02		Summe Spanien		19.385	2,54	
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig am 05.11.2031 (d)	1.400	2.049	0,27		LeasePlan Corp. NV 1,375 % fällig am 07.03.2024	€ 200	187	0,02		<b>SUPRANATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025	€ 300	273	0,04		NN Group NV 4,500 % fällig am 15.01.2026 (d)	400	414	0,05		Europäische Investitionsbank 0,750 % fällig am 15.11.2024 (g)	£ 2.300	2.358	0,31	
	£ 1.969	1.996	0,26		4,625 % fällig am 13.01.2048	600	648	0,08		3,750 % fällig am 07.12.2027	1.750	2.171	0,28	
Summe Jersey, Kanalinseln		23.308	3,05		Shell International Finance BV 1,000 % fällig am 10.12.2030	£ 600	603	0,08		4,500 % fällig am 07.06.2029	1.300	1.744	0,23	
<b>LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>SCHWEDEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>SCHWEIZ UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Aroundtown S.A. 3,000 % fällig am 16.10.2029	1.900	2.116	0,28		1,750 % fällig am 10.09.2052	2.700	2.727	0,36		Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,000 % fällig am 12.08.2027	€ 600	545	0,07	
		1.500	0,22		Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % (d)	€ 1.261	1.499	0,20		Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (f)	\$ 1.100	908	0,12	
		1.850	0,29		Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	1.100	1.063	0,14		Credit Suisse Group AG 2,125 % fällig am 12.09.2025	£ 1.200	1.260	0,17	
	\$ 200	175	0,02		4,441 % fällig am 24.04.2023	\$ 1.400	1.075	0,14		2,250 % fällig am 09.06.2028	3.700	3.928	0,51	
Bevco Lux SARL 1,500 % fällig am 16.09.2027	€ 1.300	1.227	0,16		Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£ 4.300	4.344	0,57		2,750 % fällig am 08.08.2025	350	382	0,05	
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 2,000 % fällig am 17.10.2027	£ 2.500	2.637	0,34		1,625 % fällig am 30.11.2022	2.400	2.449	0,32		3,750 % fällig am 26.03.2025	\$ 1.050	854	0,11	
CPI Property Group S.A. 1,625 % fällig am 23.04.2027	€ 1.000	921	0,12		1,875 % fällig am 07.09.2021	500	505	0,07		4,194 % fällig am 01.04.2031	1.200	1.034	0,14	
		1.800	0,23		2,750 % fällig am 10.07.2023	400	421	0,05		6,250 % fällig am 18.12.2024 (d)(f)	800	642	0,08	
	£ 800	827	0,11		WPC Eurobond BV 2,125 % fällig am 15.04.2027	€ 600	586	0,08						
Logicor Financing SARL 1,500 % fällig am 13.07.2026	€ 1.400	1.324	0,17		Summe Niederlande		62.678	8,20		<b>SCHWEDEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
		1.800	0,22		<b>STAATSEMISSIONEN</b>					<b>SCHWEDEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
	£ 1.600	1.756	0,23		Niederlande Waterschapsbank NV 5,375 % fällig am 07.06.2032 (g)	£ 1.000	1.529	0,20		Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,000 % fällig am 12.08.2027	€ 600	545	0,07	
Prologis International Funding S.A. 1,625 % fällig am 17.06.2032	€ 2.100	2.126	0,28		Summe Niederlande		62.678	8,20		<b>SCHWEDEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Summe Luxemburg		20.442	2,67		<b>NORWEGEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>SCHWEDEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
<b>MAURITIUS UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>					<b>AKER BP ASA</b>					<b>SCHWEDEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				
Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025	\$ 1.100	837	0,11		3,750 % fällig am 15.01.2030	\$ 2.600	2.005	0,26		2,250 % fällig am 09.06.2028	3.700	3.928	0,51	
					Equinor ASA 1,375 % fällig am 22.05.2032	€ 400	401	0,05		2,750 % fällig am 08.08.2025	350	382	0,05	
					Summe Norwegen		2.406	0,31		3,750 % fällig am 26.03.2025	\$ 1.050	854	0,11	





# Aufstellung der Wertpapieranlagen UK 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
5,375 % fällig am 18.12.2040	£ 100		0,02	Physicians Realty LP	\$ 100	81	0,01	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
GlaxoSmithKline Capital, Inc.	\$ 2.200	2.088	0,27	4,300 % fällig am 15.03.2027				Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust	\$ 145	£ 94	0,02
4,200 % fällig am 18.03.2043				Prologis LP	£ 1.000	£ 1.121	0,15	0,648 % fällig am 25.04.2035			
Goldman Sachs Group, Inc.	£ 3.500	4.105	0,54	2,250 % fällig am 30.06.2029				HomeBanc Mortgage Trust			
3,125 % fällig am 25.07.2029	£ 1.200	1.405	0,18	Realty Income Corp.	1.800	1.906	0,25	1,153 % fällig am 25.07.2035	1.500	1.081	0,14
4,250 % fällig am 29.01.2026	1.200	1.721	0,22	1,625 % fällig am 15.12.2030				Sequoia Mortgage Trust			
7,250 % fällig am 10.04.2028				SLM Student Loan Trust	1.163	1.097	0,14	3,211 % fällig am 20.07.2037 ^	11	7	0,00
HCA, Inc.	\$ 1.400	1.192	0,16	0,585 % fällig am 15.12.2039				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust	2	2	0,00
4,500 % fällig am 15.02.2027	\$ 2.600	2.276	0,30	Southern California Edison Co.	\$ 300	277	0,04	3,080 % fällig am 25.02.2034			
JPMorgan Chase & Co.				6,650 % fällig am 01.04.2029				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	20	14	0,00
4,203 % fällig am 23.07.2029				T-Mobile USA, Inc.	600	509	0,07	1,809 % fällig am 25.11.2042			
Kraft Heinz Foods Co.	£ 500	559	0,07	3,875 % fällig am 15.04.2030						1.198	0,16
4,125 % fällig am 01.07.2027				Time Warner Cable LLC	£ 2.800	3.984	0,52				
Liberty Utilities Finance GP	\$ 1.200	884	0,12	5,250 % fällig am 15.07.2042				<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>			
2,050 % fällig am 15.09.2030				Union Electric Co.	\$ 1.700	1.303	0,17	Uniform Mortgage-Backed Security			
MassMutual Global Funding	£ 1.000	1.055	0,14	2,625 % fällig am 15.03.2051				1,944 % fällig am 01.07.2044	9	7	0,00
1,375 % fällig am 15.12.2026				Verizon Communications, Inc.	£ 700	752	0,10	3,810 % fällig am 01.08.2036	4	3	0,00
Metropolitan Life Global Funding	900	970	0,13	1,875 % fällig am 19.09.2030	£ 600	770	0,10			10	0,00
1,625 % fällig am 21.09.2029	1.340	1.571	0,21	3,375 % fällig am 27.10.2036	550	781	0,10				
3,500 % fällig am 30.09.2026				4,750 % fällig am 17.02.2034				Summe USA		110.125	14,41
MidAmerican Energy Co.	\$ 600	522	0,07	Walmart, Inc.	\$ 1.800	1.790	0,23				
3,650 % fällig am 15.04.2029				4,050 % fällig am 29.06.2048	£ 400	640	0,08	Summe Übertragbare Wertpapiere		£ 712.455	93,21
Moody's Corp.	100	82	0,01	5,625 % fällig am 27.03.2034							
3,250 % fällig am 20.05.2050				Wells Fargo & Co.	2.300	2.432	0,32	<b>AKTIEN</b>			
Morgan Stanley	£ 950	1.059	0,14	2,000 % fällig am 28.07.2025	1.200	1.305	0,17	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
2,625 % fällig am 09.03.2027				2,125 % fällig am 24.09.2031	6.150	6.804	0,89	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
MPT Operating Partnership LP	3.200	3.260	0,43	2,500 % fällig am 02.05.2029	\$ 3.100	2.409	0,31	PIMCO ETFs plc - PIMCO			
2,550 % fällig am 05.12.2023	1.500	1.628	0,21	2,572 % fällig am 11.02.2031	£ 700	835	0,11	Euro Short Maturity	2.500	223	0,03
3,692 % fällig am 05.06.2028				3,500 % fällig am 12.09.2029				UCITS ETF (e)			
Netflix, Inc.	€ 300	306	0,04	Welltower, Inc.	700	861	0,11	PIMCO ETFs plc - PIMCO			
3,625 % fällig am 15.06.2030	\$ 100	84	0,01	4,800 % fällig am 20.11.2028				Sterling Short Maturity	369.280	37.965	4,96
4,875 % fällig am 15.06.2030						107.470	14,06	UCITS ETF (e)			
New York Life Global Funding	£ 500	525	0,07	<b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>						38.188	4,99
1,250 % fällig am 17.12.2026				Dallas Area Rapid Transit, Texas Revenue Bonds, Series 2020	\$ 1.600	1.213	0,16	Summe Investmentfonds		£ 38.188	4,99
Pfizer, Inc.	1.900	2.398	0,31	2,578 % fällig am 01.12.2035							
2,735 % fällig am 15.06.2043											

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$888	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	£ (663)	£ 650	£ 650	0,09
SCX	(0,200)	31.12.2020	04.01.2021	£ 45.500	United Kingdom Gilt 2,500 % - 4,000 % fällig 22.01.2060 - 22.07.2065	(45.728)	45.500	45.499	5,95
Summe Pensionsgeschäfte						£ (46.391)	£ 46.150	£ 46.149	6,04

<sup>(1)</sup> 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 March Futures	Short	03.2021	55	£ 4	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	57	(3)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2021	201	(52)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	37	0	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	22	67	0,01
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2021	161	115	0,02
				£ 131	0,02
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				£ 131	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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Auchan Holding S.A.	1,000 %	20.12.2027	€ 100	£ 2	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	\$ 200	5	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	€ 1.700	(86)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	3.100	(184)	(0,02)
				£ (263)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 34 10-Year Index	(1,000) %	20.12.2030	€ 16.700	£ (219)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-33 5-Year Index	1,000 %	20.12.2024	\$ 1.100	£ 2	0,00
CDX.IG-34 5-Year Index	1,000	20.06.2025	1.200	8	0,00
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	3.000	4	0,00
				£ 14	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000 %	16.12.2025	\$ 6.300	£ (13)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	2.000	(4)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	4.000	62	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	21.06.2022	29.000	(1.228)	(0,16)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	9.200	(92)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050	1.100	93	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	9.300	(518)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	17.06.2050	900	91	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	12.03.2050	600	(95)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2051	€ 2.700	(40)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	16.06.2051	400	0	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031	15.400	11	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2023	18.700	12	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.03.2026	5.000	0	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	16.06.2026	27.400	55	0,01
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	17.03.2023	£ 18.800	0	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2023	112.400	27	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,000	16.06.2026	41.900	(19)	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	17.03.2051	2.700	9	0,00
Zahlung	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.09.2025	7.800	198	0,03
Zahlung <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051	20.500	(80)	(0,01)
					£ (1.531)	(0,20)
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>£ (1.999)</b>	<b>(0,26)</b>

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> 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.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen UK Corporate Bond 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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700 %	17.03.2021	2.600	£ (3)	£ (2)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	5.300	(12)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	4.800	(4)	(3)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	15.100	(9)	(6)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	5.500	(3)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	7.900	(8)	(8)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	15.100	(11)	(12)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	5.500	(5)	(4)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	5.000	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	5.000	(6)	(6)	0,00
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	6.700	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	5.800	(6)	(6)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	11.600	(4)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	11.600	(15)	(14)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	3.600	(4)	(4)	0,00
GST	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	9.700	(5)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	9.700	(8)	(8)	0,00
						£ (112)	£ (92)	(0,01)

<sup>(1)</sup> 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	02.2021	£ 3.710	€ 4.083	£ 0	£ (53)	£ (53)	(0,01)
	02.2021	\$ 103.787	£ 78.688	2.787	0	2.787	0,36
GLM	02.2021	€ 4.196	£ 3.773	14	0	14	0,00
	02.2021	£ 2.155	AUD 3.918	57	0	57	0,01
	02.2021	2.135	NOK 25.675	57	0	57	0,01
	03.2021	\$ 2.840	IDR 40.697.200	50	0	50	0,01
HUS	02.2021	£ 2.461	£ 1.848	48	0	48	0,01
	03.2021	2.817	CNH 18.672	32	0	32	0,00
MYI	02.2021	€ 2.097	£ 1.879	1	0	1	0,00
	02.2021	£ 2.125	¥ 296.100	0	(26)	(26)	0,00
	02.2021	2.143	NZD 4.103	18	0	18	0,00
	02.2021	2.136	SEK 24.530	50	0	50	0,01
RBC	02.2021	£ 1.288	\$ 1.751	0	(7)	(7)	0,00
SCX	02.2021	€ 110.508	£ 99.419	435	(5)	430	0,05
SOG	02.2021	£ 5.325	\$ 7.181	0	(74)	(74)	(0,01)
SSB	02.2021	€ 932	£ 856	21	0	21	0,00
	02.2021	£ 12.981	€ 14.403	0	(80)	(80)	(0,01)
	02.2021	878	\$ 1.171	0	(22)	(22)	0,00
	02.2021	\$ 17.760	£ 13.272	284	0	284	0,04
UAG	02.2021	€ 1.147	£ 1.040	12	0	12	0,00
	02.2021	£ 2.798	€ 3.068	0	(49)	(49)	(0,01)
				£ 3.866	£ (316)	£ 3.550	0,46

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

£ 3.458 0,45

Summe Anlagen

£ 798.383 104,45

Sonstige Aktiva und Passiva

£ (34.024) (4,45)

Nettvermögen

£ 764.359 100,00

## 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) Nullkuponwertpapier.

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 51.513 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von GBP 1.156 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von GBP 10.250 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von GBP 1.060 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	£ 710.572	£ 1.883	£ 712.455
Investmentfonds	223	37.965	0	38.188
Pensionsgeschäfte	0	46.150	0	46.150
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	131	1.459	0	1.590
<b>Summen</b>	<b>£ 354</b>	<b>£ 796.146</b>	<b>£ 1.883</b>	<b>£ 798.383</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	£ 476.700	£ 0	£ 476.700
Investmentfonds	54.664	0	0	54.664
Pensionsgeschäfte	0	27.875	0	27.875
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(520)	2.272	0	1.752
<b>Summen</b>	<b>£ 54.144</b>	<b>£ 506.847</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 560.991</b>

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

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkei- ten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	0,210 %	04.12.2020	11.02.2021	£ (3.111)	£ (3.111)	(0,41)
		23.11.2020	11.02.2021	(5.571)	(5.573)	(0,73)
CEW	0,180	17.12.2020	11.02.2021	(13.488)	(13.488)	(1,76)
		18.11.2020	11.02.2021	(2.365)	(2.365)	(0,31)
JML	0,180	17.11.2020	11.02.2021	(4.286)	(4.287)	(0,56)
SCX	0,160	12.11.2020	11.02.2021	(21.639)	(21.644)	(2,83)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>£ (50.468)</b>	<b>(6,60)</b>

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	£ 2.732	£ (1.560)	£ 1.172
BPS	(46)	0	(46)
BRC	(32)	0	(32)
GLM	178	0	178
GST	(12)	0	(12)
HUS	80	0	80
MYI	43	0	43
RBC	(7)	0	(7)
SCX	430	1.060	1.490
SOG	(74)	0	(74)
SSB	203	0	203
UAG	(37)	0	(37)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	90,14	82,76
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	2,82	2,82
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,25	k. A.
Investmentfonds	4,99	9,81
Pensionsgeschäfte	6,04	5,00
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,02	(0,10)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,26)	(0,08)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,45	0,49
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(6,60)	(4,79)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Australien	0,11	0,67
Österreich	0,22	0,27
Belgien	0,79	0,41
Brasilien	0,17	0,23
Kanada	0,38	0,69
Cayman-Inseln	0,30	0,48
China	k. A.	0,05
Chile	0,17	k. A.
Dänemark	0,46	0,40
Finnland	0,18	0,05
Frankreich	5,08	5,33
Deutschland	2,35	1,49
Guernsey, Kanalinseln	0,07	0,43
Indien	0,03	k. A.
Irland	1,08	1,40
Insel Man	0,10	k. A.
Italien	2,05	0,75
Japan	0,38	0,42
Jersey, Kanalinseln	3,05	2,43
Luxemburg	2,67	2,63
Mauritius	0,11	0,25
Niederlande	8,20	6,74
Norwegen	0,31	k. A.
Singapur	0,39	0,50
Slowakei	k. A.	0,05
Slowenien	0,10	k. A.
Südkorea	k. A.	0,08
Spanien	2,54	0,96
Supranational	2,60	2,33
Schweden	0,07	0,03
Schweiz	2,02	1,19
Großbritannien	42,82	42,82
USA	14,41	12,50
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,00
Investmentfonds	4,99	9,81
Pensionsgeschäfte	6,04	5,00
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,02	(0,10)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	(0,03)	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzkauf	(0,03)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,00	0,12
Zinsswaps	(0,20)	(0,21)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	k. A.	0,01
Devisenterminkontrakte	0,46	0,49
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,45)	(0,70)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>



# 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
JAB Holdings BV 2,250 % fällig am 19.12.2039	€ 700	£702	0,19	Credit Suisse Group AG 4,194 % fällig am 01.04.2031	\$ 250	£216	0,06	GlaxoSmithKline Capital PLC 1,625 % fällig am 12.05.2035	€ 500	£ 528	0,14
LafargeHolcim Sterling Finance Netherlands BV 3,000 % fällig am 12.05.2032	£ 300	351	0,10	6,250 % fällig am 18.12.2024 (d)(f)	400	321	0,09	5,250 % fällig am 10.04.2042	100	171	0,05
Shell International Finance BV 1,750 % fällig am 10.09.2052	700	707	0,19	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (f)	300	243	0,07	6,375 % fällig am 09.03.2039	500	908	0,25
Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % fällig am (d)	€ 1.681	1.999	0,55	UBS Group AG 5,125 % fällig am 29.07.2026 (d)(f)	300	235	0,06	Grainger PLC 3,000 % fällig am 03.07.2030	1.900	2.076	0,57
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	500	483	0,13	Summe Schweiz		1.345	0,37	Great Places Housing Group Ltd. 4,750 % fällig am 22.10.2042	600	912	0,25
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£ 1.000	1.010	0,28	<b>GROSSBRITANNIEN</b>				Greene King Finance PLC 2,543 % fällig am 15.12.2033	382	367	0,10
Volkswagen International Finance NV 3,875 % fällig am 17.06.2029 (d)	€ 600	582	0,16	<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				3,593 % fällig am 15.03.2035	494	517	0,14
		23.049	6,32	3i Group PLC 3,750 % fällig am 05.06.2040	£ 1.300	1.518	0,42	4,064 % fällig am 15.03.2035	240	259	0,07
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Affinity Sutton Capital Markets PLC 5,981 % fällig am 17.09.2038	200	345	0,09	5,106 % fällig am 15.03.2034	2.224	2.556	0,70
Niederländse Waterschapsbank NV 5,375 % fällig am 07.06.2032	£ 500	764	0,21	Annington Funding PLC 3,685 % fällig am 12.07.2034	1.400	1.731	0,47	5,318 % fällig am 15.09.2031	2.268	2.606	0,71
Summe Niederlande		23.813	6,53	3,935 % fällig am 12.07.2047	1.000	1.356	0,37	Guinness Partnership Ltd. 2,000 % fällig am 22.04.2055	1.510	1.720	0,47
<b>NORWEGEN</b>				Arqiva Financing PLC 4,882 % fällig am 31.12.2032	1.012	1.191	0,33	Hammerson PLC 6,000 % fällig am 23.02.2026 (g)	300	322	0,09
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				5,340 % fällig am 30.12.2037	700	894	0,25	High Speed Rail Finance PLC 4,375 % fällig am 01.11.2038	800	1.077	0,30
Aker BP ASA 3,750 % fällig am 15.01.2030	\$ 150	116	0,03	Aviva PLC 4,000 % fällig am 03.06.2055	1.000	1.161	0,32	Home Group Ltd. 3,125 % fällig am 27.03.2043	1.300	1.616	0,44
Equinor ASA 6,875 % fällig am 11.03.2031	£ 100	158	0,05	Barclays PLC 3,250 % fällig am 17.01.2033	1.430	1.688	0,46	HSBC Bank PLC 4,750 % fällig am 24.03.2046	2.950	4.187	1,15
Summe Norwegen		274	0,08	7,125 % fällig am 15.06.2025 (d)(f)	400	447	0,12	5,375 % fällig am 22.08.2033	600	846	0,23
<b>SINGAPUR</b>				7,250 % fällig am 15.03.2023 (d)(f)	400	425	0,12	HSBC Holdings PLC 3,000 % fällig am 29.05.2030	800	913	0,25
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				7,875 % fällig am 15.09.2022 (d)(f)	525	560	0,15	4,600 % fällig am 17.12.2030 (d)(f)	\$ 200	149	0,04
Temasek Financial Ltd. 5,125 % fällig am 26.07.2040	950	1.638	0,45	8,000 % fällig am 15.06.2024 (d)(f)	\$ 800	653	0,18	4,950 % fällig am 31.03.2030	200	184	0,05
<b>SPANIEN</b>				BPHA Finance PLC 4,816 % fällig am 11.04.2044	£ 395	633	0,17	6,000 % fällig am 29.03.2040	£ 600	888	0,24
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				British Land Co. PLC 2,375 % fällig am 14.09.2029	700	728	0,20	Informa PLC 2,125 % fällig am 06.10.2025	€ 600	567	0,16
Abertis Infraestructuras S.A. 2,250 % fällig am 29.03.2029	€ 700	689	0,19	British Telecommunications PLC 3,625 % fällig am 21.11.2047	300	375	0,10	Jaguar Land Rover Automotive PLC 5,875 % fällig am 15.11.2024	400	367	0,10
3,375 % fällig am 27.11.2026	£ 1.900	2.092	0,58	6,375 % fällig am 23.06.2037	250	397	0,11	John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034	£ 2.422	2.510	0,69
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (d)(f)	€ 200	188	0,05	Broadgate Financing PLC 4,999 % fällig am 05.10.2033	600	710	0,19	Juturna European Loan Conduit PLC 5,064 % fällig am 10.08.2033	1.101	1.397	0,38
6,000 % fällig am 15.01.2026 (d)(f)	600	594	0,16	5,098 % fällig am 05.04.2035	91	109	0,03	Karbon Homes Ltd. 3,375 % fällig am 15.11.2047	200	283	0,08
8,875 % fällig am 14.04.2021 (d)(f)	600	549	0,15	Bunzl Finance PLC 1,500 % fällig am 30.10.2030	700	724	0,20	Land Securities Capital Markets PLC 2,625 % fällig am 22.09.2039	920	1.048	0,29
Banco Santander S.A. 6,750 % fällig am 25.04.2022 (d)(f)	200	190	0,05	Cadent Finance PLC 2,625 % fällig am 22.09.2038	3.350	3.833	1,05	LCR Finance PLC 4,500 % fällig am 07.12.2038	75	121	0,03
		4.302	1,18	2,750 % fällig am 22.09.2046	800	933	0,26	Legal & General Group PLC 4,500 % fällig am 01.11.2050	300	347	0,10
<b>STAATSEMISSIONEN</b>				Catalyst Housing Ltd. 3,125 % fällig am 31.10.2047	1.000	1.296	0,36	5,375 % fällig am 27.10.2045	900	1.058	0,29
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030 (g)	6.300	5.911	1,62	Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge 2,350 % fällig am 27.06.2078	200	327	0,09	5,625 % fällig am 24.03.2031 (d)(f)	1.300	1.447	0,40
Summe Spanien		10.213	2,80	Chanel Ceres PLC 1,000 % fällig am 31.07.2031	€ 800	739	0,20	Liberty Living Finance PLC 3,375 % fällig am 28.11.2029	600	669	0,18
<b>SUPRANATIONAL</b>				Citizen Treasury PLC 3,250 % fällig am 20.10.2048	£ 1.100	1.499	0,41	Lloyds Bank PLC 6,500 % fällig am 17.09.2040	100	189	0,05
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Clarion Funding PLC 1,875 % fällig am 22.01.2035	1.300	1.406	0,39	Lloyds Banking Group PLC 5,125 % fällig am 27.12.2024 (d)(f)	400	419	0,11
Europäische Investitionsbank 6,000 % fällig am 07.12.2028 (g)	£ 7.100	10.240	2,81	3,125 % fällig am 19.04.2048	1.950	2.624	0,72	7,625 % fällig am 27.06.2023 (d)(f)	1.000	1.102	0,30
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.11.2025 (c)	€ 800	739	0,21	Connect Plus M25 Issuer PLC 2,607 % fällig am 31.03.2039	1.235	1.436	0,39	7,875 % fällig am 27.06.2029 (d)(f)	200	248	0,07
0,000 % fällig am 04.10.2030 (c)	1.300	1.212	0,33	Direct Line Insurance Group PLC 4,000 % fällig am 05.06.2032	300	352	0,10	London & Quadrant Housing Trust 2,000 % fällig am 20.10.2038	1.500	1.597	0,44
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 0,100 % fällig am 17.09.2035	1.200	1.100	0,30	Drax Finco PLC 6,625 % fällig am 01.11.2025	\$ 200	154	0,04	3,125 % fällig am 28.02.2053	900	1.198	0,33
Summe Supranational		13.291	3,65	DS Smith PLC 2,875 % fällig am 26.07.2029	£ 500	551	0,15	3,750 % fällig am 27.10.2049	300	433	0,12
<b>SCHWEDEN</b>				Eastern Power Networks PLC 1,875 % fällig am 01.06.2035	1.400	1.511	0,41	Longstone Finance PLC 4,896 % fällig am 19.04.2036	100	122	0,03
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				2,125 % fällig am 25.11.2033	900	1.014	0,28	M&G PLC 5,560 % fällig am 20.07.2055	850	1.022	0,28
Investor AB 5,500 % fällig am 05.05.2037	£ 400	635	0,17	EMH Treasury PLC 4,500 % fällig am 29.01.2044	1.000	1.539	0,42	6,340 % fällig am 19.12.2063	700	929	0,25
<b>SCHWEIZ</b>				Eversholt Funding PLC 3,529 % fällig am 07.08.2042	1.000	1.196	0,33	Manchester Airport Group Funding PLC 2,875 % fällig am 30.09.2044	1.450	1.538	0,42
<b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>				Frontier Finance PLC 8,000 % fällig am 23.03.2022	2.100	2.166	0,59	Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	200	205	0,06
Credit Suisse AG 6,500 % fällig am 08.08.2023 (f)	\$ 400	330	0,09	Futures Treasury PLC 3,375 % fällig am 08.02.2044	700	944	0,26	6,000 % fällig am 12.06.2025	1.150	1.285	0,35
								Meadowhall Finance PLC 4,988 % fällig am 12.07.2037	68	81	0,02
								Mitchells & Butlers Finance PLC 0,667 % fällig am 15.12.2030	\$ 753	501	0,14
								1,918 % fällig am 15.09.2034	£ 993	725	0,20
								5,965 % fällig am 15.12.2025	139	144	0,04
								6,013 % fällig am 15.12.2030	519	555	0,15



# 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
Ford Motor Credit Co. LLC 2,748 % fällig am 14.06.2024	£ 700	£ 701	0,19	MPT Operating Partnership LP 3,692 % fällig am 05.06.2028	£ 1.650	£ 1.791	0,49	<b>NON-AGENCY-MBS</b>			
4,535 % fällig am 06.03.2025	700	745	0,20	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2030	€ 300	306	0,08	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 0,648 % fällig am 25.04.2035	\$ 232	£ 150	0,04
General Electric Co. 5,250 % fällig am 07.12.2028	1.400	1.769	0,49	4,875 % fällig am 15.06.2030	\$ 100	84	0,02	GSR Mortgage Loan Trust 3,245 % fällig am 25.09.2035	1	1	0,00
5,375 % fällig am 18.12.2040	1.200	1.678	0,46	NiSource, Inc. 3,600 % fällig am 01.05.2030	100	85	0,02	HomeBanc Mortgage Trust 1,153 % fällig am 25.07.2035	2.557	1.843	0,51
GlaxoSmithKline Capital, Inc. 4,200 % fällig am 18.03.2043	\$ 2.300	2.183	0,60	Northern States Power Co. 2,900 % fällig am 01.03.2050	400	331	0,09	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 0,599 % fällig am 15.12.2030	7	5	0,00
6,375 % fällig am 15.05.2038	900	1.041	0,29	Pfizer, Inc. 2,735 % fällig am 15.06.2043	£ 2.750	3.471	0,95	Sequoia Mortgage Trust 3,211 % fällig am 20.07.2037 ^	13	9	0,00
Goldman Sachs Group, Inc. 4,411 % fällig am 23.04.2039	1.000	936	0,26	Time Warner Cable LLC 4,500 % fällig am 15.09.2042	\$ 600	515	0,14				
HCA, Inc. 4,500 % fällig am 15.02.2027	900	766	0,21	5,250 % fällig am 15.07.2042	£ 1.586	2.257	0,62	Summe USA		64.796	17,77
Home Depot, Inc. 3,500 % fällig am 15.09.2056	100	92	0,03	Union Electric Co. 2,625 % fällig am 15.03.2051	\$ 700	537	0,15	Summe Übertragbare Wertpapiere		£ 409.471	112,29
IPALCO Enterprises, Inc. 4,250 % fällig am 01.05.2030	100	85	0,02	Verizon Communications, Inc. 3,375 % fällig am 27.10.2036	£ 1.000	1.283	0,35				
Kinder Morgan, Inc. 5,050 % fällig am 15.02.2046	100	89	0,02	4,400 % fällig am 01.11.2034	\$ 1.000	914	0,25	<b>AKTIEN</b>			
5,300 % fällig am 01.12.2034	200	180	0,05	Walmart, Inc. 2,950 % fällig am 24.09.2049	700	592	0,16	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
Liberty Utilities Finance GP 2,050 % fällig am 15.09.2030	600	442	0,12	3,950 % fällig am 28.06.2038	1.500	1.402	0,38	<b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>			
McDonald's Corp. 2,950 % fällig am 15.03.2034	£ 600	720	0,20	5,625 % fällig am 27.03.2034	£ 250	400	0,11	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	13.500	1.205	0,33
Merck & Co., Inc. 3,700 % fällig am 10.02.2045	\$ 300	274	0,08	Wells Fargo & Co. 2,125 % fällig am 24.09.2031	1.550	1.686	0,46	PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (e)	54.500	5.603	1,54
Microsoft Corp. 2,525 % fällig am 01.06.2050	1.000	773	0,21	4,625 % fällig am 02.11.2035	1.429	2.032	0,56			6.808	1,87
2,675 % fällig am 01.06.2060	800	637	0,18	4,875 % fällig am 29.11.2035	950	1.299	0,36	Summe Investmentfonds		£ 6.808	1,87
MidAmerican Energy Co. 4,250 % fällig am 15.07.2049	100	98	0,03	Welltower, Inc. 4,500 % fällig am 01.12.2034	400	517	0,14				
Mondelez International, Inc. 3,875 % fällig am 06.03.2045	£ 100	126	0,04			60.525	16,60				

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 902	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	£ (673)	£ 660	£ 660	0,18
RYL	(0,500)	31.12.2020	04.01.2021	£ 4.600	United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 07.09.2037	(4.609)	4.600	4.600	1,26
Summe Pensionsgeschäfte						£ (5.282)	£ 5.260	£ 5.260	1,44

(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
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2021	18	£ 2	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2021	39	1	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2021	41	(8)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	19	(8)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2021	5	15	0,00
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2021	302	360	0,10
				£ 362	0,10
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				£ 362	0,10

## 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Auchan Holding S.A.	1,000 %	20.12.2027	€ 100	£ 2	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2023	\$ 800	(1)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	100	1	0,00

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Rolls-Royce PLC	1,000 %	20.06.2024	€ 200	£ (10)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	2.600	83	0,02
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	600	0	0,00
				£ 75	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-33 5-Year Index	1,000 %	20.12.2024	\$ 700	£ 3	0,00
CDX.IG-34 5-Year Index	1,000	20.06.2025	500	2	0,00
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	1.500	1	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 15.900	23	0,01
				£ 29	0,01

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000 %	16.12.2030	\$ 9.200	£ 65	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,250	21.06.2022	19.600	25	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,250	17.06.2030	2.900	27	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,250	16.12.2050	2.900	95	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,500	18.12.2029	6.400	62	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,625	16.01.2050	100	3	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,625	03.02.2050	300	10	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,750	21.06.2047	1.300	47	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,750	18.12.2049	400	16	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,750	22.01.2050	100	4	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,000	12.02.2045	6.600	202	0,06
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,000	15.01.2050	100	4	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		2,250	12.03.2050	2.100	91	0,02
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,000	17.03.2051	€ 500	3	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,000	16.06.2051	1.300	0	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,250	17.03.2031	1.800	1	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,250	16.06.2031	5.000	3	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,500	16.06.2023	3.600	2	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,500	17.03.2026	4.400	5	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR		0,500	16.06.2026	3.400	7	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,000	16.06.2023	£ 21.700	6	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,000	17.03.2026	4.100	(15)	0,00
Erhalt <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,000	16.06.2026	26.800	1	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,250	16.06.2031	18.600	128	0,04
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,250	17.03.2051	3.300	69	0,02
Erhalt	6-Month GBP-LIBOR		0,500	16.09.2025	6.400	(1)	0,00
Zahlung <sup>(3)</sup>	6-Month GBP-LIBOR		0,500	16.06.2051	15.500	(61)	(0,02)
						£ 799	0,22
						£ 903	0,25

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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 <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700 %	17.03.2021	1.200	£ (1)	£ (1)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	2.200	(5)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	2.200	(2)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	6.800	(4)	(3)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	2.400	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	3.500	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	6.800	(5)	(6)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800 %	17.03.2021	2.400	£ (2)	£ (2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	2.200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	2.200	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	3.000	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	2.600	(3)	(2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	4.800	(2)	(2)	0,00
GST	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	4.800	(6)	(6)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.04.2021	1.100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	4.300	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	4.300	(4)	(3)	0,00
						£ (48)	£ (40)	(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	02.2021	\$ 61.677	£ 46.762	£ 1.656	£ 0	£ 1.656	0,45
BPS	02.2021	£ 838	\$ 1.130	0	(12)	(12)	0,00
BRC	02.2021	1.765	2.324	0	(65)	(65)	(0,02)
GLM	02.2021	\$ 400	£ 295	3	0	3	0,00
	02.2021	€ 1.896	£ 1.705	6	0	6	0,00
	02.2021	£ 973	AUD 1.768	26	0	26	0,01
	02.2021	664	€ 742	0	0	0	0,00
	02.2021	960	NOK 11.545	26	0	26	0,01
	02.2021	3.588	\$ 4.784	0	(89)	(89)	(0,03)
HUS	02.2021	\$ 992	£ 790	5	0	5	0,00
	03.2021	1.277	IDR 18.299.410	23	0	23	0,01
	02.2021	£ 418	\$ 560	0	(9)	(9)	0,00
	02.2021	\$ 1.319	£ 994	30	0	30	0,01
MYI	03.2021	1.267	CNH 8.395	14	0	14	0,00
	02.2021	€ 880	£ 799	11	0	11	0,00
	02.2021	£ 955	¥ 133.100	0	(12)	(12)	0,00
	02.2021	964	NZD 1.845	8	0	8	0,00
SCX	02.2021	€ 27.265	24.527	106	(2)	104	0,03
SOG	02.2021	£ 3.748	\$ 5.037	0	(64)	(64)	(0,02)
SSB	02.2021	526	£ 701	0	(13)	(13)	0,00
	02.2021	\$ 8.299	£ 6.202	133	0	133	0,04
						£ 1.813	0,50

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

£ 1.773 0,49

Summe Anlagen

£ 424.577 116,44

Sonstige Aktiva und Passiva

£ (59.946) (16,44)

Nettovermögen

£ 364.631 100,00

## 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) Nullkuponwertpapier.

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 71.687 und Barmittel in Höhe von GBP 386 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von GBP 1.502 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von GBP 7.724 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von GBP 240 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	362	2.676	0	3.038
<b>Summen</b>	<b>£ 1.567</b>	<b>£ 422.118</b>	<b>£ 892</b>	<b>£ 424.577</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	£ 483.963	£ 0	£ 483.964
Investmentfonds	4.929	0	0	4.929
Pensionsgeschäfte	0	1.319	0	1.319
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(243)	1.315	0	1.072
<b>Summen</b>	<b>£ 4.687</b>	<b>£ 486.597</b>	<b>£ 0</b>	<b>£ 491.284</b>

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

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	(0,480) %	18.11.2020	17.02.2021	€ (6.594)	£ (5.899)	(1,62)
	0,200	23.11.2020	11.02.2021	£ (1.111)	(1.111)	(0,31)
BRC	(0,350)	09.07.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(302)	(302)	(0,08)
CEW	0,200	13.11.2020	11.02.2021	(14.725)	(14.729)	(4,04)
IND	0,070	13.11.2020	11.02.2021	(10.547)	(10.548)	(2,89)
SCX	0,160	12.11.2020	11.02.2021	(37.847)	(37.855)	(10,38)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>£ (70.444)</b>	<b>(19,32)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	£ 1.655	£ (930)	£ 725
BPS	(33)	0	(33)
BRC	(75)	0	(75)
GLM	(3)	0	(3)
GST	(5)	0	(5)
HUS	35	0	35
MYI	39	0	39
SCX	104	240	344
SOG	(64)	0	(64)
SSB	120	0	120

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	108,26	116,67
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	3,79	2,26
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,24	k. A.
Investmentfonds	1,87	1,21
Pensionsgeschäfte	1,44	0,32
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	(0,06)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,25	(0,12)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,49	0,45
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(19,32)	(25,89)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Australien	k. A.	1,10
Österreich	0,23	0,22
Belgien	0,32	0,05
Bermuda	0,22	0,36
Brasilien	k. A.	0,08
Kanada	0,07	k. A.
Cayman-Inseln	0,67	0,84
Dänemark	0,26	0,92
Finnland	0,15	k. A.
Frankreich	5,64	5,72
Deutschland	4,69	4,86
Guernsey, Kanalinseln	0,43	0,48
Hongkong	0,04	0,04
Indien	0,04	k. A.
Irland	1,54	1,73
Italien	1,82	0,82
Japan	k. A.	0,10
Jersey, Kanalinseln	3,17	2,78
Luxemburg	1,29	1,92
Mauritius	0,15	0,13
Mexiko	0,19	k. A.
Niederlande	6,53	6,35
Norwegen	0,08	0,04
Singapur	0,45	0,76
Spanien	2,80	0,56
Supranational	3,65	3,63
Schweden	0,17	0,15
Schweiz	0,37	0,61
Großbritannien	59,55	67,60
USA	17,77	17,08
Investmentfonds	1,87	1,21
Pensionsgeschäfte	1,44	0,32
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,10	(0,06)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,02	0,05
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,01	0,09
Zinsswaps	0,22	(0,26)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	k. A.	0,03
Devisenterminkontrakte	0,50	0,43
Sonstige Aktiva und Passiva	(16,44)	(20,73)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>











# Aufstellung der Wertpapieranlagen US High Yield 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
Frontier Communications Corp. 5,000 % fällig am 01.05.2028	2.250	\$ 2.350	0,06	TerraForm Power Operating LLC 4,250 % fällig am 31.01.2023	3.000	\$ 3.107	0,08	ENERGIE			
5,875 % fällig am 15.10.2027	3.000	3.249	0,08	5,000 % fällig am 31.01.2028	3.750	4.221	0,10	CHC Group LLC (c)	77.756	\$ 1	0,00
6,750 % fällig am 01.05.2029	3.500	3.752	0,09	Transocean Sentry Ltd. 5,375 % fällig am 15.05.2023	2.882	2.630	0,06	Noble Corp. PLC (c)(i)	87.829	784	0,02
Genesis Energy LP 6,500 % fällig am 01.10.2025	3.000	2.923	0,07	Vistra Operations Co. LLC 5,000 % fällig am 31.07.2027	3.000	3.183	0,08			785	0,02
7,750 % fällig am 01.02.2028	1.750	1.677	0,04	5,625 % fällig am 15.02.2027	2.000	2.130	0,05	FINANZWERTE			
8,000 % fällig am 15.01.2027	2.000	1.985	0,05			240.169	5,92	DB Investors, Inc. (c)(i)	30	0	0,00
Great Western Petroleum LLC 9,000 % fällig am 30.09.2021	2.000	1.180	0,03	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		3.312.249	81,68	GESUNDHEITSWESEN			
High Ridge Brands Co. 8,875 % fällig am 15.03.2025	2.500	87	0,00	US-SCHATZOBIGATIONEN				Advanz Pharma Corp. Ltd. (c)	12.587	56	0,00
NGL Energy Partners LP 6,125 % fällig am 01.03.2025	1.625	1.034	0,02	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	10.000	9.778	0,24	BAUSTOFFE			
7,500 % fällig am 01.11.2023	2.000	1.420	0,03	0,875 % fällig am 15.11.2030	30.000	29.904	0,74	Associated Materials Group, Inc. (c)(i)	2.063.103	13.905	0,34
NRG Energy, Inc. 3,375 % fällig am 15.02.2029	2.000	2.051	0,05	1,500 % fällig am 15.02.2030	20.000	21.162	0,52	Hexion Holdings Corp. 'B' (c)(i)	56.075	687	0,02
3,625 % fällig am 15.02.2031	3.000	3.092	0,08			60.844	1,50			14.592	0,36
5,250 % fällig am 15.06.2029	1.000	1.102	0,03	NON-AGENCY-MBS						15.829	0,39
6,625 % fällig am 15.01.2027	2.750	2.908	0,07	Banc of America Funding Trust 2,954 % fällig am 20.02.2036 ^	123	118	0,00	OPTIONSSCHEINE			
NSG Holdings LLC 7,750 % fällig am 15.12.2025	1.991	2.118	0,05	Countrywide Alternative Loan Trust 6,12 % fällig am 20.05.2046 ^	78	66	0,00	DB Investors, Inc. - Exp. 18.01.2024 (i)	113	0	0,00
Parsley Energy LLC 4,125 % fällig am 15.02.2028	3.000	3.156	0,08	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0,788 % fällig am 25.03.2035	24	21	0,00	iHeartMedia, Inc. 'A' - Exp. 01.05.2039	59.357	758	0,02
5,250 % fällig am 15.08.2025	2.500	2.610	0,06	0,848 % fällig am 25.02.2036 ^	17	5	0,00			758	0,02
5,375 % fällig am 15.01.2025	5.000	5.151	0,13	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust 5,863 % fällig am 25.02.2037 ^	397	158	0,01	VORZUGSWERTPAPIERE			
5,625 % fällig am 15.10.2027	4.000	4.384	0,11	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	59	57	0,00	Sequa Corp. 12,000 %	3.534	5.050	0,13
PG&E Corp. 5,000 % fällig am 01.07.2028	2.000	2.133	0,05	GSR Mortgage Loan Trust 2,824 % fällig am 25.04.2035	2	2	0,00				
5,250 % fällig am 01.07.2030	5.000	5.506	0,14	IndyMac Mortgage Loan Trust 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	266	259	0,01	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
Sprint Capital Corp. 6,875 % fällig am 15.11.2028	5.000	6.602	0,16	MortgageIT Trust 0,788 % fällig am 25.02.2035	69	71	0,00	U.S. TREASURY BILLS			
8,750 % fällig am 15.03.2032	7.500	11.883	0,29	Residential Accredit Loans, Inc. Trust 0,688 % fällig am 25.05.2046 ^	120	103	0,00	0,094 % fällig am 25.05.2021 (d)(e)	\$ 89.000	88.976	2,20
Sprint Corp. 7,125 % fällig am 15.06.2024	5.000	5.856	0,14	TBW Mortgage-Backed Trust 6,470 % fällig am 25.09.2036 ^	662	33	0,00	Summe kurzfristige Instrumente		88.976	2,20
7,250 % fällig am 15.09.2021	10.000	10.418	0,26	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 2,722 % fällig am 25.12.2036 ^	237	236	0,01	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 3.573.957	88,14
7,625 % fällig am 15.02.2025	8.750	10.480	0,26	3,037 % fällig am 25.10.2036 ^	135	133	0,00				
7,625 % fällig am 01.03.2026	3.000	3.728	0,09			1.262	0,03	AKTIEN			
7,875 % fällig am 15.09.2023	10.000	11.591	0,29	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				INVESTMENTFONDS			
Talen Energy Supply LLC 6,500 % fällig am 01.06.2025	2.000	1.636	0,04	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 0,218 % fällig am 25.01.2037 ^	88	36	0,00	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
6,625 % fällig am 15.01.2028	1.000	1.048	0,03					PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)	661.211	7.730	0,19
7,250 % fällig am 15.05.2027	2.000	2.133	0,05	AKTIEN				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	38.745.187	385.979	9,52
10,500 % fällig am 15.01.2026	3.000	2.676	0,07	STAMMAKTIE						393.709	9,71
Tallgrass Energy Partners LP 5,500 % fällig am 15.09.2024	5.000	5.100	0,13	KOMMUNIKATIONSDIENSTE				Summe Investmentfonds		\$ 393.709	9,71
5,500 % fällig am 15.01.2028	1.750	1.792	0,04	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)	167.378	276	0,01				
6,000 % fällig am 31.12.2030	3.000	3.093	0,08	iHeartMedia, Inc. 'A' (c)	9.114	118	0,00				
7,500 % fällig am 01.10.2025	1.000	1.081	0,03	iHeartMedia, Inc. 'B' (c)	122	2	0,00				
Targa Resources Partners LP 4,250 % fällig am 15.11.2023	1.750	1.763	0,04			396	0,01				
4,875 % fällig am 01.02.2031	4.000	4.364	0,11								
5,000 % fällig am 15.01.2028	5.000	5.287	0,13								
5,500 % fällig am 01.03.2030	500	543	0,01								
5,875 % fällig am 15.04.2026	2.000	2.124	0,05								
6,500 % fällig am 15.07.2027	2.500	2.719	0,07								
6,875 % fällig am 15.01.2029	2.000	2.256	0,06								
Telecom Italia Capital S.A. 6,375 % fällig am 15.11.2033	3.500	4.313	0,11								
7,200 % fällig am 18.07.2036	2.000	2.705	0,07								
Telecom Italia SpA 5,303 % fällig am 30.05.2024	3.500	3.812	0,09								

## PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOS	0,070 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 12.700	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.12.2027	\$ (12.958)	\$ 12.700	\$ 12.700	0,31
FICC	0,000	31.12.2020	04.01.2021	2.200	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	(2.244)	2.200	2.200	0,05
GSC	0,070	31.12.2020	04.01.2021	12.400	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.08.2049	(12.944)	12.400	12.400	0,31
TDM	0,090	31.12.2020	04.01.2021	3.500	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.11.2022	(3.580)	3.500	3.500	0,09
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (31.726)	\$ 30.800	\$ 30.800	0,76

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**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<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000 %	20.12.2025	\$ 240.000	\$ 6.258	0,15
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ 6.258	0,15

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	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	\$ 10.000	22.03.2021	\$ (19)	\$ 1.257	\$ 1.238	0,03	
	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	160.000	21.06.2021	(82)	1.493	1.411	0,04	
GST	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	45.000	22.03.2021	(104)	3.344	3.240	0,08	
MYC	Zahlung	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	10.000	22.03.2021	(2)	818	816	0,02	
								\$ (207)	\$ 6.912	\$ 6.705	0,17

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2021	£ 3.812	\$ 5.091	\$ 0	\$ (120)	\$ (120)	0,00
HUS	02.2021	¥ 8.437	80	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2021	\$ 214	€ 175	1	0	1	0,00
SCX	01.2021	£ 108	€ 80	0	0	0	0,00
	01.2021	€ 70.766	\$ 84.749	0	(1.837)	(1.837)	(0,05)
	02.2021	70.766	86.644	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1	\$ (1.959)	\$ (1.958)	(0,05)

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklasse Institutional 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	01.2021	CHF 1	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2021	\$ 866	CHF 782	19	0	19	0,00
CBK	01.2021	77	68	0	0	0	0,00
GLM	01.2021	4	3	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	975	883	24	0	24	0,00
SCX	01.2021	107	97	3	0	3	0,00
SSB	01.2021	983	886	19	0	19	0,00
UAG	01.2021	CHF 162	\$ 183	0	0	0	0,00
				\$ 65	\$ 0	\$ 65	0,00

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	€ 545	\$ 669	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BPS	01.2021	2.924	3.546	0	(33)	(33)	0,00
CBK	01.2021	\$ 179.312	€ 149.572	3.705	(7)	3.698	0,09
	01.2021	312	259	5	0	5	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen US High Yield Bond 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
HUS	01.2021	€ 3.743	\$ 4.557	\$ 0	\$ (22)	\$ (22)	0,00
	01.2021	\$ 21.869	€ 18.244	455	(1)	454	0,01
JPM	01.2021	38	31	0	0	0	0,00
MYI	01.2021	€ 297	\$ 362	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2021	\$ 211.212	€ 176.362	4.575	0	4.575	0,11
	02.2021	326.187	266.408	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2021	199.143	166.284	4.314	0	4.314	0,11
	02.2021	268.129	218.990	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 13.056	\$ (66)	\$ 12.990	0,32

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	\$ 2.567	£ 1.922	\$ 60	\$ 0	\$ 60	0,00
BRC	01.2021	53	39	1	0	1	0,00
CBK	01.2021	£ 81	\$ 111	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 17.825	£ 13.334	403	0	403	0,01
HUS	01.2021	21.251	15.893	475	0	475	0,01
MYI	01.2021	£ 9	\$ 12	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 142	£ 105	1	0	1	0,00
SCX	01.2021	178	133	3	0	3	0,00
SSB	01.2021	22.181	16.617	535	0	535	0,02
				\$ 1.478	\$ 0	\$ 1.478	0,04
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 19.280	0,48
Summe Anlagen						\$ 4.024.004	99,24
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 30.923	0,76
Nettovermogen						\$ 4.054.927	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	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Associated Materials Group, Inc.	24.08.2020	\$ 13.101	\$ 13.905	0,34
DB Investors, Inc.	18.02.2015	0	0	0,00
DB Investors, Inc. - Exp. 18.01.2024	18.02.2015	0	0	0,00
Hexion Holdings Corp. 'B'	02.07.2013 - 15.06.2018	4.119	687	0,02
Noble Corp. PLC	23.12.2020	0	784	0,02
Occidental Petroleum Corp, 5,500 % fallig am 01.12.2025	08.12.2020	4.000	4.178	0,10
Occidental Petroleum Corp, 6,125 % fallig am 01.01.2031	08.12.2020	1.000	1.073	0,03
		\$ 22.220	\$ 20.627	0,51

(j) Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere in Hohe von USD 23.233 als Sicherheiten verpfandet.

Gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen fur Pensionsgeschafte wurden 31. Dezember 2020 Barmittel in Hohe von USD 1.412 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Hohe von USD 23.823 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	0	25.538	0	25.538
<b>Summen</b>	<b>\$ 394.847</b>	<b>\$ 3.605.861</b>	<b>\$ 23.296</b>	<b>\$ 4.024.004</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 1.345	\$ 2.513.170	\$ 3.648	\$ 2.518.163
Investmentfonds	276.321	0	0	276.321
Pensionsgeschäfte	0	21.768	0	21.768
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	0	14.802	0	14.802
<b>Summen</b>	<b>\$ 277.666</b>	<b>\$ 2.549.740</b>	<b>\$ 3.648</b>	<b>\$ 2.831.054</b>

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

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	(0,750) %	17.11.2020	TBD <sup>(1)</sup>	\$ (921)	\$ (920)	(0,02)
	(0,200)	14.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(4.965)	(4.964)	(0,12)
	0,000	02.09.2020	14.05.2022	(441)	(441)	(0,01)
	0,000	07.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.220)	(1.220)	(0,03)
	0,000	07.12.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(3.365)	(3.365)	(0,09)
	0,250	04.05.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.992)	(1.996)	(0,05)
JPS	(0,500)	20.10.2020	21.01.2021	(779)	(779)	(0,02)
RDR	(0,850)	31.07.2020	TBD <sup>(1)</sup>	(1.583)	(1.577)	(0,04)
<b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>					<b>\$ (15.262)</b>	<b>(0,38)</b>

<sup>(1)</sup> 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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ 21	\$ 0	\$ 21
BPS	3.605	(4.440)	(835)
BRC	2.650	(2.610)	40
CBK	408	(340)	68
GST	3.240	(3.130)	110
HUS	906	(900)	6
MYC	816	(630)	186
MYI	25	(10)	15
SCX	2.742	(3.370)	(628)
SSB	554	(350)	204
TOR	4.313	(5.360)	(1.047)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	41,03	29,58
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	43,49	60,42
Sonstige übertragbare Wertpapiere	3,62	k. A.
Investmentfonds	9,71	9,87
Pensionsgeschäfte	0,76	0,78
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,15	0,11
Freiverkehrsfinanzderivate	0,48	0,42
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,38)	(0,33)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,76)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

<b>Anlagen zum Marktwert</b>	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	2,19	1,46
Unternehmensanleihen und Wechsel	81,68	84,07
Wandelanleihen & Wechsel	k. A.	0,03
US-Schatzobligationen	1,50	4,17
Non-Agency-MBS	0,03	0,05
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,00	0,00
Stammaktien	0,39	0,05
Optionsscheine	0,02	0,04
Vorzugswertpapiere	0,13	0,13
Kurzfristige Instrumente	2,20	k. A.
Investmentfonds	9,71	9,87
Pensionsgeschäfte	0,76	0,78
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,15	0,11
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	0,17	0,05
Devisenterminkontrakte	(0,05)	(0,02)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,36	0,39
Sonstige Aktiva und Passiva	0,76	(1,18)
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
Southern California Edison Co. 2,850 % fällig am 01.08.2029	\$ 800	\$ 874	0,07	<b>US-SCHATZobligationen</b>				6,950 % fällig am 12.08.2031	PEN	12.600	0,38
3,650 % fällig am 01.02.2050	1.300	1.481	0,12	U.S. Treasury Bonds				8,200 % fällig am 12.08.2026		15.100	0,48
3,700 % fällig am 01.08.2025	500	561	0,05	1,250 % fällig am 15.05.2050	\$ 5.944	\$ 5.394	0,46	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
3,900 % fällig am 01.12.2041	108	117	0,01	1,375 % fällig am 15.08.2050	20.760	19.448	1,65	2,800 % fällig am 23.06.2030	\$ 300	319	0,03
4,125 % fällig am 01.03.2048	1.200	1.435	0,12	2,000 % fällig am 15.02.2050 (f)	41.050	44.597	3,78	Qatar Government International Bond			
4,200 % fällig am 01.03.2029	200	237	0,02	2,250 % fällig am 15.08.2049	13.782	15.776	1,33	3,750 % fällig am 16.04.2030	2.500	2.947	0,25
4,650 % fällig am 01.10.2043	400	497	0,04	U.S. Treasury Notes				South Africa Government International Bond			
5,950 % fällig am 01.02.2038	200	272	0,02	0,875 % fällig am 15.11.2030 (f)	8.670	8.643	0,73	4,850 % fällig am 30.09.2029	300	319	0,03
6,650 % fällig am 01.04.2029	2.035	2.565	0,22			93.858	7,95	Ukraine Government International Bond			
				<b>NON-AGENCY-MBS</b>				7,750 % fällig am 01.09.2021	100	104	0,01
Southern Co. Gas Capital Corp. 1,750 % fällig am 15.01.2031	500	504	0,04	Countrywide Alternative Loan Trust				7,750 % fällig am 01.09.2022	400	429	0,03
3,250 % fällig am 15.06.2026	2.700	3.034	0,26	1,959 % fällig am 25.08.2035 ^	47	43	0,01			23.422	1,98
Sprint Communications, Inc. 6,000 % fällig am 15.11.2022	300	325	0,03	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust							
Sprint Corp. 7,125 % fällig am 15.06.2024	100	117	0,01	0,575 % fällig am 25.11.2034	285	258	0,02	<b>AKTIEN</b>			
7,250 % fällig am 15.09.2021	300	313	0,03			301	0,03	<b>OPTIONSSCHEINE</b>			
7,875 % fällig am 15.09.2023	700	811	0,07	<b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>				Stearns Holdings LLC 'B' - Exp. 05.11.2039	14.204	0	0,00
State Grid Overseas Investment Ltd. 1,625 % fällig am 05.08.2030	200	194	0,02	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust							
3,750 % fällig am 02.05.2023	200	213	0,02	1,078 % fällig am 25.02.2036 ^	343	335	0,03	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>			
Systems Energy Resources, Inc. 2,140 % fällig am 09.12.2025	800	802	0,07	Citigroup Mortgage Loan Trust				<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>			
Tallgrass Energy Partners LP 4,750 % fällig am 01.10.2023	100	103	0,01	0,348 % fällig am 25.01.2037	1.394	776	0,07	Kaisa Group Holdings Ltd. 6,750 % fällig am 18.02.2021	\$ 200	201	0,01
Targa Resources Partners LP 5,500 % fällig am 01.03.2030	300	326	0,03	Ellington Loan Acquisition Trust				7,875 % fällig am 09.06.2021	200	201	0,02
TransCanada Trust 5,300 % fällig am 15.03.2077	150	159	0,01	1,248 % fällig am 25.05.2037	283	283	0,02	Summe kurzfristige Instrumente		402	0,03
Vistra Operations Co. LLC 3,550 % fällig am 15.07.2024	600	650	0,05	Long Beach Mortgage Loan Trust				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.261.305	106,87	
3,700 % fällig am 30.01.2027	100	110	0,01	1,123 % fällig am 25.07.2034	1.216	1.205	0,10				
Vodafone Group PLC 4,250 % fällig am 17.09.2050	1.400	1.737	0,15	New Century Home Equity Loan Trust				<b>AKTIEN</b>			
Washington Gas Light Co. 3,650 % fällig am 15.09.2049	600	723	0,06	0,618 % fällig am 25.02.2036	182	151	0,01	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
		144.657	12,26	<b>STAATSEMISSIONEN</b>				<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		1.053.248	89,25	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (c)	250.000	2.522	0,22
				3,125 % fällig am 16.04.2030	600	679	0,06	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (c)	382.285	4.469	0,38
<b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>				Export-Import Bank of India 1,271 % fällig am 28.03.2022 (e)	500	502	0,04	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)	632.115	6.298	0,53
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	43.970	46.211	3,92	3,250 % fällig am 15.01.2030	400	429	0,03	Summe Investmentfonds	\$ 13.289	1,13	
3,000 % fällig am 01.02.2051	12.500	13.109	1,11	Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	2.000	2.381	0,20				
3,500 % fällig am 01.02.2051	9.940	10.522	0,89	6,875 % fällig am 27.09.2023	600	697	0,06				
4,000 % fällig am 01.02.2051	3.300	3.530	0,30	Peru Government International Bond 5,350 % fällig am 12.08.2040	800	230	0,02				
		73.372	6,22	5,400 % fällig am 12.08.2034	400	122	0,01				
				5,940 % fällig am 12.02.2029	8.800	3.036	0,26				
				6,150 % fällig am 12.08.2032	2.100	713	0,06				
				6,350 % fällig am 12.08.2028	900	316	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 <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
FICC	0,000 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 2.887	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	\$ (2.945)	\$ 2.887	\$ 2.887	0,24
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (2.945)	\$ 2.887	\$ 2.887	0,24

<sup>(1)</sup> 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 March Futures	Short	03.2021	27	\$ 1	0,00

## VERKAUFSOPTIONEN

## OPTIONEN AUF BÖRSENGEHADELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	\$ 169,000	22.01.2021	16	\$ (12)	\$ (5)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	170,000	22.01.2021	3	(2)	(1)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	171,000	22.01.2021	16	(17)	(12)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	177,000	22.01.2021	3	(2)	(1)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	178,000	22.01.2021	16	(13)	(3)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond February 2021 Futures	179,000	22.01.2021	16	(11)	(2)	0,00
				\$ (57)	\$ (24)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ (23)	0,00

## 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<sup>(1)</sup>

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Group Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 200	\$ 1	0,00
Anadarko Petroleum Corp.	1,000	20.06.2022	\$ 500	13	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	1.100	1	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2024	4.500	13	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.12.2022	1.700	(7)	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 700	3	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	400	1	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	200	1	0,00
Canadian Natural Resources Ltd.	1,000	20.06.2022	\$ 100	0	0,00
DISH DBS Corp.	5,000	20.06.2023	200	(3)	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	1.600	(1)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2023	300	4	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2023	400	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	500	12	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	300	8	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	1.000	34	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2021	400	0	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2022	100	0	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2022	300	(1)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2023	200	0	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	1.400	(2)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 3.300	190	0,02
Sherwin-Williams Co.	1,000	20.12.2022	\$ 300	(1)	0,00
Simon Property Group LP	1,000	20.06.2022	100	0	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	€ 1.000	(1)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	100	0	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	200	(1)	0,00
				\$ 271	0,03

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 3.700	\$ (64)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(3)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Asia ex-Japan IG-32 5-Year Index	1,000 %	20.12.2024	\$ 2.700	\$ 12	0,00
iTraxx Europe Main 34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	€ 33.600	214	0,02
				\$ 226	0,02

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,859 %	03.01.2022	BRL 72.200	\$ (5)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	2,871	03.01.2022	72.200	(6)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,300	03.01.2022	20.400	26	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	3,360	03.01.2022	124.000	173	0,02
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 4.900	11	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	2.700	6	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	1.700	(10)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,588 %	16.12.2025	CNY	4.310	\$ (2)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,605	07.08.2025		4.950	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,605	16.12.2025		6.470	(2)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,611	04.08.2025		3.900	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,620	16.07.2025		11.900	(1)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,625	07.08.2025		4.950	(1)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,633	10.08.2025		4.400	(1)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,645	15.07.2025		15.700	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,650	21.08.2025		4.100	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,671	16.12.2025		12.940	2	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,790	17.03.2026		15.000	12	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,810	17.03.2026		900	1	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,828	17.03.2026		3.600	4	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,848	17.03.2026		2.600	3	0,00
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,873	17.03.2026		2.600	4	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	04.11.2050	\$	2.100	(66)	(0,01)
Zahlung <sup>(4)</sup>	3-Month USD-LIBOR	1,400	04.01.2051		1.900	29	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,848	17.12.2025	ZAR	52.700	20	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,025	04.12.2025		150.300	132	0,01
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	16.06.2031	€	1.500	1	0,00
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,250	16.06.2031	£	8.800	(59)	(0,01)
Erhalt <sup>(4)</sup>	6-Month GBP-LIBOR	0,500	16.06.2051		300	(7)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,000	19.09.2023	HUF	115.000	0	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023		352.100	1	0,00
Erhalt	6-Month JPY-LIBOR	0,300	20.03.2028	¥	231.200	(3)	0,00
						\$ 262	0,02
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>						<b>\$ 695</b>	<b>0,06</b>

- (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. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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 <sup>(1)</sup>	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC CDX.IG-35 Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	2.310	\$ 263	\$ 255	0,02
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	1.540	170	170	0,01
							\$ 433	\$ 425	0,03

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	20.01.2021	2.800	\$ (5)	\$ 0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,450	20.01.2021	4.800	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	20.01.2021	7.400	(12)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	1.100	(2)	(2)	0,00
BPS	Put - OTC CDX.HY-35 5-Year Index	Verkauf	98,250	20.01.2021	800	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	1.200	(3)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	2.200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,775	17.03.2021	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	2.200	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	500	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,475	20.01.2021	2.400	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	1.900	(3)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,825	20.01.2021	2.400	(4)	0	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050 %	20.01.2021	2.500	\$ (5)	\$ 0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	2.000	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	6.300	(5)	(4)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	2.200	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	3.300	(4)	(4)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	6.300	(6)	(7)	(0,01)
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	2.200	(3)	(2)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	2.200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	2.200	(3)	(4)	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	20.01.2021	5.400	(11)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.02.2021	2.200	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.03.2021	2.100	(3)	(3)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,375	21.04.2021	4.400	(2)	(2)	0,00
DUB	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	21.04.2021	4.400	(8)	(8)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,950	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,000	21.04.2021	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	2.500	(4)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	2.300	(1)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	2.300	(3)	(1)	0,00
FBF	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.02.2021	1.200	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	1,100	17.02.2021	1.100	(3)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	2.300	(4)	(2)	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	800	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	2.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	20.01.2021	1.200	(1)	0	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	500	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	20.01.2021	1.100	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 32 5-Year Index	Verkauf	2,500	17.03.2021	1.800	(1)	0	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.02.2021	2.400	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.02.2021	2.400	(3)	(1)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,400	17.03.2021	4.200	(3)	(3)	0,00
	Call - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Kauf	0,425	17.03.2021	2.400	(2)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.03.2021	4.200	(5)	(5)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	2.400	(3)	(2)	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	0,900	20.01.2021	2.400	(4)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,000	20.01.2021	2.400	(5)	0	0,00
MYC	Put - OTC iTraxx Europe 34 5-Year Index	Verkauf	1,050	20.01.2021	1.300	(2)	0	0,00
	Call - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Kauf	0,450	17.02.2021	2.200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,750	17.02.2021	2.200	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,800	17.03.2021	2.200	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC CDX.IG-35 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.03.2021	2.000	(2)	(1)	0,00
						\$ (175)	\$ (84)	(0,01)

## ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175 %	15.03.2023	6.930	\$ (257)	\$ (254)	(0,02)
CBK	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,012	14.01.2021	1.400	(11)	(2)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,015	14.01.2021	1.400	(11)	(6)	0,00
DUB	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,298	11.01.2021	1.800	(15)	(4)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,598	11.01.2021	1.800	(15)	(1)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,830	22.01.2021	2.600	(10)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,070	22.01.2021	2.600	(11)	(5)	0,00
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	4.620	(167)	(169)	(0,02)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,100	19.01.2021	1.700	(20)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,460	19.01.2021	1.700	(20)	(17)	0,00
MYC	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,210	04.01.2021	1.600	(10)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,510	04.01.2021	1.600	(10)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,165	11.01.2021	2.300	(17)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,280	11.01.2021	800	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,485	11.01.2021	2.300	(17)	(9)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,580	11.01.2021	800	(4)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,110	15.01.2021	1.600	(15)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,450	15.01.2021	1.600	(15)	(16)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,131	19.01.2021	1.700	(19)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,491	19.01.2021	1.700	(19)	(12)	0,00
NGF	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,270	07.01.2021	1.800	(15)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,570	07.01.2021	1.800	(15)	0	0,00
							\$ (697)	\$ (506)	(0,04)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
JPM	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	\$ 102,906	11.03.2021	1.000	\$ (3)	\$ (7)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2050	103,367	14.01.2021	1.000	(4)	0	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2051	103,594	14.01.2021	1.000	(4)	0	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.02.2051	103,773	11.02.2021	1.100	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	103,578	11.03.2021	800	(2)	(4)	0,00
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.03.2051	104,000	11.03.2021	1.000	(2)	(5)	0,00

# Aufstellung der Wertpapieranlagen US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Put - OTC Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.04.2050	\$ 104,125	14.04.2021	500	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	99,688	04.02.2021	1.000	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,188	04.02.2021	1.100	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	102,266	04.02.2021	1.100	(3)	(3)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,367	04.02.2021	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,406	04.02.2021	1.300	(4)	(5)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	98,703	04.02.2021	600	(2)	(3)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 1,500 % fällig am 01.02.2051	102,750	04.02.2021	1.000	(3)	(3)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2051	103,750	04.02.2021	1.000	(2)	(4)	0,00
					\$ (42)	\$ (44)	0,00

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 300	\$ (6)	\$ 11	\$ 5	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.600	(28)	47	19	0,00
BPS	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20.12.2024	300	4	4	8	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.550	(30)	59	29	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	500	(8)	17	9	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	600	(36)	26	(10)	0,00
BRC	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20.12.2024	400	5	6	11	0,00
	CNAC HK Finbridge Co. Ltd.	1,000	20.12.2024	200	(4)	1	(3)	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2024	250	(6)	10	4	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.100	3	17	20	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	3.700	(76)	105	29	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	400	(2)	8	6	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2023	500	(27)	6	(21)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.400	(52)	15	(37)	0,00
	State Grid Overseas Investment Ltd.	1,000	20.12.2024	200	3	3	6	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	(9)	6	(3)	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2021	1.500	(44)	57	13	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	500	(12)	14	2	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2023	100	(5)	1	(4)	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	6	6	0,00
FBF	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	2.000	(24)	54	30	0,00
GLM	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	2.300	(26)	65	39	0,01
GST	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(4)	8	4	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(2)	6	4	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.12.2021	100	(4)	3	(1)	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	6	6	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	400	(16)	5	(11)	0,00
	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV	1,000	20.06.2022	300	(17)	14	(3)	0,00
JPM	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	0	7	7	0,00
MYC	Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2021	€ 900	6	3	9	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	\$ 700	(5)	17	12	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	500	(7)	12	5	0,00
NGF	Baidu, Inc.	1,000	20.12.2024	700	0	13	13	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	100	0	2	2	0,00
					\$ (429)	\$ 634	\$ 205	0,02

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag <sup>(2)</sup>	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2023	\$ 100	\$ 12	\$ (2)	\$ 10	0,00
CBK	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	1.300	127	(65)	62	0,01
	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	100	10	0	10	0,00
GST	CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2021	100	8	(3)	5	0,00
	CDX.HY-29 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2022	100	14	(5)	9	0,00
	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	400	48	(6)	42	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	5.699	(211)	287	76	0,01
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	300	33	(2)	31	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	100	(3)	4	1	0,00
					\$ 38	\$ 208	\$ 246	0,02

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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	01.2021	€ 1.686	\$ 2.020	\$ 0	\$ (43)	\$ (43)	0,00
	01.2021	£ 140	185	0	(7)	(7)	0,00
	01.2021	\$ 687	€ 565	4	0	4	0,00
BPS	01.2021	7.855	¥ 816.793	57	0	57	0,01
	01.2021	541	PLN 2.092	21	0	21	0,00
	01.2021	PEN 1.179	\$ 329	3	0	3	0,00
BRC	01.2021	\$ 734	MXN 14.880	14	(2)	12	0,00
	01.2021	183	PLN 710	7	0	7	0,00
CBK	01.2021	BRL 10	\$ 2	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 2	BRL 10	0	0	0	0,00
DUB	01.2021	PEN 9.182	\$ 2.560	22	0	22	0,00
	01.2021	\$ 831	¥ 86.517	8	0	8	0,00
	01.2021	103	PLN 390	1	0	1	0,00
FBF	01.2021	141	RUB 10.884	6	0	6	0,00
	02.2021	PEN 17.554	\$ 4.877	32	(9)	23	0,00
	02.2021	\$ 630	MXN 14.465	92	0	92	0,01
GLM	02.2021	1.166	RUB 86.708	3	(1)	2	0,00
	03.2021	980	MXN 20.021	16	0	16	0,00
	01.2021	PEN 10.231	\$ 2.839	10	0	10	0,00
JPM	03.2021	8.253	2.301	20	0	20	0,00
	01.2021	BRL 8.381	1.613	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2021	\$ 1.654	BRL 8.381	0	(40)	(40)	0,00
	01.2021	BRL 14.154	\$ 2.785	59	0	59	0,01
	01.2021	COP 4.152.103	1.214	0	0	0	0,00
RYL	01.2021	¥ 903.310	8.728	0	(22)	(22)	0,00
	01.2021	\$ 2.724	BRL 14.154	1	0	1	0,00
	01.2021	426	COP 1.559.033	30	0	30	0,00
SCX	01.2021	177	RUB 13.550	6	0	6	0,00
	01.2021	1.194	ZAR 18.192	41	0	41	0,01
	02.2021	CAD 2.415	\$ 1.843	0	(53)	(53)	0,00
SSB	02.2021	\$ 2.783	BRL 14.154	0	(59)	(59)	(0,01)
	02.2021	8.730	¥ 903.310	22	0	22	0,00
	02.2021	684	RUB 51.953	15	0	15	0,00
JPM	03.2021	1.211	COP 4.152.103	1	0	1	0,00
	02.2021	206	RUB 15.285	0	(1)	(1)	0,00
	01.2021	BRL 5.783	\$ 1.113	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2021	€ 9	11	0	0	0	0,00
	01.2021	£ 5.926	7.914	0	(187)	(187)	(0,01)
	01.2021	\$ 1.144	BRL 5.783	0	(31)	(31)	0,00
BRC	01.2021	29	€ 24	0	0	0	0,00
	01.2021	3.648	£ 2.680	16	0	16	0,00
	01.2021	403	PLN 1.533	9	0	9	0,00
SCX	02.2021	512	RUB 38.313	4	0	4	0,00
	03.2021	2.245	INR 167.167	27	0	27	0,00
	01.2021	968	MXN 19.393	4	0	4	0,00
SCX	01.2021	€ 7.563	\$ 9.058	0	(195)	(195)	(0,02)
	01.2021	\$ 743	COP 2.593.070	15	0	15	0,00
	02.2021	€ 7.563	\$ 9.260	0	0	0	0,00
SSB	03.2021	\$ 865	IDR 12.459.379	25	0	25	0,00
	03.2021	415	MXN 9.017	34	0	34	0,00
				\$ 625	\$ (652)	\$ (27)	0,00

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2020 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	01.2021	€ 7.537	\$ 9.176	\$ 3	\$ (49)	\$ (46)	0,00
	01.2021	\$ 6.480	€ 5.408	138	0	138	0,01
BPS	01.2021	112.657	94.050	2.419	0	2.419	0,20
	02.2021	161.081	131.560	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01.2021	€ 334	\$ 407	0	(2)	(2)	0,00
	01.2021	\$ 105.332	€ 87.952	2.282	0	2.282	0,19
GLM	02.2021	5.432	4.437	0	0	0	0,00
	01.2021	€ 4.844	\$ 5.814	0	(114)	(114)	(0,01)
JPM	01.2021	€ 53	€ 43	0	0	0	0,00
	01.2021	€ 225	\$ 274	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2021	1.447	1.762	0	(8)	(8)	0,00
	01.2021	\$ 39	€ 32	0	0	0	0,00
SCX	01.2021	118.314	98.792	2.563	0	2.563	0,22
	02.2021	176.182	143.894	0	(1)	(1)	0,00
SSB	01.2021	€ 64	\$ 78	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 3.101	€ 2.556	26	0	26	0,00
				\$ 7.431	\$ (176)	\$ 7.255	0,61

# Aufstellung der Wertpapieranlagen US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2020 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
BOA	01.2021	£ 9.475	\$ 12.598	\$ 0	\$ (354)	\$ (354)	(0,03)
BRC	01.2021	5	7	0	0	0	0,00
CBK	01.2021	13.645	18.304	0	(349)	(349)	(0,03)
	01.2021	\$ 146.572	£ 109.649	3.318	0	3.318	0,28
MYI	01.2021	£ 714	\$ 954	0	(22)	(22)	0,00
	01.2021	\$ 11.436	£ 8.568	276	0	276	0,03
SCX	01.2021	£ 152	\$ 205	0	(4)	(4)	0,00
	01.2021	\$ 156.817	£ 117.315	3.551	0	3.551	0,30
SSB	01.2021	£ 12	\$ 16	0	0	0	0,00
	01.2021	\$ 162.343	£ 121.621	3.912	0	3.912	0,33
						\$ 10.328	0,88
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						<b>\$ 17.798</b>	<b>1,51</b>
<b>Summe Anlagen</b>						<b>\$ 1.295.951</b>	<b>109,81</b>
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						<b>\$ (115.803)</b>	<b>(9,81)</b>
<b>Nettovermögen</b>						<b>\$ 1.180.148</b>	<b>100,00</b>

## 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 mit Sachwertausschüttung.  
 (b) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar  
 (c) Mit dem Fonds verbunden.  
 (d) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
 (e) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	2,572 %	03.06.2031	26.05.2020	\$ 1.400	\$ 1.493	0,13
Export-Import Bank of India	1,271	28.03.2022	19.12.2019	498	502	0,04
Morgan Stanley	0,790	03.02.2023	30.01.2020	1.512	1.573	0,13
				<b>\$ 3.410</b>	<b>\$ 3.568</b>	<b>0,30</b>

(f) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 42.636 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2020 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 54 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 9.244 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 90 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(23)	18.494	(1)	18.470
<b>Summen</b>	<b>\$ 13.266</b>	<b>\$ 1.282.686</b>	<b>\$ (1)</b>	<b>\$ 1.295.951</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 833.412	\$ 1.100	\$ 834.512
Investmentfonds	22.513	0	0	22.513
Pensionsgeschäfte	0	51.949	0	51.949
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(30)	15.626	0	15.596
<b>Summen</b>	<b>\$ 22.483</b>	<b>\$ 900.987</b>	<b>\$ 1.100</b>	<b>\$ 924.570</b>

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

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

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

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BOS	0,050 %	29.12.2020	05.01.2021	\$ (4.275)	\$ (4.275)	(0,36)
BPG	0,180	17.11.2020	14.01.2021	(2.743)	(2.744)	(0,23)
NOM	0,170	15.12.2020	15.01.2021	(1.972)	(1.972)	(0,17)
TDM	0,160	03.12.2020	07.01.2021	(7.580)	(7.581)	(0,64)
	0,160	04.12.2020	07.01.2021	(7.149)	(7.150)	(0,61)
	0,160	14.12.2020	25.01.2021	(9.244)	(9.244)	(0,78)
	0,170	07.12.2020	07.01.2021	(2.913)	(2.914)	(0,25)
	0,170	08.12.2020	19.01.2021	(6.715)	(6.716)	(0,57)
<b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>					<b>\$ (42.596)</b>	<b>(3,61)</b>

(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 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (212)	\$ 0	\$ (212)
BPS	2.452	(2.990)	(538)
BRC	2.279	(2.810)	(531)
CBK	3.211	(2.630)	581
DUB	27	(50)	(23)
FBF	(14)	0	(14)
GLM	(44)	0	(44)
GST	116	0	116
JPM	(9)	0	(9)
MYC	(19)	90	71
MYI	83	(30)	53
NGF	14	0	14
RYL	4	0	4
SAL	(16)	0	(16)
SCX	5.954	(5.680)	274
SSB	3.972	(3.310)	662

(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. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	74,35	68,55
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	31,39	36,23
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,13	k. A.
Investmentfonds	1,13	2,83
Pensionsgeschäfte	0,24	6,52
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,06	0,37
Freiverkehrsfinanzderivate	1,51	1,59
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(3,61)	(6,45)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,18	0,97
Unternehmensanleihen und Wechsel	89,25	78,55
US-Regierungsbehörden	6,22	11,04
US-Schatzobligationen	7,95	12,27
Non-Agency-MBS	0,03	0,05
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,23	0,39
Staatsemissionen	1,98	1,47
Optionsscheine	0,00	k. A.
Kurzfristige Instrumente	0,03	0,04
Investmentfonds	1,13	2,83
Pensionsgeschäfte	0,24	6,52
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,00	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	0,00

## Aufstellung der Wertpapieranlagen US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,03	0,02
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzkauf	(0,01)	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,02	0,32
Zinsswaps	0,02	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,03	0,01
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	(0,01)	0,00
Zinsswapoptionen	(0,04)	(0,02)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,02	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,02	0,04
Devisenterminkontrakte	0,00	(0,01)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,49	1,56
Sonstige Aktiva und Passiva	(9,81)	(16,09)
Nettovermögen	100,00	100,00









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
2,500 % fällig am 25.06.2034 - 25.10.2048	\$ 2.691	\$ 2.763	0,08	<b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>				Southern California Edison Co.	\$ 16.100	\$ 16.109	0,44
2,663 % fällig am 15.01.2038 (a)	1.186	72	0,00	<b>COMMERCIAL PAPER</b>							
3,000 % fällig am 25.09.2045	6.170	6.278	0,17	CIMIC Group Ltd.	\$ 10.000	\$ 9.871	0,27			50.375	1,38
4,000 % fällig am 01.08.2048	4.580	4.889	0,13	1,000 % fällig am 22.04.2021 (e)	2.500	2.495	0,07			114.478	3,14
Ginnie Mae				3,868 % fällig am 21.01.2021 (e)	15.000	15.000	0,41	Summe kurzfristige Instrumente			
0,600 % fällig am 20.02.2067	1.279	1.281	0,04	4,099 % fällig am 04.01.2021	14.000	14.000	0,38	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 3.068.243	83,97
0,652 % fällig am 20.10.2037	223	224	0,01	5,079 % fällig am 04.01.2021							
0,890 % fällig am 20.12.2065 - 20.08.2067	4.315	4.371	0,12	Royal Bank of Canada	4.000	3.139	0,09				
0,940 % fällig am 20.01.2066 - 20.05.2066	1.242	1.259	0,04	0,239 % fällig am 26.02.2021	CAD			<b>AKTIEN</b>			
0,990 % fällig am 20.11.2066	1.215	1.236	0,03	2,132 % fällig am 03.02.2021	\$ 1.600	1.599	0,05	<b>INVESTMENTFONDS</b>			
1,140 % fällig am 20.03.2066	790	807	0,02	2,373 % fällig am 19.01.2021	18.000	17.999	0,49	<b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>			
1,904 % fällig am 20.04.2067	5.754	5.869	0,16					PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
2,213 % fällig am 20.12.2068	1.671	1.667	0,05	<b>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL</b>				US Dollar Short-Term Floating	3.736.549	37.224	1,02
2,250 % fällig am 20.08.2024	2	2	0,00	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				NAV Fund (d)			
2,500 % fällig am 20.01.2049 - 20.10.2049	8.266	8.418	0,23	0,234 % fällig am 15.01.2021 (c)	CLP 15.400.000	21.674	0,60	<b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>			
3,000 % fällig am 20.03.2027 - 20.03.2030	45	47	0,00	Broadcom, Inc.	\$ 6.650	6.688	0,18	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar	3.354.112	341.068	9,33
3,125 % fällig am 20.11.2029	3	3	0,00	3,125 % fällig am 15.04.2021				Short Maturity UCITS ETF (d)			
3,445 % fällig am 20.09.2066	2.163	2.324	0,06	Pacific Gas & Electric Co.	5.900	5.904	0,16	Summe Investmentfonds		\$ 378.292	10,35
Uniform Mortgage-Backed Security				1,600 % fällig am 15.11.2021							
2,693 % fällig am 01.10.2037	167	176	0,01								
4,000 % fällig am 01.09.2049	10.971	11.704	0,32								
		857.774	23,48								
<b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>											
U.S. Treasury Notes											
0,125 % fällig am 30.11.2022	114.400	114.422	3,13								
Summe USA		1.832.620	50,15								

**PENSIONSGESCHÄFTE**

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup>	% des Nettovermögens
BPS	0,090 %	31.12.2020	04.01.2021	\$ 208.500	U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.11.2049	\$ (213.519)	\$ 208.500	\$ 208.502	5,71
FICC	0,000	31.12.2020	04.01.2021	4.734	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.12.2021	(4.829)	4.734	4.734	0,13
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (218.348)	\$ 213.234	\$ 213.236	5,84

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**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	3.333	\$ (32)	0,00
3-Month Canada Bankers' Acceptance March Futures	Long	03.2023	2.894	(294)	(0,01)
3-Month Canada Bankers' Acceptance September Futures	Long	09.2022	135	9	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2021	3.208	(674)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2021	1.347	(367)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2021	133	(3)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	129	29	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2021	3	(2)	0,00
				\$ (1.334)	(0,04)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (1.334)	(0,04)

**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<sup>(1)</sup>**

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag <sup>(2)</sup>	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-34 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2025	\$ 27.048	\$ (1.069)	(0,03)
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000)	20.12.2025	93.100	(3.381)	(0,09)
				\$ (4.450)	(0,12)

# Aufstellung der Wertpapieranlagen US Short-Term Fund (Forts.)

## ZINSSWAPS - BASISWAPS

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month USD-LIBOR <sup>(3)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,098 %	13.01.2023	\$ 52.000	\$ (25)	0,00
3-Month USD-LIBOR <sup>(3)</sup>	1-Month USD-LIBOR + 0,098 %	13.01.2023	39.800	(19)	0,00
				\$ (44)	0,00

## ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,650 %	20.08.2030	\$ 123.500	\$ 2.089	0,05
<b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b>					<b>\$ (2.405)</b>	<b>(0,07)</b>

<sup>(1)</sup> 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.

<sup>(2)</sup> 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.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## 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 <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC CDX.IG-33 5-Year Index	Verkauf	2,500 %	20.01.2021	8.700	\$ (6)	\$ 0	0,00
		Verkauf	2,500	17.03.2021	5.500	(4)	(1)	0,00
						\$ (10)	\$ (1)	0,00

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag <sup>(1)</sup>	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens		
FAR	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2051	\$ 101,563	07.01.2021	12.100	\$ (41)	\$ 0	0,00		
		101,672	07.01.2021	19.100	(64)	0	0,00		
		102,141	04.03.2021	2.400	(7)	(2)	0,00		
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.03.2051	102,906	11.03.2021	5.800	(20)	(40)	0,00		
		102,906	11.03.2021	5.800	(20)	(40)	0,00		
		103,367	14.01.2021	9.100	(40)	(1)	0,00		
		103,594	14.01.2021	7.600	(29)	(1)	0,00		
		103,773	11.02.2021	8.700	(14)	(8)	0,00		
		104,000	11.03.2021	5.900	(11)	(28)	0,00		
		104,125	14.04.2021	4.700	(12)	(12)	0,00		
		102,188	04.02.2021	13.100	(33)	(29)	0,00		
		102,266	04.02.2021	13.700	(33)	(31)	0,00		
		102,125	04.03.2021	4.000	(13)	(4)	0,00		
		102,141	04.03.2021	6.300	(18)	(7)	0,00		
		104,141	04.03.2021	6.300	(8)	(8)	0,00		
							\$ (343)	\$ (171)	0,00

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

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2021	AUD 13.012	\$ 9.608	\$ 0	\$ (433)	\$ (433)	(0,01)
		\$ 38.066	¥ 3.958.873	280	0	280	0,01
BPS	01.2021	£ 1.124	£ 826	5	0	5	0,00
BRC	01.2021	£ 353	\$ 471	0	(11)	(11)	0,00
		¥ 2.024.800	¥ 19.598	0	(14)	(14)	0,00
BSS	01.2021	CLP 15.399.200	18.831	0	(2.840)	(2.840)	(0,08)
CBK	01.2021	\$ 3.705	¥ 385.954	33	0	33	0,00
		¥ 5.901.000	\$ 57.014	0	(144)	(144)	0,00
GLM	02.2021	\$ 57.030	¥ 5.901.000	145	0	145	0,00
		€ 2.498	\$ 3.041	0	(16)	(16)	0,00
HUS	01.2021	£ 147.862	£ 197.758	0	(4.369)	(4.369)	(0,13)
		\$ 6.842	¥ 713.012	64	0	64	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
	02.2021	CAD	4.000	\$ 3.078	\$ 0	\$ (63)	0,00	
JPM	01.2021	AUD	9.836	7.237	0	(353)	(0,01)	
MYI	01.2021	€	203	249	1	0	0,00	
	01.2021	\$	13.161	AUD 17.831	598	0	0,02	
	01.2021		173	€ 141	0	0	0,00	
RBC	01.2021		2.406	£ 1.816	77	0	0,00	
SCX	01.2021	AUD	5.743	\$ 4.231	0	(201)	(0,01)	
	01.2021	€	47.521	56.911	0	(1.233)	(0,03)	
	01.2021	\$	18.640	AUD 25.114	741	0	0,02	
	02.2021	€	47.521	\$ 58.183	0	(1)	0,00	
TOR	01.2021	CAD	14.976	11.560	0	(195)	(0,01)	
	01.2021	¥	192.200	1.861	0	(1)	0,00	
	01.2021	\$	11.755	CAD 14.976	0	0	0,00	
	01.2021		29.334	¥ 3.060.161	307	0	0,01	
	02.2021	CAD	14.976	\$ 11.757	0	0	0,00	
	03.2021	\$	684	MXN 14.024	14	0	0,00	
UAG	01.2021	AUD	19.328	\$ 14.211	0	(704)	(0,02)	
					\$ 2.265	\$ (10.578)	\$ (8.313)	(0,24)

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2020 standen für die Anteilsklassen Institutional 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	01.2021	€	5.596	\$ 6.785	\$ 3	\$ (64)	0,00	
	01.2021	\$	3.329	€ 2.755	43	(1)	0,00	
BRC	01.2021	€	159	\$ 195	0	0	0,00	
	01.2021	\$	93.785	€ 78.247	1.954	0	0,05	
GLM	01.2021	€	49	\$ 59	0	(1)	0,00	
	01.2021	\$	12.195	€ 10.156	233	(1)	0,01	
HUS	01.2021		206	169	1	0	0,00	
MYI	01.2021	€	14	\$ 17	0	0	0,00	
	01.2021	\$	235	€ 193	1	0	0,00	
SCX	01.2021		109.726	91.621	2.376	0	0,07	
	02.2021		170.507	139.259	0	(1)	0,00	
SSB	01.2021	€	689	\$ 845	1	0	0,00	
	01.2021	\$	4.539	€ 3.740	37	0	0,00	
TOR	01.2021		103.456	86.386	2.241	0	0,06	
	02.2021		138.350	112.995	0	(1)	0,00	
					\$ 6.890	\$ (69)	\$ 6.821	0,19
<b>Summe Freiverkehrsfinanzderivate</b>						\$ (1.664)	(0,05)	
<b>Summe Anlagen</b>						\$ 3.654.366	100,00	
<b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>						\$ (181)	0,00	
<b>Nettvermögen</b>						\$ 3.654.185	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) Mit dem Fonds verbunden.  
 (e) Eingeschränkte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Bank of America Corp.	2,604 %	15.03.2023	07.10.2020	\$ 770	\$ 805	0,02
Bank of America Corp.	3,228	22.06.2022	07.10.2020	859	899	0,02
CIMIC Group Ltd.	1,000	22.04.2021	30.11.2020	9.876	9.871	0,27
CIMIC Group Ltd.	3,868	21.01.2021	06.08.2020	2.495	2.495	0,07
Goldman Sachs Group, Inc.	1,140	23.08.2022	08.10.2020	3.789	3.940	0,11
Wells Fargo & Co.	2,094	25.04.2022	06.10.2020	1.455	1.521	0,04
Wells Fargo & Co.	2,509	27.10.2023	14.10.2020	2.214	2.298	0,06
				\$ 21.458	\$ 21.829	0,59

Barmittel in Höhe von USD 19.020 wurden zum 31. Dezember 2020 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 31. Dezember 2020 Barmittel in Höhe von USD 7.444 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen US Short-Term Fund (Forts.)

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

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

Kategorie <sup>(2)</sup>	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 <sup>(3)</sup>	(1.334)	(4.057)	(12)	(5.403)
<b>Summen</b>	<b>\$ 35.890</b>	<b>\$ 3.582.850</b>	<b>\$ 35.626</b>	<b>\$ 3.654.366</b>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2019 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie <sup>(2)</sup>	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	\$ 2.535.378	\$ 2.004	\$ 2.537.382
Investmentfonds	212.140	0	0	212.140
Pensionsgeschäfte	0	1.457	0	1.457
Einlagen bei Kreditinstituten	0	6.715	0	6.715
Finanzderivate <sup>(3)</sup>	(2.804)	(10.772)	0	(13.576)
<b>Summen</b>	<b>\$ 209.336</b>	<b>\$ 2.532.778</b>	<b>\$ 2.004</b>	<b>\$ 2.744.118</b>

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

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

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

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2020:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement <sup>(1)</sup>
BOA	\$ (172)	\$ 270	\$ 98
BPS	5	0	5
BRC	1.929	(2.400)	(471)
BSS	(2.840)	2.823	(17)
CBK	33	0	33
FAR	(2)	0	(2)
GLM	232	(270)	(38)
GST	(1)	50	49
HUS	(4.383)	3.560	(823)
JPM	(522)	330	(192)
MYI	600	(550)	50
RBC	77	0	77
SCX	1.681	(1.880)	(199)
SSB	38	0	38
TOR	2.365	(2.930)	(565)
UAG	(704)	411	(293)

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

### Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2020:

	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	37,73	69,22
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	44,39	38,26
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,85	k. A.
Investmentfonds	10,35	8,98
Pensionsgeschäfte	5,84	0,06
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,04)	(0,12)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,07)	(0,36)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,05)	(0,10)
Einlagenzertifikate	k. A.	0,28
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(18,05)

## Aufstellung der Wertpapieranlagen US Short-Term Fund (Forts.)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2020 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2020 (%)	31. Dez. 2019 (%)
Australien	0,36	0,54
Bermuda	0,08	0,33
Kanada	0,76	0,30
Cayman-Inseln	4,90	3,92
Chile	0,08	0,27
China	0,10	0,08
Dänemark	0,75	0,67
Finnland	0,17	k. A.
Frankreich	0,68	0,25
Deutschland	0,06	0,25
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,33
Hongkong	0,56	1,16
Indien	0,31	1,69
Irland	2,27	1,70
Israel	0,07	0,28
Japan	4,38	7,37
Jersey, Kanalinseln	0,08	k. A.
Luxemburg	0,03	0,70
Malaysia	k. A.	0,11
Mexiko	k. A.	1,38
Multinational	0,01	k. A.
Niederlande	0,78	2,28
Neuseeland	k. A.	0,11
Norwegen	k. A.	0,23
Katar	0,03	0,33
Saudi-Arabien	0,18	k. A.
Singapur	0,78	1,13
Südkorea	0,78	0,34
Schweden	k. A.	0,21
Schweiz	0,20	0,69
Thailand	k. A.	0,04
Vereinigte Arabische Emirate	0,50	0,77
Großbritannien	11,78	12,31
USA	50,15	66,24
Kurzfristige Instrumente	3,14	1,47
Investmentfonds	10,35	8,98
Pensionsgeschäfte	5,84	0,06
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,04)	(0,12)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzkauf	(0,12)	(0,08)
Zinsswaps — Basisswaps	0,00	k. A.
Zinsswaps	0,05	(0,28)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,02)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,24)	(0,24)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,19	0,16
Einlagenzertifikate	k. A.	0,28
Sonstige Aktiva und Passiva	0,00	(16,22)
<b>Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

## 1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die einzelnen in diesem Bericht beschriebenen Fonds (nachfolgend jeweils als ein „Fonds“ und gemeinsam als die „Fonds“ 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 Fonds 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 Fonds besteht, die jeweils eine oder mehrere Anteilsklassen umfassen. Nach dem Ermessen des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“ oder die „Verwaltungsratsmitglieder“) dürfen für einen Fonds mehrere Anteilsklassen („Klassen“) ausgegeben werden. Für jeden einzelnen Fonds wird ein gesondertes Vermögenswertportfolio geführt, welches in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die auf diesen Fonds zutreffen, angelegt wird. Der Verwaltungsrat darf mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Fonds auflegen. Der Verwaltungsrat darf gemäß den Anforderungen der Zentralbank zu gegebener Zeit Klassen Fonds auflegen. Die Gesellschaft wurde am 10. Dezember 1997 gegründet.

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 Fonds 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 Fonds vorbehaltlich aller gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen einer oder mehreren Unter-Anlageberatungsgesellschaften übertragen. Wenn eine Anlageberatungsgesellschaft für einen spezifischen Fonds ernannt wird, hat die Anlageberatungsgesellschaft jede der anderen Anlageberatungsgesellschaften, PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd., als Unter-Anlageberatungsgesellschaft in Bezug auf den oder die jeweiligen Fonds ernannt, mit Ausnahme der folgenden Fonds, für die PIMCO Europe GmbH nicht als Unter-Anlageberatungsgesellschaft ernannt wurde: 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. Die Gebühren der einzelnen entsprechend bestellten Unter-Anlageberatungsgesellschaften sind von PIMCO Global Advisors (Ireland) Ltd. (die „Verwaltungsgesellschaft“ der Gesellschaft) oder von den Anlageberatungsgesellschaften im Namen der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr zu begleichen.

Bis zur Auflösung des PIMCO RAE Emerging Markets Fund, des PIMCO RAE Europe Fund, des PIMCO RAE Global Developed Fund und des PIMCO RAE US Fund während des Geschäftsjahres war Parametric Portfolio Associates, LLC bestellt, um Unterstützung bei der Umsetzung der Anlagepolitik für diese Fonds zu leisten, und verfügte über beschränkte Anlageentscheidungsbefugnis. In dieser Hinsicht verfügte 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 bis zu deren Beendigung bestellt. Parametric Portfolio Associates, LLC erbringt für den Strategic Income Fund weiterhin diskretionäre Beratungsdienstleistungen in Bezug auf den Aktienbereich des Strategic Income Fund (vorbehaltlich bestimmter Parameter und Einschränkungen, die mit den Anlageberatungsgesellschaften und Research Affiliates, LLC vereinbart wurden). Research Affiliates, LLC agiert weiterhin als Unter-Anlageberatungsgesellschaft mit diskretionären Befugnissen im Hinblick auf den Aktienbereich des Strategic Income Fund.

Bis zur Auflösung des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund, des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund, des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund und des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund während des Geschäftsjahres war Parametric Portfolio Associates, LLC als Unter-Anlageberatungsgesellschaft mit diskretionären Befugnissen im Hinblick auf diese Fonds ernannt und verfügte über beschränkte Anlageentscheidungsbefugnis.

Der Sitz der Gesellschaft befindet sich in 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irland.

## 2. WICHTIGE BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Es folgt eine Zusammenfassung der wichtigen Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden und der Schätzungstechniken, die von der Gesellschaft angewandt und beim Aufstellen dieses Abschlusses verwendet werden:

### (a) Erstellungsgrundlage

Der Abschluss wird gemäß dem vom Financial Reporting Council herausgegebenen Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and Republic of Ireland“, dem Companies Act von 2014 und den OGAW-Richtlinien erstellt. Die Abschlüsse für alle Fonds werden nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt, mit Ausnahme des Global Advantage Real Return Fund, des PIMCO RAE Emerging Markets Fund, des PIMCO RAE Europe Fund, des PIMCO RAE Global Developed Fund, des PIMCO RAE US Fund, des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund, des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund, des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund und des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund, deren Anteile während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2020 vollständig zurückgenommen wurden. Daher werden die Abschlüsse für die vorstehend genannten Fonds nicht nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt.

Zum 31. Dezember 2020 hielt der PIMCO RAE Emerging Markets Fund, der am 23. November 2020 aufgelöst wurde, eine Restposition in übertragbaren Wertpapieren. Diese Position wurde durch den Fonds am 04. Januar 2021 vollständig verkauft. Die Position ist im Finanzstatus als „Übertragbare Wertpapiere“ ausgewiesen, jedoch. Weitere Einzelheiten hierzu finden sich in Erläuterung 16.

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.

Die Gesellschaft führt für jeden Fonds gesonderte Konten. Anteile werden von der Gesellschaft ausgegeben und dem Fonds zugewiesen, den der Anteilinhaber auswählt. Der Erlös aus der Ausgabe und der daraus entstehende Ertrag werden jeder Fondsklasse im Verhältnis zu der gesamten Bewertung jeder Klasse gutgeschrieben. Bei der Rücknahme haben Anteilinhaber nur Anspruch auf ihren Teil des am Fonds gehaltenen Nettovermögens, für den Anteile an sie ausgegeben wurden.

Die Gesellschaft verwendet den US-Dollar als Präsentationswährung. Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden in der jeweiligen Funktionswährung erstellt. Die Gesellschaftssummen der Fonds, die durch das irische Gesellschaftsrecht vorgeschrieben werden, lauten auf US-Dollar, da diese Währung das vorherrschende wirtschaftliche Umfeld der Gesellschaft darstellt. Falls nicht anders angegeben, sind alle Beträge in US-Dollar ausgewiesen. Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden in US-Dollar umgerechnet und zur Erstellung des Abschlusses der Gesellschaft zusammengefasst.

Der Finanzstatus der Gesellschaft wird mithilfe von Wechselkursen zum Ende des Geschäftsjahres umgerechnet und die Betriebsergebnisrechnung und der Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen der Gesellschaft werden zum durchschnittlichen Wechselkurs (als Annäherung an die tatsächlichen Kurse) des Geschäftsjahres umgerechnet, um diese in den Abschluss der Gesellschaft einzubeziehen.

Der Währungsgewinn oder -verlust aus der Umrechnung des Nettovermögens der Gesellschaft zu Beginn des Geschäftsjahres und die durchschnittliche Wechselkursdifferenz aus der Umrechnung der Betriebsergebnisrechnung und des Ausweises der Nettovermögensänderungen der Gesellschaft sind im Ausweis der Nettovermögensänderungen der Gesellschaft ausgewiesen. Diese Umrechnungsanpassung hat keinen Einfluss auf das den einzelnen Fonds zugeordnete Nettovermögen.

Alle Beträge wurden, sofern nicht anders angegeben, auf die nächsten Tausend gerundet.

### (b) Ermittlung des Nettoinventarwerts

Der Nettoinventarwert (der „NIW“) jedes Fonds und/oder jeder Anteilsklasse wird, wie im aktuell gültigen Verkaufsprospekt der Gesellschaft bzw. in der jeweiligen Ergänzung offengelegt, mit dem Schluss des regulären Handels an jedem Handelstag berechnet.

Die Gesellschaft hat beschlossen, die auf den Ansatz und die Bewertung bezogenen Bestimmungen von International Accounting Standard („IAS“) 39 Finanzinstrumente: Ansatz und Bewertung sowie die Angabe- und Darstellungspflichten gemäß FRS 102 für die Bilanzierung ihrer Finanzinstrumente anzuwenden. Gemäß IAS 39 wurden Wertpapiere der Fonds sowie andere Vermögenswerte zum zuletzt gehandelten Kurs am 31. Dezember 2020 bewertet, um das Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber (das „Nettovermögen“) zu bestimmen.

#### (c) Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge

Wertpapiertransaktionen werden zum Handelstag zum Zwecke der Finanzberichterstattung ausgewiesen. Wertpapiere, die auf der Basis des Emissionstermins oder der verzögerten Lieferung gekauft oder verkauft werden, können im Anschluss an einen standardmäßigen Abrechnungszeitraum für das Wertpapier nach dem Handelstag abgerechnet werden. Realisierte Gewinne und Verluste aus Wertpapierverkäufen werden auf der Basis der festgestellten Kosten erfasst. Dividendeneinkünfte werden zum Ex-Dividende-Datum erfasst; ausgenommen hiervon sind bestimmte Dividenden von ausländischen Wertpapieren, bei denen das Ex-Dividende-Datum möglicherweise bereits verstrichen ist. Diese werden erfasst, sobald der Fonds Informationen über das Ex-Dividende-Datum erhält. Um Disagios und Prämienabschreibungen bereinigte Zinseinkünfte werden auf Rechnungsabgrenzungsbasis erfasst und mithilfe von Effektivzinsmethoden berechnet. Davon ausgenommen sind Wertpapiere mit einem in der Zukunft liegenden Effektivdatum: Hier werden die Zinseinkünfte ab dem Effektivdatum auf Rechnungsabgrenzungsbasis erfasst. Für wandelbare Wertpapiere werden Aufschläge, die dem Wandlungsrecht zuzuordnen sind, nicht abgeschrieben. Gegebenenfalls anfallende Rückzahlungsgewinne (-verluste) auf hypothetisch ähnliche und sonstige forderungsbesicherte Wertpapiere werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteile des Zinsertrags ausgewiesen.

Wenn die Eintreibung der Zinsen bzw. eines Teils der Zinsen auf der Basis konsequent angewandter Verfahren zweifelhaft geworden ist, können Schuldtitel so behandelt werden, als würden keine weiteren Zinsen darauf auflaufen. Zudem kann der hiermit verbundene Zinsertrag reduziert werden, indem die Schuldtitel zinslos gestellt und entsprechende Zinsforderungen abgeschrieben werden. Die Zinslosstellung eines Schuldtitels wird aufgehoben, wenn der Emittent seine Zinszahlungen wieder aufnimmt oder die Eintreibbarkeit der Zinsen als wahrscheinlich erachtet wird.

Erträge werden vor Abzug nicht erstattungsfähiger Quellensteuern sowie nach Abzug von Steuergutschriften ausgewiesen. Quellensteuern werden in der Betriebsergebnisrechnung separat ausgewiesen. Die Fonds können Steuern unterliegen, die von bestimmten Ländern auf Kapitalgewinne aus dem Verkauf von Anlagen erhoben werden. Kapitalertragsteuern werden nach dem Prinzip der Periodenabgrenzung verbucht und in der Betriebsergebnisrechnung separat ausgewiesen.

#### (d) Mehrfach-Klassen-Zuordnungen und abgesicherte Anteilsklassen

Wenn nicht anders angegeben, verfügen sämtliche von der Gesellschaft angebotene Klassen in Bezug auf Vermögenswerte und Stimmprivilegien über gleiche Rechte (außer bei Anteilinhabern einer Klasse, die über ausschließliche Stimmrechte in Bezug auf Angelegenheiten verfügen, die ausschließlich diese Klasse betreffen). Innerhalb jeder Klasse eines jeden Fonds darf die Gesellschaft entweder teilweise oder nur ausschüttende Anteile (Einkommen ausschüttende Anteile), thesaurierende Anteile (Einkommen thesaurierende Anteile) und Income II-Anteile (Anteile, die eine erhöhte Rendite ausschütten sollen) ausgeben. Aufgrund der Mehrfach-Klassen-Struktur kann der Anteilinhaber das Anteilserwerbsverfahren wählen, das ihm unter Berücksichtigung der zu erwerbenden Menge, des Zeitraums, für den der Anteilinhaber die Anteile halten möchte, sowie der sonstigen Umstände am vorteilhaftesten scheint. Sind Anteile abweichender Klassen oder Emissionen im Umlauf, kann der NIW je Anteil zwischen den Klassen abweichen, um die Tatsache wiederzugeben, dass das Einkommen thesauriert oder ausgeschüttet wurde, oder für sie können unterschiedliche Gebühren und Aufwendungen anfallen. Realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge und -verluste der einzelnen Fonds werden jeder Anteilsklasse täglich auf der Basis des relativen Nettovermögens der einzelnen Klassen des betreffenden Fonds zugewiesen.

Bei den abgesicherten Klassen (die „abgesicherten Klassen“) möchte die Gesellschaft gemäß den Bestimmungen und Auslegungen, die die Zentralbank jeweils bekannt gibt, diese gegen Schwankungen der Währungen, auf die die abgesicherten Klassen lauten, gegenüber anderen Währungen absichern. Die abgesicherten Klassen sind im Ergebnis dieser Transaktionen keinem Hebel ausgesetzt. Obwohl sich die Gesellschaft bemüht, das Währungsrisiko abzusichern, besteht keine Garantie, dass sie damit Erfolg haben wird. Absicherungstransaktionen sind eindeutig einer bestimmten Klasse zuzuordnen. Alle Kosten und Gewinne/(Verluste) dieser Absicherungsstrategien können den Nutzen für Anteilinhaber der betreffenden abgesicherten Anteilsklasse beträchtlich einschränken, wenn die Klassenwährung gegenüber der Funktionswährung und/oder der Währung fällt, auf die einige oder alle Vermögenswerte des betreffenden Fonds lauten und die gegenüber anderen Währungen abgesichert sind.

#### (e) Devisentransaktionen

Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden unter Zuhilfenahme der primären Wirtschaftsumgebung, in der sie ihre Geschäftstätigkeit ausüben, vorgelegt (die „Funktionswährung“). Die Funktions- und Präsentationswährungen der Fonds der Gesellschaft sind identisch.

Die Gesellschaftssummen der Fonds, die durch das irische Gesellschaftsrecht vorgeschrieben werden, lauten auf US-Dollar, da diese Währung das vorherrschende wirtschaftliche Umfeld der Gesellschaft darstellt.

Die Marktwerte der ausländischen Wertpapiere, Währungspositionen und sonstigen Aktiva und Passiva werden auf Basis der am jeweiligen Tag geltenden Umtauschkurse in die Funktionswährung des jeweiligen Fonds umgerechnet. Schwankungen im Wert der Währungsbeteiligungen und sonstigen Aktiva und Passiva aus Veränderungen der Wechselkurse werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Fremdwährungen erfasst.

Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus der Umrechnung von Wertpapieren, die auf Fremdwährungen lauten, sind in der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten erfasst, und die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus der Umrechnung von Finanzderivaten, die auf Fremdwährungen lauten, sind in der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten in der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

Währungsgewinne und -verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren, die auf Fremdwährungen lauten, sind im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten erfasst, und die Währungsgewinne und -verluste aus dem Verkauf von Derivaten, die auf Fremdwährungen lauten, sind im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten in der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

Realisierte Gewinne und Verluste zwischen den Transaktions- und Abwicklungsdaten aus dem Erwerb und Verkauf von auf Fremdwährung lautenden Wertpapieren und Finanzderivaten sind im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen in der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

Bestimmte Fonds verfügen über eine abgesicherte Klasse (abgesicherte Klassen), die Devisenterminkontrakte einget, die dazu bestimmt sind, den Absicherungseffekt auf Fondsebene glattzustellen, damit sich die Funktionswährung weiter an anderen Währungen als der Funktionswährung beteiligen kann.

#### (f) Transaktionskosten

Transaktionskosten sind Kosten, die entstehen, um ergebniswirksam zum Marktwert bewertete Finanzvermögen und -verbindlichkeiten zu erwerben. Zu ihnen zählen an Mittler, Berater, Makler und Händler gezahlte Gebühren und Provisionen. Transaktionskosten werden in der Betriebsergebnisrechnung unter dem realisierten Nettogewinn/(-verlust) und der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten und dem realisierten Nettogewinn/(-verlust) und der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten erfasst. Bei Rentenwerten und bestimmten Derivaten können Transaktionskosten nicht aus dem Kaufpreis des Wertpapiers herausgezogen werden, weshalb sie nicht separat ausgewiesen werden können.

#### (g) Einkommensausgleich

Bei dem von der Gesellschaft angewandten Rechnungslegungsstandard handelt es sich um den sog. Einkommensausgleich. Die Einkommensausgleichsanpassung stellt sicher, dass an die in die Anteilsklassen ausschüttend und ausschüttend II anliegenden Anteilinhaber ausgeschüttetes Einkommen prozentual dem Besitzzeitraum im Ausschüttungszeitraum entspricht. Eine Summe, die dem Teil des Kurses pro Anteil entspricht, der den etwaigen, bis zum Datum der Ausgabe der Anteile aufgelaufenen, jedoch nicht ausgeschütteten Ertrag wiedergibt, wird als Ausgleichszahlung angesehen und als an den jeweiligen Anteilinhaber zurückbezahlt behandelt, entweder bei (i) Rücknahme dieser Anteile vor der Zahlung der ersten Dividende auf dieselben oder (ii) Zahlung der ersten Dividende, zu der der Anteilinhaber im selben Berichtszeitraum, in dem die Anteile ausgegeben wurden, berechtigt war. Die Zahlung von Dividenden nach der Zahlung der ersten Dividende darauf oder die Rücknahme dieser Anteile nach Zahlung der ersten Dividende wird so ausgelegt, dass darin ein etwaiger, bis zum Datum der jeweiligen Rücknahme oder Erklärung der Dividende aufgelaufener, jedoch unbezahlter Nettoertrag enthalten ist.

#### (h) Kritische Schätzungen und Annahmen in der Rechnungslegung

Die Erstellung des Abschlusses gemäß FRS 102 verlangt vom Verwaltungsrat Beurteilungen, Schätzungen und Annahmen, die sich auf die Anwendung von Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden sowie auf die ausgewiesene Höhe von Vermögenswerten, Verbindlichkeiten, Erträgen und Aufwendungen auswirken. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen. Schätzungen und zugrunde liegende Annahmen werden laufend überprüft. Änderungen an bilanziellen Schätzungen werden in dem Berichtszeitraum ausgewiesen, in dem die Schätzungen korrigiert werden, sowie in allen davon betroffenen zukünftigen Zeiträumen.

### 3. ANLAGEN ZUM MARKTWERT UND MARKTBEWERTUNGSHIERARCHIE

Zu dieser Kategorie gehören zwei Unterkategorien: gemäß Bestimmung der Verwaltung bei Auflegung als ergebniswirksam zum Marktwert zu bewertende Finanzvermögen und -verbindlichkeiten und zu Handelszwecken gehaltene Finanzvermögen und -verbindlichkeiten. Bei Auflegung ergebniswirksam zum Marktwert ausgewiesene Finanzvermögen und -verbindlichkeiten sind Finanzinstrumente, die nicht als zu Handelszwecken gehalten eingestuft werden, sondern sie werden verwaltet und ihre Wertentwicklung wird auf Basis des Marktwerts in Übereinstimmung mit der dokumentierten Anlagestrategie des Fonds bewertet. Finanzanlagen und -verbindlichkeiten zu Handelszwecken werden hauptsächlich erworben oder eingegangen, um diese kurzfristig zu verkaufen oder zurückzukaufen. Derivate fallen in die Kategorie der zu Handelszwecken gehaltenen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten.

**(a) Grundsätze für die Bewertung von Anlagen** Die Fondspolitik erfordert, dass Anlageberatungsgesellschaften („PIMCO“) und der Verwaltungsrat die Informationen über diese Finanzvermögen und -verbindlichkeiten auf Basis des Marktwerts gemeinsam mit anderen verbundenen Finanzinformationen bewerten.

Gewinne und Verluste aus Änderungen im Marktwert der Kategorie „ergebniswirksam zum Marktwert bewertete Finanzvermögen“ werden in die Betriebsergebnisrechnung in das Geschäftsjahr einbezogen, in dem sie anfallen.

Die Wertpapiere des Fonds und anderen Vermögenswerte, für die Marktkurse jederzeit zur Verfügung stehen, werden zum Marktwert bewertet. Der Marktwert wird allgemein auf Grundlage der zuletzt berichteten Verkaufspreise bestimmt, oder wenn keine Verkäufe gemeldet wurden, auf Grundlage der Kurse, die von einem Kursberichtssystem, angestammten Marktmachern oder Kursbestimmungsdiensten stammen.

Anlagen, die zunächst in anderen Währungen als der Funktionswährung des Fonds bewertet wurden, werden mithilfe der Wechselkurse von Kursbestimmungsdiensten umgerechnet. Im Ergebnis kann der NIW der Fondsanteile von Änderungen des Werts der Währungen gegenüber der Fondsfunktionswährung beeinflusst werden. Der Wert von an ausländischen Märkten gehandelten oder auf andere als die Fondsfunktionswährung lautenden Wertpapieren kann an dem Tag deutlich beeinflusst werden, an dem die jeweilige Börse geschlossen ist, und der NIW kann sich an den Tagen ändern, an denen Anleger keine Anteile erwerben, zurückgeben oder tauschen können.

Hat sich der Wert eines Wertpapiers, das ausschließlich an einer ausländischen Börse gehandelt wird, nach dem Schluss der Primärbörse oder des Primärmarkts des Wertpapiers, jedoch vor dem Schluss des Handelstags wesentlich geändert, wird das Wertpapier zum Marktwert auf Grundlage von Verfahren bewertet, die der Verwaltungsrat eingeführt und zugelassen hat. Wertpapiere, die nicht gehandelt werden, wenn ein Fonds geöffnet ist, werden ebenfalls zum Marktwert bewertet. Ein Fonds kann den Marktwert von Anlagen auf Grundlage von Informationen bestimmen, die Kursbestimmungsdienste und andere Drittanbieter liefern, die Kurse zum Marktwert oder Anpassungen durch Bezug auf andere Wertpapiere, Indizes oder Vermögenswerte empfehlen können. Wenn ein Fonds erwägt, ob Marktbewertung erforderlich ist und bei der Bestimmung der Marktwerte, kann er, unter anderem, wesentliche Ereignisse berücksichtigen (bei denen anzunehmen ist, dass sie Änderungen im Wert von Wertpapieren oder Wertpapierindizes enthalten), die nach dem Schluss des betreffenden Markts und vor dem Schluss des Handelstages eintreten. Ein Fonds darf Berechnungswerkzeuge nutzen, die Drittanbieter liefern, um den Marktwert von Wertpapieren zu bestimmen, die von wesentlichen Ereignissen beeinträchtigt wurden. Ausländische Börsen erlauben eventuell den Handel mit ausländischen Wertpapieren an Tagen, an denen die Gesellschaft nicht für das Geschäft geöffnet ist, was dazu führen kann, dass das Anlageportfolio eines Fonds betroffen ist, wenn der Fonds nicht in der Lage ist, Anteile zu kaufen oder zu verkaufen. Die Fonds haben einen Kursbestimmungsdienst damit beauftragt, den Marktwert ausländischer Wertpapiere zu bestimmen. Dieser Dienst setzt statistische Daten und Programme ein, die auf der vergangenen Wertentwicklung von Märkten und anderen Wirtschaftsdaten beruhen, um ihn bei der Schätzung des Marktwerts zu unterstützen. Schätzungen von Marktwerten, die ein Fonds für ausländische Wertpapiere nutzt, können vom Wert abweichen, der tatsächlich beim Verkauf dieser Wertpapiere erzielt wird, und die Differenz kann sich wesentlich auf den Abschluss auswirken. Bestimmungen des Marktwerts können subjektive Festsetzungen des Werts eines Wertpapiers oder eines Vermögenswerts erfordern, und der Marktwert, um den NIW eines Fonds zu bestimmen, kann von den notierten oder veröffentlichten Kursen oder den Kursen abweichen, die andere für die gleichen Anlagen verwenden. Darüber hinaus führt der Einsatz von Bestimmungen des Verkehrswerts eventuell nicht immer zu Kursanpassungen der Wertpapiere oder anderen Vermögenswerte, die ein Fonds hält.

**(b) 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.

**(c) Bewertungstechniken und die Marktbewertungshierarchie** Die Bewertungstechniken und wesentlichen Inputfaktoren, die verwendet werden, um den Marktwert von Finanzinstrumenten zu bestimmen, die in Stufe 1 und Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet werden, gestalten sich folgendermaßen:

Festverzinsliche Wertpapiere, einschließlich Unternehmens-, Wandel- und Kommunalanleihen sowie Wechsel, Anleihen von US-Regierungsbehörden, US-Schatzobligationen, Staatsemissionen, Bankdarlehen, Wandelvorzugswertpapiere sowie Nicht-US-Anleihen werden gewöhnlich von Kursbestimmungsdiensten bewertet, die Wertpapierhändlerangebote, Abschlussmeldungen oder Bewertungsschätzungen ihrer internen Kursbestimmungsmodelle verwenden. Die internen Modelle der Dienstleister nutzen beobachtbare Inputfaktoren, wie Emittenteninformationen, Zinssätze, Renditekurven, Tilgungsgeschwindigkeit, Kreditrisiken/-spreads, Ausfallraten und quotierte Preise für ähnliche Vermögenswerte. Wertpapiere, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Rentenwerte, die auf Basis verzögerter Lieferung erworben werden, werden täglich bis zur Abrechnung am Terminabrechnungsdatum bewertet. Diese Wertpapiere werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Durch Hypotheken und Forderungen besicherte Wertpapiere werden bei jedem Handel gewöhnlich als einzelne Tranchen oder Klassen von Wertpapieren herausgegeben. Diese Wertpapiere werden ebenfalls gewöhnlich von Kursbestimmungsdiensten bewertet, die Wertpapierhändlerangebote oder Bewertungsschätzungen ihrer internen Kursbestimmungsmodelle nutzen. Die Kursbestimmungsmodelle für diese Wertpapiere berücksichtigen gewöhnlich Eigenschaften der Tranchenstufe, aktuelle Marktdaten, geschätzte Kapitalflüsse und marktbasierende Renditespreads für jede Tranche und Börsenebengeschäfte (je nach Verfügbarkeit). Durch Hypotheken und Forderungen besicherte Wertpapiere, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Stammaktien, ETFs, börsengehandelte Schuldverschreibungen und derivative Finanzinstrumente, wie Terminkontrakte, Rechte, Optionsscheine oder Optionen auf Futures, die an einer nationalen Wertpapierbörse gehandelt werden, werden zum letztberichteten Verkaufs- oder Abrechnungskurs am Bewertungstag angegeben. Wenn diese Wertpapiere aktiv gehandelt werden und keine Bewertungsanpassungen vorgenommen werden, werden sie in Stufe 1 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Bewertungsanpassungen können für bestimmte Wertpapiere durchgeführt werden, die ausschließlich an einer ausländischen Börse gehandelt werden, um die Marktbewegungen zwischen dem Schluss des ausländischen Markts und dem Schluss der NYSE zu berücksichtigen. Diese Wertpapiere werden mithilfe von Kursbestimmungsdiensten bewertet, die den Zusammenhang von Handelsmustern des ausländischen Wertpapiers mit dem Intraday-Handel am US-Anlagemarkt berücksichtigen. Wertpapiere, die diese Bewertungsanpassungen nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Vorzugswertpapiere und andere Aktien, die an inaktiven Märkten gehandelt oder durch Bezug auf ähnliche Instrumente bewertet werden, werden ebenfalls in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Anlagen in eingetragenen offenen Investmentgesellschaften (die keine ETF sind) werden auf Grundlage des NIW dieser Anlagen bewertet, und sie werden in Stufe 1 der Bewertungshierarchie eingeordnet. Anlagen in nicht eingetragenen offenen Anlagegesellschaften werden auf Grundlage der NIW dieser Anlagen bewertet und werden als Stufe 1 betrachtet, vorausgesetzt die NIWs sind beobachtbar, werden täglich berechnet und entsprechen dem Wert, zu dem sowohl Käufe als auch Verkäufe erfolgen. Anlagen in privaten Investmentfonds mit erheblichen Rücknahmebeschränkungen, bei denen die Inputfaktoren der NIW beobachtbar sind, werden auf Grundlage der NIW dieser Anlagen bewertet, und sie werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Kurzfristige Schuldtitel (wie Commercial Paper) mit einer Restlaufzeit von 60 Tagen oder weniger können zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet werden, solange die fortgeführten Anschaffungskosten dieser kurzfristigen Schuldtitel annähernd dem ohne Anwendung der Methode der fortgeführten Anschaffungskosten ermittelten beizulegenden Zeitwert des Instruments entsprechen. Diese Wertpapiere werden je nach Quelle des Basispreises der Stufe 2 oder der Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie zugewiesen.

Freiverkehrsfinanzderivate, wie zum Beispiel Devisenkontrakte, Optionskontrakte oder Swaps beziehen ihren Wert aus den Kursen der zugrunde liegenden Vermögenswerte, Indizes, Referenzsätze und anderen Inputfaktoren oder einer Kombination dieser Faktoren. Diese Kontrakte werden gewöhnlich auf Basis von Wertpapierhändlerangeboten oder Kursbestimmungsdiensten bewertet. Abhängig vom Produkt und den Transaktionsbedingungen kann der Wert eines Derivatkontrakts von einem Kursbestimmungsdienst mithilfe einer Reihe von Inputfaktoren aus aktiv handelnden Märkten bestimmt werden, darunter beispielsweise Emittenteninformationen, Indizes, Spreads, Zinssätze, Kurven, Dividenden und Wechselkurse. Derivate, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Zentral abgerechnete Swaps, die über eine multilaterale- oder Handelsplattform (z. B. eine registrierte Börse) notiert oder gehandelt werden, werden zum von der betreffenden Börse bestimmten täglichen Abrechnungskurs bewertet. Für zentral abgerechnete Credit Default Swaps verlangt die Clearingstelle von ihren Mitgliedern verfolgbare Stufen während kompletter Laufzeitstrukturen. Diese Stufen werden gemeinsam mit den Preisen außenstehender Dritter zur Ermittlung täglicher Abrechnungskurse verwendet. Diese Wertpapiere werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Zentral abgerechnete Zinsswaps werden mit Hilfe eines Preismodells bewertet, das die zugrunde liegenden Zinssätze, einschließlich der Overnight Index Swap Rate und der LIBOR Forward Rate, berücksichtigt. Diese Wertpapiere werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

**Handelsaktiva und -passiva der Stufe 3 zum Marktwert** Wenn von PIMCO ein Marktbewertungsverfahren angewandt wird, das wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren einsetzt, werden Anlagen anhand eines Verfahrens bewertet, bei dem der Verwaltungsrat oder die Personen, die nach seinem Ermessen handeln, annehmen, dass es den angemessenen Marktwert korrekt wiedergibt, und sie werden in Stufe 3 der Bewertungshierarchie eingeordnet. Die Bewertungstechniken und wesentlichen Inputfaktoren, die verwendet werden, um den Marktwert von Anlagen der Fonds sowie von Finanzinstrumenten zu bestimmen, die in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet werden, gestalten sich folgendermaßen:

Indirekte Preisbestimmungsverfahren (Proxy Pricing) bestimmen den Basispreis eines festverzinslichen Wertpapiers und passen diesen dann proportional zu Marktwertänderungen eines vorab bestimmten Wertpapiers an, das in Bezug auf die Laufzeit als vergleichbar erachtet wird. In der Regel handelt es sich hierbei um eine US-Staatsanleihe oder einen auf dem Emissionsland beruhenden staatlichen Schuldtitel. Bei dem Basispreis kann es sich um einen von einem Broker-Händler quotierten Preis, einen Transaktionspreis oder einen anhand einer Analyse von Marktdaten ermittelten internen Wert handeln. Der Basispreis des Wertpapiers kann in regelmäßigen Abständen auf der Grundlage der Verfügbarkeit von Marktdaten und Verfahren, die vom PIMCO Valuation Oversight Committee (Ausschuss für die Bewertungsaufsicht) genehmigt wurden, neu festgesetzt werden. Erhebliche Änderungen der nicht beobachtbaren Inputfaktoren des Proxy-Pricing-Verfahrens (des Basispreises) würden zu direkten und proportionalen Änderungen des Marktwerts des Wertpapiers führen. Diese Wertpapiere werden in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Wenn keine von Dritten bewerteten Preise verfügbar sind oder angenommen wird, dass diese den Marktwert nicht angemessen widerspiegeln, kann sich PIMCO dafür entscheiden, Broker-Quotierungen direkt vom Broker-Händler oder von einem Drittanbieter zu beziehen. Wenn der Marktwert auf einer einzelnen bezogenen Broker-Quotierung beruht, werden diese Wertpapiere in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Broker-Quotierungen werden in der Regel von etablierten Marktteilnehmern bezogen. Auch wenn sie unabhängig bezogen werden, verfügt PIMCO nicht über die erforderliche Transparenz, um die zugrundeliegenden Inputfaktoren, auf die sich die Marktquotierung stützt, zu

überprüfen. Erhebliche Änderungen der Broker-Quotierung hätten direkte und proportionale Änderungen am Marktwert des Wertpapiers zur Folge.

Die Bewertung auf Basis eines Referenzinstruments schätzt den Marktwert durch Verwendung der Korrelation des Wertpapiers zu einem oder mehreren breit angelegten Wertpapieren, Marktindizes und/oder anderen Finanzinstrumenten, deren Preisinformationen problemlos verfügbar sind. Zu den nicht beobachtbaren Inputfaktoren können diejenigen zählen, die in Algorithmusformeln verwendet werden, welche auf der prozentualen Änderung der Referenzinstrumente und/oder der Gewichtung der einzelnen Referenzinstrumente beruhen. Erhebliche Änderungen an den nicht beobachtbaren Inputfaktoren hätten direkte und proportionale Änderungen am Marktwert des Wertpapiers zur Folge. Diese Wertpapiere werden in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Die Bewertung auf Basis einer fundamentalen Analyse schätzt den Marktwert durch Verwendung eines internen Modells, das die Abschlüsse des nicht börsennotierten zugrundeliegenden Unternehmens verwendet. Erhebliche Änderungen an den nicht beobachtbaren Inputfaktoren hätten direkte und proportionale Änderungen am Marktwert des Wertpapiers zur Folge. Diese Wertpapiere werden in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

#### 4. WERTPAPIERE UND ANDERE ANLAGEN

**(a) Barmittel** Barmittel werden zum Nennwert, gegebenenfalls zuzüglich aufgelaufener Zinsen, bewertet. Alle Bankguthaben werden entweder von State Street Bank and Trust Co. oder direkt bei einer Unterverwahrstelle gehalten.

**(b) Anlagen in zentrale Fonds** Bestimmte Fonds dürfen im Zusammenhang mit ihren Aktivitäten zum Verwalten von Barmitteln auch im PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, einem Teilfonds von PIMCO Select Funds plc, anlegen. Die Hauptanlagen des PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund erfolgen in Geldmarktinstrumenten und Renteninstrumenten mit kurzer Laufzeit. Dem PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund können Aufwendungen entstehen, die im Zusammenhang mit seinen Anlageaktivitäten stehen. Die PIMCO-Fonds investieren jedoch nur in die Z Class, so dass keine Verwaltungsgebühren anfallen.

**(c) Anlagen in Wertpapieren** Die Fonds können die nachfolgend beschriebenen Anlagen und Strategien verwenden, soweit dies gemäß der Anlagepolitik der Fonds zulässig ist.

**Transaktionen mit verzögerter Lieferung** Bestimmte Fonds dürfen Wertpapiere auf Basis verzögerter Lieferung erwerben oder verkaufen. Ein Fonds geht eine Verpflichtung in Bezug auf diese Transaktionen ein, Wertpapiere zu einem vorab bestimmten Preis oder einer vorab bestimmten Rendite bei Zahlung und Lieferung außerhalb des üblichen Abrechnungszeitraums zu erwerben oder zu verkaufen. Sind Geschäfte mit verzögerter Lieferung offen, bestimmt oder erhält der entsprechende Fonds in dem Umfang liquide Mittel als Sicherheit, der ausreicht, um den Kaufpreis zu begleichen oder die entsprechenden Verpflichtungen zu erfüllen. Beim Erwerb eines Wertpapiers auf Basis verzögerter Lieferung übernimmt der Fonds die Besitzrechte und -risiken des Wertpapiers, einschließlich des Kursrisikos und der Renditeschwankungen, und berücksichtigt diese Schwankungen bei der Bestimmung seines NIW. Ein Fonds kann nach Abschluss einer Transaktion auf Basis verzögerter Lieferung diese veräußern oder neu verhandeln, was zu einem Gewinn oder Verlust führen kann. Hat ein Fonds ein Wertpapier auf Basis verzögerter Lieferung verkauft, nimmt der Fonds nicht an den zukünftigen Gewinnen und Verlusten dieses Wertpapiers teil.

**Börsengehandelte Fonds** Bestimmte Fonds dürfen in börsengehandelte Fonds („ETFs“) anlegen, bei denen es sich im Allgemeinen um indexbasierte Investmentgesellschaften handelt, die im Wesentlichen ihr gesamtes Vermögen in Wertpapieren halten, die in ihrem spezifischen Index geführt werden, die jedoch auch aktiv verwaltete Investmentgesellschaften sein können. Anteile an ETFs werden während des ganzen Tages an einer Börse gehandelt und repräsentieren eine Anlage in einem Portfolio von Wertpapieren und Vermögenswerten. Als Anteilinhaber einer anderen Investmentgesellschaft würde der Fonds seinen prozentualen Anteil an den Aufwendungen der anderen Investmentgesellschaften, einschließlich Beratungsgebühren, zusätzlich zu den Aufwendungen tragen, die dem Fonds direkt im Zusammenhang mit seiner eigenen Geschäftstätigkeit entstehen.

**Inflationsindexierte Anleihen** Bestimmte Fonds dürfen in inflationsindexierte Anleihen anlegen. Inflationsindexierte Anleihen sind festverzinsliche Wertpapiere, deren Kapitalwert regelmäßig an die Inflationsrate angepasst wird. Der Zinssatz für diese Anleihen wird im Allgemeinen bei der Ausgabe niedriger angesetzt als bei normalen Anleihen. Während der Laufzeit einer inflationsindexierten Anleihe werden jedoch Zinsen auf der Basis eines Kapitalwertes gezahlt, der inflationsbereinigt ist. Erhöhungen oder Verringerungen des Kapitalbetrags einer inflationsindexierten Anleihe sind als Zinseinkünfte in der Betriebsergebnisrechnung enthalten, obwohl Anleger ihren Kapitalbetrag nicht vor Fälligkeit erhalten.

**Kreditbeteiligungen und -abtretungen** Bestimmte Fonds können in direkte Schuldinstrumente anlegen, bei denen es sich um Beteiligungen an Beträgen handelt, die Kreditgebern oder Kreditkonsortien von Industrie-, Regierungs- oder sonstigen Darlehensnehmern geschuldet werden. Die Anlagen eines Fonds in Darlehen können in Form von Darlehensbeteiligungen oder -abtretungen in sämtliche oder einige Anteile eines Darlehens von Dritten erfolgen. Ein Darlehen wird oft von einer Bank oder einem sonstigen Finanzinstitut (der „Kreditgeber“) verwaltet, der als Vertreter für alle Beteiligten agiert. Der Vertreter verwaltet die Darlehensbedingungen gemäß den Bestimmungen der Darlehensvereinbarung. Ein Fonds darf in mehrere Serien oder Tranchen eines Darlehens anlegen, die über unterschiedliche Bedingungen verfügen können und mit denen unterschiedliche Risiken verbunden sind. Erwirbt ein Fonds Abtretungen von Verleihern, erwirbt er direkte Rechte gegenüber dem Darlehensnehmer.

Zu diesen Darlehen können Beteiligungen an „Überbrückungskrediten“ gehören. Hierbei handelt es sich um Kredite, die Kreditnehmer für einen kurzen Zeitraum (normalerweise unter einem Jahr) aufnehmen, bis eine auf lange Sicht ausgelegte Finanzierung beispielsweise durch die Ausgabe von Anleihen, häufig High-Yield-Anleihen, die für Akquisitionen emittiert werden, gesichert werden kann.

Zu den Arten von Darlehen und verbundenen Anlagen, in die ein Fonds investieren kann, zählen unter anderem vorrangige Darlehen, nachrangige Darlehen (einschließlich zweitrangiger Pfandrechte, B-Notes und Mezzanine-Darlehen), Whole Loans, gewerbliche Immobilien- und sonstige gewerbliche Darlehen und strukturierte Darlehen. Im Fall nachrangiger Darlehen können erhebliche Schulden vorliegen, die der Obligation des Schuldners gegenüber dem Inhaber eines solchen Darlehens vorrangig sind, unter anderem auch im Fall der Insolvenz des Schuldners. Mezzanine-Darlehen werden in der Regel durch eine Verpfändung einer Eigenkapitalbeteiligung am Hypothekenehmer, dem die Immobilie gehört, und nicht durch eine Beteiligung an der Hypothek besichert. Anlagen in Darlehen können ungedeckte Darlehenszusagen umfassen. Hierbei handelt es sich um vertragliche Finanzierungsverpflichtungen. Ungedeckte Darlehenszusagen können revolvingierende Kreditfazilitäten enthalten, die die Fonds verpflichten können, dem Darlehensnehmer auf Verlangen zusätzliche Barmittel zur Verfügung zu stellen. Ungedeckte Darlehenszusagen sind vollständige zukünftige Verpflichtungen, obwohl ein Prozentsatz der Nominaldarlehensbeträge vom Darlehensnehmer niemals ausgeschöpft wird. Bei Anlagen in Darlehensbeteiligungen verfügt ein Fonds über das Recht auf den Erhalt von Kapitalzahlungen, Zinsen und Gebühren, auf die er ein Anrecht hat, und zwar ausschließlich gegenüber dem Kreditgeber, der die Darlehensvereinbarung veräußert, und ausschließlich bei Erhalt von Zahlungen des Kreditnehmers an den Kreditgeber. Ein Fonds kann für den nicht ausgeschöpften Anteil des zugrunde liegenden Kreditlinienanteils eines variabel verzinslichen Kredits Bereitstellungsgebühren erhalten. Unter bestimmten Umständen kann ein Fonds im Fall einer vorzeitigen Tilgung eines variabel verzinslichen Kredits durch einen Kreditnehmer eine Vorfälligkeitsentschädigungsgebühr erhalten. Eingenommene/gezahlte Gebühren werden als Bestandteil der Zinserträge bzw. Zinsaufwendungen in der Betriebsergebnisrechnung erfasst.

Zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 hatten die Fonds keine ungedeckten Darlehenszusagen.

**Hypothekarisch gedeckte und andere forderungsbesicherte Wertpapiere** Bestimmte Fonds dürfen in hypothekarisch gedeckte und andere forderungsbesicherte Wertpapiere anlegen, die unmittelbar oder mittelbar die Beteiligung an Hypothekendarlehen auf Immobilien darstellen oder von diesen besichert und aus diesen zahlbar sind. Hypothekarisch gedeckte Wertpapiere basieren auf Pools von privaten und gewerblichen Hypothekendarlehen, einschließlich von Spar- und Darlehensinstituten, Hypothekenbanken, Geschäftsbanken und anderen Einrichtungen begebenen Hypothekendarlehen. Diese Wertpapiere leisten monatliche Zahlungen, die sowohl aus Zins- als auch Kapitalzahlungen bestehen. Die Zinsen können durch feste bzw. flexible Zinssätze festgelegt werden. Die Höhe der vorab geleisteten Zahlungen auf zugrunde liegende Hypotheken beeinflusst den Kurs und die Volatilität von hypothekarisch besicherten Wertpapieren und kann, verglichen mit den Antizipationen zum Kaufzeitpunkt, kürzere oder längere effektive Durationen des Wertpapiers zur Folge haben. Die Regierung der USA garantiert, dass Kapital und Zinsen auf bestimmte hypothekarisch besicherte Wertpapiere rechtzeitig gezahlt werden. Von nichtstaatlichen Emittenten zusammengestellte und garantierte Pools, einschließlich staatsnaher Institute, können von unterschiedlich gearteten Versicherungen oder Garantien abgesichert sein. Es kann jedoch nicht zugesichert werden, dass private Versicherer oder Garantiegeber ihre Verpflichtungen aus den Versicherungspoliceen bzw. Garantievereinbarungen erfüllen können. Viele dieser Risiken der Anlage in hypothekarisch gedeckte Wertpapiere, die durch gewerbliche Hypothekendarlehen gesichert werden, spiegeln die Folgen der lokalen sowie der sonstigen Wirtschaftslage für die Immobilienmärkte, die Fähigkeit der Mieter, Mietzahlungen zu leisten, sowie die Fähigkeit einer Immobilie wider, Mieter zu interessieren und zu binden. Diese Wertpapiere können weniger liquide sein und eine höhere Kursvolatilität zeigen

als andere Arten von hypothekarisch oder forderungsbesicherten Wertpapieren. Andere forderungsbesicherte Wertpapiere setzen sich aus verschiedenen Vermögensarten, einschließlich Autodarlehen, Kreditkartenforderungen, Hypotheken sowie Studentendarlehen, zusammen.

**Collateralised Mortgage Obligations** Collateralized Mortgage Obligations („CMOs“) sind Schuldinstrumente eines Rechtssubjekts, die von Whole Mortgage Loans oder privaten Hypothekendarlehen besichert und in Klassen gegliedert sind. CMOs sind in mehrere Klassen gegliedert, die oft als „Tranchen“ bezeichnet werden. Dabei wurde für jede Klasse eine andere Laufzeit festgelegt, und jede Klasse hat das Recht auf einen eigenen Kapital- und Zinszahlungsplan, einschließlich vorfristiger Rückzahlungen. CMOs und CMBS können weniger liquide sein und eine höhere Kursvolatilität zeigen als andere Arten von hypothekarisch oder forderungsbesicherten Wertpapieren.

**Stripped Mortgage Backed Securities** („SMBS“) sind derivative Hypothekensicherungen mit mehreren Klassen. SMBS gliedern sich gewöhnlich in zwei Klassen, die Zins- und Kapitalausschüttungen aus einem Pool von Hypothekensicherungen in unterschiedlichen Verhältnissen erhalten. Im Extremfall erhält eine Klasse die gesamten Zinsen (die „IO“ [Interest-Only]-Klasse), während die andere Klasse die gesamten Kapitalzahlungen erhält (die „PO“ [Principal-Only]-Klasse). Für IOs erhaltene Zahlungen sind in den Zinseinkünften der Betriebsergebnisrechnung enthalten. Da bei Fälligkeit eines IO kaum oder kein Kapital anfällt, wird der Buchwert des Wertpapiers monatlich bis zur Fälligkeit angepasst. Diese Anpassungen sind in den Zinseinkünften der Betriebsergebnisrechnung enthalten. Für POs erhaltene Zahlungen werden als Herabsetzung der Kosten und der Parität der Wertpapiere behandelt.

**Uniform Mortgage-Backed Securities** („UMBS“) Im Juni 2019 begannen FNMA und FHLMC im Rahmen der Single Security Initiative, anstelle ihrer derzeit angebotenen TBA-fähigen Wertpapiere Uniform Mortgage-Backed Securities auszugeben. Die Single Security Initiative zielt darauf ab, die Liquidität des TBA-Markts insgesamt zu unterstützen und gleicht die Merkmale von FNMA- und FHLMC-Zertifikaten an. Welche Auswirkungen die Single Security Initiative auf den Markt für TBA und andere hypothekensicherungen Wertpapiere haben wird, ist ungewiss.

**Collateralized Debt Obligations** („CDOs“) umfassen so genannte besicherte Anleiheverbindlichkeiten (Collateralized Bond Obligations, „CBOs“), besicherte Darlehensverbindlichkeiten (Collateralized Loan Obligations, „CLOs“) sowie andere ähnlich strukturierte Wertpapiere. CBOs und CLOs sind Arten forderungsbesicherter Wertpapiere. Bei einem CBO handelt es sich um einen Fonds, der von einem diversifizierten Pool hoch risikanter Rentenpapiere mit einem Rating unterhalb von Investment Grade besichert ist. Ein CLO ist ein Fonds, der typischerweise von einem Darlehenspool besichert ist, der unter anderem in- und ausländische, vorrangige, besicherte Darlehen, vorrangige, nicht besicherte Darlehen und nachrangige Unternehmensdarlehen, einschließlich Darlehen mit einem Rating unter Investment Grade oder äquivalente unbewertete Darlehen enthält. Die Risiken aus einer Anlage in einem CDO hängen größtenteils von der Art der als Sicherheit dienenden Wertpapiere und der Klasse des CDO ab, in die der Fonds anlegt. Zusätzlich zu den normalen Risiken, die mit an anderer Stelle in diesem Bericht sowie im Verkaufsprospekt und in den zusätzlichen Informationen zum Verkaufsprospekt der Gesellschaft besprochenen Rentenwerten verbunden sind (z. B. Vorauszahlungsrisiko, Kreditrisiko, Liquiditätsrisiko, Marktrisiko, strukturelles Risiko, rechtliches Risiko und Zinsrisiko (das verschärft werden kann, wenn sich der für eine strukturierte Finanzierung zu zahlende Zinssatz auf der Basis von Vielfachen von Zinssatzänderungen oder gegenläufig zu Zinssatzänderungen ändert)), sind CBOs, CLOs und andere CDOs mit zusätzlichen Risiken verbunden, einschließlich insbesondere, (i) dass Ausschüttungen aus als Sicherheit dienenden Wertpapieren möglicherweise nicht ausreichen, um Zinsen oder sonstige Auszahlungen zu begleichen, (ii) die Sicherheit im Wert nachgeben oder in Verzug geraten kann, (iii) dass der Fonds in CBOs, CLOs oder andere CDOs anlegen kann, die anderen Klassen untergeordnet sind, und (iv) dass die komplexe Struktur des Wertpapiers zum Zeitpunkt der Anlage nicht vollständig verstanden wird und Konflikte mit dem Emittenten hervorrufen oder unerwartete Anlageergebnisse herbeiführen kann.

**Wertpapiere mit Sachausschüttungen** Bestimmte Fonds dürfen in Wertpapiere mit Sachausschüttungen (Payment In-Kind Securities, „PIKs“) anlegen. PIKs gewähren dem Emittenten ggf. die Möglichkeit, zu jedem Zinszahlungsdatum Zinszahlungen entweder bar und/oder in zusätzlichen Schuldpapieren vorzunehmen. Diese zusätzlichen Schuldinstrumente verfügen gewöhnlich über die gleichen Bedingungen wie die Originalanleihen, einschließlich Fälligkeitsdaten und Zinssätzen sowie verbundenen Risiken. Die täglichen Kursnotierungen der Originalanleihen können angefallene Zinsen enthalten („Dirty Price“ [Kurs einschließlich Stückzinsen]). Diese sind als Bestandteil des zum Marktwert bewerteten Finanzvermögens aus übertragbaren Wertpapieren im Finanzstatus enthalten.

**US-Regierungsbehörden oder staatlich geförderte Unternehmen** Bestimmte Fonds dürfen in Wertpapiere von US-Regierungsbehörden oder staatlich geförderten Unternehmen anlegen. Wertpapiere von US-Regierungsbehörden sind Obligationen der US-Regierung, ihrer Behörden oder Organe und sind in bestimmten Fällen von diesen verbrieft. Einige Wertpapiere der US-Regierung, wie zum Beispiel Schatztitel, Wechsel und Anleihen, sowie von der Government National Mortgage Association („GNMA“ oder „Ginnie Mae“) verbrieft Wertpapiere, werden von der US-Regierung in vollem Umfang unterstützt; andere, wie zum Beispiel von Federal Home Loan Banks, sichert das Recht, dass der Emittent vom US Department of the Treasury (das „US-Finanzministerium“) leihen darf, und andere, wie zum Beispiel von der Federal National Mortgage Association („FNMA“ oder „Fannie Mae“) werden dadurch gesichert, dass die US-Regierung nach eigenem Ermessen Obligationen der Behörde erwerben kann. Wertpapiere der US-Regierung können Nullkuponwertpapiere enthalten. Nullkuponwertpapiere schützen keine laufenden Zinsen aus. Für sie gelten höhere Risiken als für zinszahlende Wertpapiere.

Zu den regierungsnahen Garantiegebern (d. h. ohne Schutz der vollumfänglichen Unterstützung der Regierung der USA) zählen die FNMA und die Federal Home Loan Mortgage Corporation („FHLMC“ oder „Freddie Mac“). Die FNMA ist eine staatlich geförderte Gesellschaft. Die FNMA erwirbt konventionelle (d. h. nicht von einer Regierungsbehörde versicherte oder verbrieft) Immobilienhypotheken aus einem Verzeichnis zugelassener Verkäufer/Dienstleister. Zu diesen zählen staatlich und bundesstaatlich amtlich zugelassene Spar- und Darlehenskassen, Genossenschaftsbanken, Geschäftsbanken, Kreditgenossenschaften und Hypothekenbanken. Für von der FNMA begebene Durchlaufpapiere garantiert die FNMA die rechtzeitige Zahlung von Kapital und Zinsen. Sie genießen jedoch nicht die vollumfängliche Unterstützung der Regierung der USA. Die FHLMC gibt Participation Certificates („PCs“) aus. Bei ihnen handelt es sich um Durchlaufpapiere. Jedes vertritt die ungeteilte Beteiligung an einem Pool von Wohnhypotheken. Die FHLMC garantiert die rechtzeitige Zahlung von Zinsen und den endgültigen Kapitaleinzug. PCs genießen jedoch nicht die vollumfängliche Unterstützung der US-Regierung.

Ein Fonds kann Strategien einsetzen, mit denen er versucht, den Ablauf oder die Fälligkeit einer Position wie etwa einer TBA-Transaktion auf einen Basiswert zu verlängern, indem er die Position vor ihrem Ablauf schließt und eine neue Position in Bezug auf denselben Basiswert eröffnet, die ein späteres Ablaufdatum hat. Ge- und verkaufte TBA-Wertpapiere werden im Finanzstatus jeweils als Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten ausgewiesen.

**Börsennotierte Immobilienfonds („REITs“)** sind gepoolte Anlagevehikel, die ertragbringende Immobilien besitzen und in der Regel auch betreiben. Wenn ein REIT bestimmte Anforderungen erfüllt, unter anderem dass er im Wesentlichen seine gesamten steuerpflichtigen Erträge (außer Nettokapitalgewinnen) an die Anteilhaber ausschüttet, ist er im Hinblick auf die an Anteilhaber ausgeschütteten Erträge nicht steuerpflichtig. Von REITs erhaltene Ausschüttungen können als Ertrag, Kapitalgewinn oder Kapitalrückführung eingestuft werden. Eine Kapitalrückführung wird vom Fonds als Minderung der Kostenbasis seiner Anlage im REIT erfasst. Für REITs fallen Verwaltungsgebühren und andere Aufwendungen an, so dass die Fonds, die in REITs investieren, ihren jeweiligen Anteil an den Kosten für den Betrieb der REITs tragen.

**Beschränkt handelbare Wertpapiere** Bestimmte Fonds dürfen in Wertpapiere anlegen, die rechtlichen oder vertraglichen Weiterverkaufseinschränkungen unterliegen. Diese Wertpapiere dürfen privat verkauft werden, müssen aber vor dem Verkauf an die Öffentlichkeit eingetragen oder von einer solchen Eintragung befreit werden. Privat platzierte Wertpapiere gelten allgemein als beschränkt handelbar. Der Verkauf von eingeschränkten Wertpapieren kann zeitaufwändige Verhandlungen sowie Aufwendungen beinhalten und der sofortige Verkauf zu einem akzeptablen Kurs kann schwierig zu erzielen sein. Zum 31. Dezember 2020 von den Fonds gehaltene beschränkt handelbare Wertpapiere werden in den Erläuterungen zur Aufstellung der Wertpapieranlagen offengelegt.

**Aktiegebundene Wertpapiere** Bestimmte Fonds dürfen aktiegebundene Wertpapiere erwerben. Diese sind auch als Beteiligungsscheine, Aktienswaps sowie Zero-Strike-Calls und Optionsscheine bekannt. Ein Fonds nutzt aktiegebundene Wertpapiere hauptsächlich als Alternative, um effizienter und effektiver Zugang zu so genannten Schwellen-Wertpapiermärkten zu erhalten. Ein Fonds hinterlegt im Tausch gegen ein aktiegebundenes Wertpapier Barmittel bei seiner Verwahrstelle (oder seinem Wertpapierhändler, wenn dies rechtlich zulässig ist), deren Betrag dem Verkaufskurs des Basiswertpapiers nahe ist oder diesem entspricht. Bei Verkauf erhält ein Fonds Barmittel von seinem Wertpapierhändler oder seiner Verwahrstelle, die dem Wert des Basiswertpapiers entsprechen. Neben dem Marktrisiko der Basiswertpapiere besteht das Risiko der Säumnis des Kontrahenten der Transaktion. Bei Insolvenz des Kontrahenten könnte ein Fonds nicht in der Lage sein, den erwarteten Nutzen zu erlangen. Ein Fonds ist bestrebt, solche Transaktionen nur mit Parteien einzugehen, die in der Lage sind, tatsächlich solche Abschlüsse mit dem Fonds zu tätigen. Es gibt allerdings keine Garantie dafür, dass der Fonds bis zum Ende der Laufzeit der Basisvereinbarung jederzeit in der Lage ist, eine solche Transaktion mit dem Kontrahenten abzuschließen oder eine glattstellende Position mit einem

Kontrahenten zu erlangen. Das kann die Fähigkeit eines Fonds beeinträchtigen, andere Transaktionen zu einem dafür günstigen Zeitpunkt einzugehen.

**Transaktionen mit Emissionstermin** Bestimmte Fonds dürfen Wertpapiere auf Basis „per Emissionstermin“ erwerben oder verkaufen. Diese Transaktionen erfolgen bedingt, da ein Wertpapier, obwohl genehmigt, sich noch nicht auf dem Markt befindet. Diese Transaktionen beinhalten eine Verpflichtung seitens des Fonds, diese Wertpapiere zu einem vorab bestimmten Kurs oder einer vorab bestimmten Rendite mit Zahlung und Lieferung außerhalb des üblichen Abrechnungszeitraums zu kaufen oder zu verkaufen. Ein Fonds darf Wertpapiere auf Basis „per Emission“ verkaufen, bevor diese ausgehändigt werden, was zu einem realisierten Kapitalgewinn oder -verlust führen kann.

**Unbefristete Anleihen** sind festverzinsliche Wertpapiere ohne Fälligkeitstermin, die jedoch auf Dauer einen Kupon zahlen (ohne angegebenen End- oder Fälligkeitstermin). Im Gegensatz zu typischen festverzinslichen Wertpapieren besteht für unbefristete Anleihen keine Verpflichtung, das Kapital zurückzuzahlen. Die Kuponzahlungen sind hingegen verpflichtend. Während unbefristete Anleihen keinen Fälligkeitstermin aufweisen, können sie ein Kündigungsdatum haben, an dem die Unbefristetheit wegfällt und der Emittent den erhaltenen Kapitalbetrag am angegebenen Kündigungstermin zurückzahlen kann. Außerdem kann eine unbefristete Anleihe zusätzliche Merkmale haben, beispielsweise Zinserhöhungen an regelmäßigen Terminen oder eine Erhöhung an einem vorab festgelegten Zeitpunkt in der Zukunft.

## 5. KREDITE UND ANDERE FINANZIERUNGSTRANSAKTIONEN

Die Fonds dürfen die nachfolgend beschriebenen Kredite und Finanzierungstransaktionen abschließen, sofern dies gemäß der Anlagepolitik des jeweiligen Fonds zulässig ist.

Die folgenden Angaben enthalten Informationen zur Fähigkeit der Fonds, Barmittel oder Wertpapiere gemäß dem Gesetz zu verleihen oder zu leihen, soweit dies gemäß ihren Anlagezielen und ihrer Anlagepolitik zulässig ist, sowie vorbehaltlich der von der Zentralbank jeweils festgelegten Grenzen und der Bestimmungen des Verkaufsprospekts. Diese können als Kredite oder Finanzierungstransaktionen der Fonds betrachtet werden. Nachfolgend ist beschrieben, wo diese Instrumente in den Abschlüssen der Fonds zu finden sind.

**(a) Pensionsgeschäfte** Bestimmte Fonds dürfen Pensionsgeschäfte eingehen. Bei einem typischen Pensionsgeschäft nimmt der Fonds einen Basisschuldtitel (Sicherheit) vorbehaltlich der Verpflichtung des Verkäufers zum Rückkauf und des Fonds zum Weiterverkauf der Verbindlichkeit zu einem vereinbarten Preis und Zeitpunkt in Besitz. Der Marktwert der Sicherheit muss jederzeit dem Gesamtbetrag der Rückkaufverbindlichkeiten einschließlich Zinsen entsprechen oder höher sein als dieser Gesamtbetrag. Pensionsgeschäfte, einschließlich angefallener Zinsen, sind im Finanzstatus enthalten. Zinseinkünfte werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteil der Zinserträge erfasst. In Zeiträumen mit erhöhtem Bedarf an Sicherheiten muss ein Fonds eventuell eine Gebühr für den Erhalt von Sicherheiten bezahlen, was zu Zinsaufwendungen für den Fonds führen kann.

**(b) Umgekehrte Pensionsgeschäfte** Bestimmte Fonds dürfen umgekehrte Pensionsgeschäfte eingehen. Bei einem umgekehrten Pensionsgeschäft übergibt ein Fonds einem Finanzinstitut, dem Kontrahenten, ein Wertpapier im Gegenzug für Barmittel, mit einer gleichzeitigen Vereinbarung zum Rückkauf desselben oder im Wesentlichen desselben Wertpapiers zu einem vereinbarten Preis und Datum. Der Fonds ist zum Erhalt etwaiger Kapital- und Zinszahlungen berechtigt, die auf das Wertpapier, das an den Kontrahenten während der Laufzeit der Vereinbarung geliefert wurde, vorgenommen wurden. Barmittel, die für gelieferte Wertpapiere ausbezahlt wurden, zusätzlich aufgelaufener Zinszahlungen, die von einem Fonds an Kontrahenten vorzunehmen sind, werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit ausgewiesen. Vom Fonds an Kontrahenten vorgenommene Zinszahlungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteil der Zinsaufwendungen erfasst. In Zeiträumen mit erhöhtem Bedarf an Sicherheiten kann ein Fonds eventuell eine Gebühr für den Einsatz des Wertpapiers durch den Kontrahenten erhalten, was zu Zinseinkünften für den Fonds führen kann. Ein Fonds stellt von den Anlageberatungsgesellschaften oder anderweitig für liquide erklärte Vermögenswerte zurück, die dazu bestimmt sind, die Verpflichtung aus einem umgekehrten Pensionsgeschäft zu erfüllen.

**(c) Leerverkäufe** Bestimmte Fonds dürfen Leerverkaufs-Transaktionen tätigen. Ein Leerverkauf ist eine Transaktion, bei der ein Fonds Wertpapiere, die nicht in seinem Besitz sind, im Vorgriff auf einen Rückgang des beizulegenden Zeitwerts der Wertpapiere verkaufen kann. In einem Leerverkauf veräußerte Wertpapiere und gegebenenfalls auf diese zahlbare Zinsen werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit wiedergegeben. Ein Fonds ist verpflichtet, die Wertpapiere zum Zeitpunkt der Glattstellung der Short Position zum Handelspreis zu liefern. Während die etwaigen Verluste aus einem Leerverkauf unbegrenzt sein können, können die Verluste aus den Käufen die Höhe des angelegten Gesamtbetrages nicht übersteigen.

**(d) Sale-Buybacks** Bestimmte Fonds können Finanzierungsgeschäfte eingehen, die als ‚Sale-Buybacks‘ (Verkäufe-Rückkäufe) bezeichnet werden. Ein Sale-Buyback-Geschäft (Rückkauf-Finanzierung) besteht aus dem Verkauf eines Wertpapiers durch einen Fonds an ein Finanzinstitut, den Kontrahenten, mit einer gleichzeitigen Vereinbarung zum Rückkauf desselben oder im wesentlichen desselben Wertpapiers zu einem vereinbarten Preis und an einem vereinbarten Datum. Ein Fonds ist nicht zum Erhalt von Kapital- und Zinszahlungen berechtigt, die auf das Wertpapier, das an den Kontrahenten während der Laufzeit der Vereinbarung verkauft wurde, vorgenommen wurden. Die vereinbarten Erlöse für Wertpapiere, die von einem Fonds zurückzukaufen sind, werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit ausgewiesen. Ein Fonds weist Nettoerträge aufgrund eines Preisunterschieds zwischen dem für das übertragene Wertpapier erhaltenen Preis und dem vereinbarten Rückkaufpreis aus. Dies wird allgemein als Preisrückgang bezeichnet. Ein Preisrückgang besteht aus (i) den entfallenen etwaigen Zins- und inflationären Ertragsberichtigungen, die ein Fonds ansonsten erhalten hätte, wenn das Wertpapier nicht verkauft worden wäre, und (ii) den zwischen einem Fonds und dem Kontrahenten vereinbarten Finanzierungsbedingungen. Die etwaigen entfallenen Zins- und inflationären Ertragsberichtigungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteile des Zinsertrags ausgewiesen. Von einem Fonds an Kontrahenten aufgrund von ausgehandelten Finanzierungsbedingungen vorgenommene Zinszahlungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteil der Zinsaufwendungen erfasst. In Zeiträumen mit erhöhtem Bedarf an Sicherheiten kann ein Fonds eventuell eine Gebühr für den Einsatz des Wertpapiers durch den Kontrahenten erhalten, was zu Zinseinkünften für den Fonds führen kann. Ein Fonds stellt von den Anlageberatungsgesellschaften oder anderweitig für liquide erklärte Vermögenswerte zurück, die dazu bestimmt sind, die Verpflichtung aus Sale-Buyback-Geschäften zu erfüllen.

### 6. FINANZDERIVATE

Die folgenden Offenlegungen enthalten Informationen darüber, wie und warum die Fonds Finanzderivate einsetzen, und wie Finanzderivate die finanzielle Lage, das Ergebnis der Geschäftstätigkeit und die Kapitalflüsse der Fonds beeinflussen. Die zum Ende des Geschäftsjahres ausstehenden Finanzderivate, wie sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen erfasst werden, und die Beträge der realisierten und die Veränderungen der nicht realisierten Gewinne und Verluste aus Finanzderivaten während des Geschäftsjahres, wie sie in der Betriebsergebnisrechnung erfasst werden, dienen als Indikatoren für den Umfang der Finanzderivataktivitäten für die Fonds.

**(a) Devisenterminkontrakte** Bestimmte Fonds dürfen Devisenterminkontrakte in Verbindung mit der Abrechnung geplanter Käufe oder Verkäufe von Wertpapieren eingehen, um Währungsrisiken in Verbindung mit einigen oder allen Fondswertpapieren abzusichern oder als Teil der Anlagestrategie. Ein Devisenterminkontrakt ist ein Vertrag zwischen zwei Parteien über den Kauf und Verkauf einer Währung zu einem bestimmten Kurs zu einem zukünftigen Zeitpunkt. Der Marktwert eines Devisenterminkontrakts schwankt mit den Änderungen der Wechselkurse. Devisenterminkontrakte werden täglich zum letzten Börsenkurs bewertet, und die Wertänderung wird vom Fonds als nicht realisierter Gewinn oder Verlust erfasst. Realisierte Gewinne oder Verluste entsprechen dem Unterschied zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seiner Eröffnung und dem Wert zum Zeitpunkt seiner Schließung und werden mit Lieferung oder Erhalt der Währung erfasst.

Diese Kontrakte können mit Marktrisiken verbunden sein, die über den nicht realisierten Gewinn oder Verlust hinausgehen, die im Finanzstatus wiedergegeben werden. Zusätzlich kann ein Fonds Risiken ausgesetzt sein, wenn die Kontrahenten nicht in der Lage sind, die Vertragsbedingungen zu erfüllen, oder wenn sich der Wert der Währung gegenüber der Funktionswährung nachteilig ändert. Um dieses Risiko zu vermindern, können Barmittel oder Wertpapiere gemäß dem Bestimmungen der zugrundeliegenden Verträge als Sicherheiten ausgetauscht werden.

Bestimmte Fonds verfügen über eine abgesicherte Klasse, die Devisenterminkontrakte einget, die dazu bestimmt sind, den Absicherungseffekt auf Fondsebene glattzustellen, damit sich die abgesicherten Klassen weiter an anderen Währungen als der Funktionswährung beteiligen kann. Es kann nicht garantiert werden, dass diese klassenspezifischen Devisenterminkontrakte erfolgreich sein werden.

Bei Absicherungen von Anteilsklassen werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschließlich den betreffenden Anteilsklassen zugeordnet. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste sind als Bestandteil der Finanzderivate im Finanzstatus ausgewiesen. Im Zusammenhang mit diesen Verträgen können Wertpapiere in Übereinstimmung mit den Bedingungen der jeweiligen Verträge zu Sicherheiten bestimmt werden.

**(b) Terminkontrakte** Bestimmte Fonds dürfen Terminkontrakte abschließen. Ein Fonds kann Terminkontrakte verwenden, um sein Risiko an den Wertpapiermärkten oder gegenüber Schwankungen der Zinssätze und Währungskurse zu verwalten. Die Hauptrisiken in Verbindung mit dem Einsatz von Terminkontrakten sind die unvollständige Korrelation zwischen der Veränderung des Marktwertes der von einem Fonds gehaltenen Wertpapiere und den Preisen von Terminkontrakten sowie die Möglichkeit eines illiquiden Marktes. Terminkontrakte werden auf der Basis ihrer täglich festgestellten Abrechnungskurse bewertet. Beim Abschluss eines Terminkontrakts muss ein Fonds bei seinem Terminhändlereinen Geldbetrag oder US-Regierungs- und Behördenanleihen sowie ausgewählte Staatsanleihen in Übereinstimmung mit den ursprünglichen erforderlichen Einschüssen des Händlers oder der Börse hinterlegen. Terminkontrakte werden täglich zum letzten Börsenkurs bewertet, und auf Basis dieser Bewegungen der Preise der Kontrakte kann der Fonds eine entsprechende Forderung oder Verbindlichkeit für die Wertänderung stellen bzw. einziehen („Marge für Finanzderivate“). Gewinne oder Verluste werden erfasst, gelten jedoch nicht als realisiert, bis die Kontrakte auslaufen oder glattgestellt werden. Terminkontrakte beinhalten in unterschiedlichem Maße Verlustrisiken, die über die im Finanzstatus ausgewiesene Marge für Finanzderivate hinausgehen.

**(c) Optionskontrakte** Bestimmte Fonds können Optionen verkaufen oder kaufen, um Renditen zu erhöhen oder um eine vorhandene Position oder zukünftige Anlage abzusichern. Ein Fonds darf Kauf- („Call“) und Verkaufsoptionen („Put“) auf Wertpapiere und derivative Finanzinstrumente verkaufen, die sich in seinem Besitz befinden oder in die er anlegen darf. Der Verkauf von Verkaufsoptionen neigt dazu, das Risiko für einen Fonds aus dem zugrunde liegenden Instrument zu erhöhen. Der Verkauf von Kaufoptionen neigt dazu, das Risiko für einen Fonds aus dem zugrunde liegenden Instrument zu senken. Veräußert ein Fonds eine Kauf- oder Verkaufsoption, dann erfasst er einen Betrag, der der erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit und bewertet diese zum letzten Börsenkurs, um den aktuellen Wert der verkauften Option wiederzugeben. Diese Verbindlichkeiten sind im Finanzstatus enthalten. Erhaltene Prämien aus dem Verkauf von Optionen, die auslaufen, werden als realisierte Gewinne erfasst. Erhaltene Prämien aus dem Verkauf von Optionen, die ausgeübt oder glattgestellt werden, sind den Erlösen hinzuzurechnen oder gegen die aus den zugrunde liegenden Futures, Swaps, Wertpapiere oder Währungstransaktionen gezahlten Beträge aufzurechnen, um den realisierten Gewinn oder Verlust zu bestimmen. Bestimmte Optionen dürfen mit Prämien erworben werden, die zu einem späteren Zeitpunkt festgelegt werden. Die Prämien für diese Optionen basieren auf implizierten Volatilitätsparametern zu bestimmten Bedingungen. Ein Fonds, der eine Option veräußert, hat keine Kontrolle darüber, ob das Basisinstrument ein Call oder Put ist, und im Ergebnis trägt er das Marktrisiko einer ungünstigen Kursänderung des Instruments, das der Verkaufsoption zugrunde liegt. Es besteht das Risiko, dass sich der Fonds aufgrund eines illiquiden Marktes eventuell nicht in der Lage sieht, die Transaktion glattzustellen.

Ein Fonds darf ebenfalls Verkaufs- und Kauf-Optionen erwerben. Der Kauf von Verkaufsoptionen neigt dazu, das Fondsrisiko gegenüber den zugrunde liegenden Instrumenten zu erhöhen. Der Kauf von Kaufoptionen neigt dazu, das Fondsrisiko gegenüber den zugrunde liegenden Instrumenten zu senken. Ein Fonds zahlt eine Prämie, die ergebniswirksam zum Marktwert als Finanzvermögen in den Finanzstatus einfließt, und später neu bewertet wird, um den aktuellen Wert der Option wiederzugeben. Gezahlte Prämien für den Kauf von Optionen, die auslaufen, werden als realisierte Verluste verbucht. Bestimmte Optionen dürfen mit Prämien gekauft werden, die zu einem zukünftigen Datum bestimmt werden. Die Prämien für diese Optionen basieren auf implizierten Volatilitätsparametern zu bestimmten Bedingungen. Das mit dem Kauf von Verkaufs- und Kaufoptionen verbundene Risiko beschränkt sich auf die gezahlte Prämie. Gezahlte Prämien aus dem Kauf von Optionen, die ausgeübt oder glattgestellt werden, sind den gezahlten Beträgen hinzuzufügen oder gegen die Erlöse aus dem Basisanlagegeschäft aufzurechnen, um den realisierten Gewinn oder Verlust bei Ausführung der zugrunde liegenden Transaktion zu bestimmen.

**Credit Default Swaptions** Bestimmte Fonds können Credit Default Swaptions kaufen oder verkaufen, um eine Absicherung des Kreditrisikos einer Anlage zu erreichen, ohne sich dem Basiswert gegenüber zu verpflichten. Eine Credit Default Swaption ist eine Option zum Verkauf oder Kauf von Kreditschutz für einen bestimmten Referenzwert durch Abschluss eines vordefinierten Swaps zu einem bestimmten zukünftigen Zeitpunkt.

**Devisenoptionen** Bestimmte Fonds können Devisenoptionen verkaufen oder kaufen. Durch den Verkauf oder Kauf von Devisenoptionen erhält ein Fonds das Recht, ist jedoch nicht verpflichtet, die festgelegten Devisenbeträge zu einem Wechselkurs zu kaufen oder zu verkaufen, der zu einem bestimmten Datum geltend gemacht werden kann. Diese Optionen können als Kauf- oder Verkaufsdeckungsgeschäft gegen mögliche Schwankungen der Wechselkurse oder zum Aufbau eines Engagements in Devisen dienen.

**Inflation-Capped Options** Bestimmte Fonds können Inflation-Capped Options kaufen oder verkaufen, um die Renditen zum Zwecke von Absicherungsmöglichkeiten zu erhöhen. Veräußert ein Fonds eine Inflation-Capped Option, dann erfasst er einen Betrag, der der erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit und bewertet diese zum letzten Börsenkurs, um den aktuellen Wert der verkauften Option wiederzugeben. Kauft ein Fonds eine Inflation-Capped Option, bezahlt der Fonds eine Prämie, die als Vermögenswert ausgewiesen und dann zum letzten Börsenkurs bewertet wird, um den aktuellen Wert der Option wiederzugeben. Der Kauf von Inflation-Capped Options soll einen Fonds vor Inflationserosion über einem bestimmten Satz aus einer bestimmten angenommenen Beteiligung schützen. Zum Schutz von Anlagen in inflationsgekoppelten Produkten kann eine Untergrenze (Floor) verwendet werden.

**Interest Rate-Capped Options** Bestimmte Fonds können Interest Rate-Capped Options kaufen oder verkaufen, um die Renditen zum Zwecke von Absicherungsmöglichkeiten zu erhöhen. Veräußert ein Fonds eine Interest Rate-Capped Option, dann erfasst er einen Betrag, der der erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit und bewertet diese zum letzten Börsenkurs, um den aktuellen Wert der verkauften Option wiederzugeben. Kauft ein Fonds eine Interest Rate-Capped Option, bezahlt der Fonds eine Prämie, die als Vermögenswert ausgewiesen und dann zum letzten Börsenkurs bewertet wird, um den aktuellen Wert der Option wiederzugeben. Der Kauf von Interest Rate-Capped Options soll einen Fonds vor dem Risiko variabler Zinssätze oberhalb eines bestimmten Satzes aus einer bestimmten angenommenen Beteiligung schützen. Zum Schutz von Anlagen in zinsgekoppelten Produkten kann eine Untergrenze (Floor) verwendet werden.

**Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte** Bestimmte Fonds können Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte („Futures Option“) kaufen oder verkaufen, um eine vorhandene Position oder künftige Investments abzusichern, zu Spekulationszwecken oder zur Verwaltung des Risikos im Zusammenhang mit Marktschwankungen. Eine Futures Option ist ein Optionskontrakt, dessen Basiswert ein einziger Futures-Kontrakt ist.

**Optionen auf Rohstoffterminkontrakte** Bestimmte Fonds können Optionen auf Rohstoffterminkontrakte („Rohstoffoptionen“) verkaufen oder kaufen. Der Basiswert für die Rohstoffoption ist nicht der Rohstoff selbst, sondern vielmehr ein Terminkontrakt auf den Rohstoff. Zur Ausübung einer Rohstoffoption gehört nicht die tatsächliche Lieferung des zugrunde liegenden Rohstoffs, sondern vielmehr die Zahlung des Differenzbetrags zwischen dem aktuellen Marktwert des zugrunde liegenden Futures Contract und dem Ausübungskurs direkt auf das Verwahrstellenkonto eines Fonds. Bei Optionen, die „im Geld“ sind, wird ein Fonds normalerweise die Position ausgleichen, anstatt die Option auszuüben, um den Restzeitwert zu wahren.

**Barriere-Optionen** Bestimmte Fonds können eine Vielzahl von Optionen mit nicht standardmäßigen Auszahlungsstrukturen oder anderen Merkmalen („Barriere-Optionen“) verkaufen oder kaufen. Barriere-Optionen werden allgemein außerbörslich gehandelt. Ein Fonds kann in verschiedene Arten von Barriere-Optionen investieren, unter anderem auch in Down-and-in- sowie in Up-and-in-Optionen. Down-and-in- und Up-and-in-Optionen sind standardmäßigen Optionen ähnlich. Der wesentliche Unterschied besteht darin, dass die Option für den Käufer der Option wertlos ausläuft, wenn der Kurs des zugrundeliegenden Instruments vor dem Ablaufdatum der Option einen bestimmten Barriere-Kurs erreicht bzw. nicht erreicht.

**Zins-Swaptions** Bestimmte Fonds können Zins-Swaptions eingehen, wobei es sich um Optionen zum Abschluss vordefinierter Swap-Vereinbarungen zu einem bestimmten zukünftigen Zeitpunkt handelt. Der Verkäufer der Swaption wird bei Ausübung durch die Käufer zum Kontrahenten des Swaps. Aus der Zinsswaption geht hervor, ob der Käufer der Swaption bei Ausübung ein Empfänger eines festen Zinssatzes ist oder einen festen Zinssatz bezahlt.

**Optionen auf Wertpapiere** Bestimmte Fonds können Optionen auf Wertpapiere eingehen. Eine Option verwendet ein bestimmtes Wertpapier als Basiswert für den Optionskontrakt. Ein Fonds kann Optionen verkaufen oder kaufen, um Einkommen zu erzielen oder um eine vorhandene Position oder zukünftige Anlage abzusichern.

**Straddle-Optionen** Bestimmte Fonds können verschiedene Formen von Straddle-Optionen („Straddle“) verwenden. Bei einem Straddle handelt es sich um eine Anlagestrategie, die Kombinationen aus Optionen einsetzt, die es dem Fonds ermöglichen, auf der Basis zukünftiger Preisschwankungen (nach oben oder unten) des zugrunde liegenden Wertpapiers zu profitieren. Ein verkaufter Straddle umfasst den gleichzeitigen Verkauf einer Kaufoption und einer Verkaufsoption auf dasselbe Wertpapier zum selben Ausübungskurs und mit demselben Verfallsdatum. Der verkaufte Straddle erhöht sich im Wert, wenn der Preis des Basiswerts vor dem Verfallsdatum nur geringfügig schwankt. Ein gekaufter Straddle umfasst den gleichzeitigen Kauf einer Kaufoption und einer Verkaufsoption auf dasselbe Wertpapier zum selben Ausübungskurs und mit demselben Verfallsdatum. Der

gekaufte Straddle erhöht sich im Wert, wenn der Preis des Basiswerts ungeachtet der Richtung vor dem Verfallsdatum stark schwankt.

**(d) Swaps** Bestimmte Fonds dürfen in Swaps anlegen. Swaps sind bilateral verhandelte Vereinbarungen zwischen einem Fonds und einem Kontrahenten, um Anlagekapitalflüsse, Vermögenswerte, Devisen oder marktgebundene Erträge zu bestimmen, zukünftigen Intervallen zu wechseln oder zu tauschen. Swaps werden privat im Freiverkehr (OTC-Swaps) verhandelt und können auf einer multilateralen- oder anderen Handelsplattform, z. B. an einer registrierten Börse („zentral abgerechnete Swaps“) ausgeübt werden. Ein Fonds darf Asset-Swaps, Credit Default Swaps, Cross Currency Swaps, Zinsswaps, Total Return Swaps, Variance Swaps sowie andere Arten von Swaps eingehen, um sein Kredit-, Währungs-, Zins-, Rohstoff-, Aktien- und Inflationsrisiko zu verwalten. In Verbindung mit diesen Vereinbarungen können Wertpapiere oder Barmittel in Übereinstimmung mit den Bedingungen des jeweiligen Swaps zu Sicherheiten oder Hinterlegungssummen bestimmt werden, um bei Säumnis oder Konkurs/Insolvenz auf werthaltige Vermögenswerte zurückgreifen zu können.

Zentral abgerechnete Swaps werden täglich an den Marktwert angepasst. Hierbei werden Bewertungen angesetzt, die gemäß dem zugrundeliegenden Kontrakt oder gemäß den Anforderungen des zentralen Kontrahenten bzw. der Clearingorganisation für Derivate ermittelt werden. Änderungen des Marktwerts werden, falls vorhanden, in der Betriebsergebnisrechnung als Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) erfasst. Tägliche Änderungen bei der Bewertung zentral abgerechneter Swaps („Swap Variation Margin“), falls vorhanden, werden im Finanzstatus als Forderung oder Verbindlichkeit aus Wertänderungen ausgewiesen. Zu Beginn des Berichtszeitraums geleistete oder erhaltene Zahlungen aus OTC Swaps werden als solche im Finanzstatus ausgewiesen und repräsentieren Prämien, die bei Abschluss des Swaps als Ausgleich für Differenzen zwischen den vereinbarten Bedingungen des Swaps und der vorherrschenden Marktbedingungen (Kreditspreads, Wechselkurse, Zinssätze und andere relevante Faktoren) gezahlt oder vereinnahmt wurden. Erhaltene (gezahlte) Abschlussprämien werden anfänglich als Verbindlichkeiten (Vermögenswerte) verbucht und anschließend zum letzten Börsenkurs bewertet, um den aktuellen Wert des Swaps wiederzugeben. Diese Abschlussprämien werden bei Beendigung oder Fälligkeit des Swaps in der Betriebsergebnisrechnung als realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen. Bei Beendigung eines Swaps erhaltene oder geleistete Liquidierungszahlungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als realisierter Gewinn oder Verlust erfasst. Vom Fonds regelmäßige erhaltene oder geleistete Nettoszahlungen werden als Teil der realisierten Gewinne oder Verluste in die Betriebsergebnisrechnung einbezogen.

Zur Anwendung bestimmter Anlagerichtlinien und -beschränkungen des Fonds können Swaps wie andere derivative Instrumente vom Fonds zum Marktwert, zum Nennwert oder zum vollständigen Engagementwert bewertet werden. Im Fall eines Credit Default Swap (siehe unten) bewertet der Fonds den Credit Default Swap jedoch bei der Anwendung bestimmter Anlagerichtlinien und -beschränkungen des Fonds zum Nennwert bzw. zum vollständigen Engagementwert (d. h. mit der Summe aus dem Nennbetrag für den Kontrakt und dem Marktwert). Für die Anwendung bestimmter sonstiger Anlagerichtlinien und -beschränkungen des Fonds kann er den Credit Default Swap jedoch zum Marktwert bewerten. So kann ein Fonds Credit Default Swaps beispielsweise für Zwecke seiner (gegebenenfalls geltenden) Richtlinien hinsichtlich der Kreditqualität zum vollständigen Engagementwert bewerten, da dieser Wert das tatsächliche wirtschaftliche Engagement des Fonds während der Laufzeit des Credit Default Swaps darstellt. In diesem Zusammenhang können sowohl der Nennbetrag als auch der Marktwert positiv oder negativ sein - je nachdem, ob der Fonds Schutz über den Credit Default Swap verkauft oder kauft. Die Art und Weise, in der bestimmte Wertpapiere oder sonstige Instrumente vom Fonds zur Anwendung von Anlagerichtlinien und -beschränkungen bewertet werden, kann von der Art und Weise abweichen, in der diese Anlagen von anderen Arten von Anlegern bewertet werden.

Der Abschluss dieser Vereinbarungen umfasst in unterschiedlichem Ausmaß Elemente von Zins-, Kredit-, Markt- und Dokumentationsrisiken enthalten, die über den im Finanzstatus enthaltenen Umfang hinausgehen. Diese Risiken beinhalten die Möglichkeit, dass kein liquider Markt für diese Vereinbarungen existiert, dass der Kontrahent dieser Vereinbarungen seinen Pflichten nicht nachkommt oder die Vertragsbedingungen anders auslegt und dass ungünstige Zinsentwicklungen auftreten können.

Das maximale Verlustrisiko eines Fonds aus dem Kontrahentenkreditrisiko entspricht dem diskontierten Nettowert der während der Vertragsrestlaufzeit vom Kontrahenten zu erhaltenden Kapitalflüsse, falls dieser Betrag positiv ist. Das Risiko wird von einer Rahmenaufrechnungsvereinbarung zwischen einem Fonds und dem Kontrahenten abgeschwächt, sowie durch die Stellung von Sicherheiten für einen Fonds, um das Kontrahentenrisiko eines Fonds abzudecken.

**Korrelationswaps** Bestimmte Fonds dürfen in Korrelationswaps anlegen, um Engagements in die Basisreferenzwerte einzugehen oder die damit verbundenen Risiken zu reduzieren. Bei Korrelationswaps vereinbaren zwei Parteien den Tausch von Kapitalflüssen auf Basis der gemessenen Korrelation bestimmter Basisreferenzwerte. Eine Partei stimmt zu, eine „feste Zinszahlung“ oder eine Zahlung zum Ausübungskurs für den „variablen Zinssatz“ oder die realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts gegenüber dem Nennbetrag zu tauschen. Bei Auflegung wird der Ausübungskurs allgemein so gewählt, dass der Marktwert des Swaps bei Null liegt. Zum Fälligkeitsdatum wird ein Nettokapitalfluss getauscht, wobei der Auszahlungsbetrag der Differenz zwischen der realisierten Kurskorrelation des Basisvermögenswerts und dem Ausübungskurs multipliziert mit dem Nennbetrag entspricht. Als Empfänger der Kurskorrelation mit fester Zinszahlung würde der Fonds den Auszahlungsbetrag erhalten, wenn die realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts unter dem Ausübungskurs liegt und würde den Auszahlungsbetrag schulden, wenn die Korrelation über dem Ausübungskurs liegt. Als Zahler der Kurskorrelation mit fester Zinszahlung würde der Fonds den Auszahlungsbetrag schulden, wenn die realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts unter dem Ausübungskurs liegt und würde den Auszahlungsbetrag erhalten, wenn die Korrelation über dem Ausübungskurs liegt. Diese Art von Vereinbarung ist im Grunde ein Terminkontrakt auf die zukünftig realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts.

**Credit Default Swaps** Bestimmte Fonds dürfen Credit Default Swaps auf Unternehmensanleihen, Darlehen, Staatsanleihen, US-Kommunalanleihen oder US-Schatzpapiere zur Absicherung gegen den Zahlungsausfall von Emittenten einsetzen (d. h. um das Risiko zu senken, wenn ein Fonds Beteiligungen an der Referenzobligation besitzt oder ihrem Risiko ausgesetzt ist) oder um eine aktive Long- oder Short-Position in Bezug auf die Wahrscheinlichkeit des Verzugs eines bestimmten Emittenten einzugehen. Bei Credit Default Swaps nimmt eine Partei (der „Sicherungsnehmer“) eine Reihe von Zahlungen an eine andere Partei (der „Sicherungsgeber“) gegen das Recht vor, einen bestimmten Ertrag zu erhalten, wenn es bei der Referenzeinheit, der referenzierten Obligation oder dem referenzierten Index, wie im jeweiligen Swap angegeben, zu einem bestimmten Kreditereignis kommt. Als Sicherungsgeber in Credit Default Swaps erhält der Fonds gewöhnlich vom Sicherungsnehmer einen festen Einkommenssatz während der Laufzeit des Swaps, vorausgesetzt, es tritt kein Kreditereignis ein. Als Verkäufer würde ein Fonds seinem Portfolio effektiv Fremdfinanzierung hinzufügen, da zusätzlich zu seinen Gesamtvermögenswerten der Fonds dem Anlagerisiko auf den Nennbetrag des Swaps unterliegen würde.

Tritt der Fonds als Sicherungsgeber auf und tritt ein Kreditereignis ein, das in den Bedingungen dieses bestimmten Swaps festgelegt ist, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag bis zum Nominalwert des Swaps und übernimmt, in bestimmten Fällen, das Liefern der referenzierten Verbindlichkeit, einer anderen zu liefernden Obligation oder des Basiswertpapiers, das im referenzierten Index enthalten ist, oder (ii) zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nominalbetrag des Swaps abzüglich des Rückerlangungswerts der referenzierten Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im referenzierten Index enthalten ist, entspricht. Tritt der Fonds als Sicherungsnehmer auf und tritt ein Kreditereignis ein, das in den Bedingungen dieses bestimmten Swaps festgelegt ist, erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nominalwert des Swaps entspricht, und übernimmt die Lieferung der referenzierten Verbindlichkeit, einer anderen zu liefernden Obligation oder des Basiswertpapiers, das im referenzierten Index enthalten ist, oder (ii) erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nominalbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der referenzierten Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im dem referenzierten Index enthalten ist. Die Restwerte werden von Primärhändlern geschätzt, indem sie entweder branchenübliche Restwerte oder für die Einheit typische Größen und Erwägungen berücksichtigen, bis ein Kreditereignis eintritt. Sobald ein Kreditereignis eingetreten ist, werden die Restwerte mittels einer gestützten Auktion bestimmt, wobei eine Mindestanzahl zulässiger Maklergebote gemeinsam mit einer vorgeschriebenen Bewertungsmethode zur Bestimmung des Abwicklungswerts benutzt werden. In der Lage zu sein, andere Obligationen zu liefern, kann zu einer CTD-Option (das Recht des Sicherungsnehmers, die zu liefernde Obligation mit dem geringsten Wert nach einem Kreditereignis zu liefern) führen.

Credit Default Swaps auf Kreditindizes beinhalten, dass eine Partei einen Zahlungsfluss an einer andere Partei im Gegenzug für das Recht vornimmt, im Fall einer Wertberichtigung, von Mindereinnahmen für Kapital oder Zinsen oder Zahlungsunfähigkeit aller oder eines Teils der Referenzeinheiten, aus denen der Kreditindex besteht, einen bestimmten Ertrag zu erhalten. Bei einem Kreditindex handelt es sich um einen Korb von Kreditinstrumenten- oder Engagements, die einen Teil des Kreditmarkts als Ganzes verkörpern. Diese Indizes bestehen aus Referenzkrediten, die mittels Umfrage von Händlern von diesen als die liquiden Titel unter den Credit Default Swaps basierend auf dem Bereich des Index bestimmt werden. Indexkomponenten können insbesondere Wertpapiere mit Investment Grade-Rating, hoch rentierliche Wertpapiere, forderungsbesicherte Wertpapiere, Schwellenmärkte und/oder unterschiedliche Kredit-Ratings innerhalb des jeweiligen Bereichs enthalten. Kreditindizes werden mithilfe von Credit Default Swaps zu standardisierten Bedingungen einschließlich eines festen Spreads und Standardfälligkeiten gehandelt. Ein Index Credit Default Swap bezieht sich auf alle Namen im Index, und bei Zahlungsverzug wird das Kreditereignis auf Basis der Gewichtung des entsprechenden Namens im Index beglichen. Die Zusammensetzung der Indizes ändert sich regelmäßig, gewöhnlich alle sechs Monate, und bei den meisten Indizes verfügt jeder Name über die gleiche Gewichtung im Index.

Der Fonds darf Credit Default Swaps auf Kreditindizes einsetzen, um ein Portfolio von Credit Default Swaps oder -anleihen abzusichern, der nicht so teuer ist wie der Kauf zahlreicher Credit Default Swaps, um einen ähnlichen Effekt zu erreichen. Credit Default Swaps auf Indizes sind Instrumente, die Anleger, die Anleihen besitzen, gegen Zahlungsausfall schützen sollen. Sie werden von Wertpapierhändlern genutzt, um auf Änderungen der Kreditqualität zu spekulieren.

Auf absoluter Grundlage dargestellte, implizite Kreditspreads, die zum Ende des Geschäftsjahres zur Bestimmung des Marktwerts von Credit Default Swaps für Unternehmensanleihen, Darlehen, Staats- oder US-Kommunalanleihen verwendet werden, werden in der Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen. Sie dienen als Indikator für den gegenwärtigen Status des Zahlungs-/Performancerisikos und stellen die Wahrscheinlichkeit oder das Risiko eines Ausfalls für das Kreditderivat dar. Der implizite Kreditspread einer bestimmten Referenzeinheit reflektiert die Kosten von Schutzkäufen/-verkäufen und kann Vorauszahlungen beinhalten, die zum Abschluss der Vereinbarung geleistet werden müssen. Größere Kreditspreads repräsentieren einen Rückgang der Bonität der Referenzeinheit und eine größere Wahrscheinlichkeit oder ein größeres Risiko für einen Ausfall oder den Eintritt eines anderen Kreditereignisses, wie in den Vereinbarungsbedingungen definiert. Bei Credit Default Swaps für forderungsbesicherte Wertpapiere und Kreditindizes dienen die notierten Marktpreise und die sich daraus ergebenden Werte als Indikator des gegenwärtigen Status des Zahlungs-/Performancerisikos. Eine Erhöhung der Marktwerte auf absoluter Basis im Vergleich mit dem nominellen Betrag des Swaps repräsentieren einen Rückgang der Bonität der Referenzeinheit und eine größere Wahrscheinlichkeit oder ein größeres Risiko für einen Ausfall oder den Eintritt eines anderen Kreditereignisses, wie in den Vereinbarungsbedingungen definiert.

Der maximal mögliche Betrag (nicht abgezinst), den ein Fonds als Sicherungsgeber/Sicherungsnehmer zukünftig unter einem Credit Default Swap eventuell zahlen muss, entspricht dem Nennbetrag der Vereinbarung. Die Nennbeträge aller zum 31. Dezember 2020 ausstehender Credit Default Swaps des Fonds als Sicherungsgeber/-nehmer werden in der Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen. Diese potenziellen Beträge würden teilweise von vorhandenen Restwerten der jeweiligen referenzierten Obligationen, von beim Abschluss der Vereinbarung erhaltenen Vorauszahlungen oder von bei der Abwicklung von Credit Default Swaps (mit dem Fonds in der Position des Sicherungsnehmers), erhaltenen Nettobeträgen ausgeglichen, die der Fonds für die gleiche(n) Referenzeinheit(en) einget.

**Währungsswaps** Bestimmte Fonds können Währungsswap-Vereinbarungen eingehen, um Devisenengagements einzugehen oder die damit verbundenen Risiken zu reduzieren. Währungsswap-Vereinbarungen beinhalten zwei Parteien, die zwei unterschiedliche Währungen mit einer Vereinbarung tauschen, den Tausch zu einem späteren Zeitpunkt zu festgelegten Tauschsätzen umzukehren. Der Tausch von Währungen zum Auflegungsdatum des Kontrakts findet zum aktuellen Kassakurs statt. Der Rücktausch bei Fälligkeit kann zum selben Wechselkurs, zu einem bestimmten Kurs oder zu dem zu diesem Zeitpunkt aktuellen Kassakurs erfolgen. Ggf. zu leistende Zinszahlungen erfolgen zwischen den Parteien auf Basis von Zinssätzen, die in den beiden Währungen zum Auflegungsdatum des Kontrakts zur Verfügung stehen. Die Laufzeiten für Währungsswaps können sich über viele Berichtszeiträume erstrecken. Währungsswaps werden gewöhnlich mit Geschäfts- und Anlagebanken verhandelt. Einzelne Cross Currency Swaps sehen eventuell keinen Tausch von Kapitalbarmittelflüssen vor, sondern ausschließlich den Tausch von Zinsbarmittelflüssen. Der Tausch von Währungen zum Auflegungsdatum wird separat auf Bruttobasis im Finanzstatus ausgewiesen, wobei der Nennbetrag in der Hauptwährung für die fest- bzw. variabel verzinsliche Komponente jeweils als Forderung bzw. Verbindlichkeit erfasst wird.

Bei Absicherungen von Anteilsklassen werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschließlich den betreffenden Anteilsklassen zugeordnet. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste sind in den Finanzderivaten im Finanzstatus ausgewiesen. Im Zusammenhang mit diesen Verträgen können Wertpapiere in Übereinstimmung mit den Bedingungen der jeweiligen Verträge zu Sicherheiten bestimmt werden.

**Zinsswaps** Bestimmte Fonds unterliegen bei der Realisierung ihres Anlageziels einem Zinsrisiko. Da ein Fonds festverzinsliche Anleihen hält, kann der Wert dieser Anleihen sinken, wenn die Zinssätze steigen. Um die Absicherung gegen dieses Risiko zu unterstützen und seine Fähigkeit aufrecht zu erhalten, Einkünfte zu marktüblichen Zinssätzen zu erzielen, darf der Fonds Zinsswaps eingehen. Bei Zinsswaps tauscht der Fonds mit einer anderen Partei deren jeweilige Zinszahlungsverpflichtungen auf den Kapitalnennbetrag. Bestimmte Arten von Zinsswaps können Folgendes beinhalten: (i) Zinssatz-Obergrenzen, bei denen eine Partei zustimmt, gegen eine Prämie in dem Fall Zahlungen an die andere vorzunehmen, dass die Zinssätze einen bestimmten Satz oder eine bestimmte „Obergrenze“ überschreiten, (ii) Zinssatzuntergrenzen, bei denen eine Partei gegen eine Prämie zustimmt, in dem Fall Zahlungen an die andere vorzunehmen, dass die Zinssätze unter einen bestimmten Satz oder „Untergrenze“ fallen, (iii) Zinssatz-Ober- und -Untergrenzen, bei denen eine Partei eine Obergrenze veräußert und eine Untergrenze erwirbt oder umgekehrt, um sich selbst gegen Zinssatzbewegungen zu schützen, die bestimmte Mindest- oder Höchstsätze überschreiten, (iv) abrufbare Zinsswaps, bei denen der Kontrahent die Swaptransaktion als Ganzes zu Nullkosten und zu einem bestimmten Datum und zu einem Zeitpunkt vor dem Fälligkeitsdatum beenden darf, (v) Spreadsperrn, die es dem Zinsswapverwender erlauben, das Termindifferential (oder den Spread) zwischen dem Zinsswapsatz und einem bestimmten Benchmark festzuschreiben, oder (vi) Basiswaps, bei denen zwei Parteien variable Zinssätze tauschen, die auf unterschiedlichen Geldmärkten basieren.

**Total Return Swaps** Bestimmte Fonds dürfen Total Return Swaps eingehen. Total Return Swaps auf Rohstoffe enthalten Verpflichtungen, bei denen Barmittel auf Basis von Rohstoffkursen gegen entweder feste oder variable Kurse oder Zinssätze getauscht werden. Eine Partei würde in diesem Fall Zahlungen auf Basis des Marktwerts des beteiligten Rohstoffs erhalten und einen festen Betrag zahlen. Total Return Swaps auf Indizes enthalten Verpflichtungen zur Zahlung von Zinsen im Tausch gegen einen marktgebundenen Ertrag. Ein Kontrahent zahlt den Gesamtertrag eines bestimmten Referenzvermögenswerts aus. Dabei kann es sich um eine Aktie, einen Index oder eine Anleihe handeln. Im Gegenzug erhält er regelmäßige Zahlungsflüsse. In dem Umfang, in dem der Gesamtertrag eines Basiswertpapiers oder -index die Abwicklungszinsverpflichtung übertrifft oder unterschreitet, erhält der Fonds eine Zahlung vom Kontrahenten bzw. leistet eine Zahlung an den Kontrahenten.

Bestimmte Fonds dürfen in Total Return Equity Swaps („Aktienwaps“) anlegen. Aktienwaps können eingesetzt werden, um einen Gewinn abzusichern oder um einen Verlust zu vermeiden, der aus Schwankungen im Wert oder Kurs von Aktien oder Finanzinstrumenten oder einem Index aus diesen Aktien oder Finanzinstrumenten herrührt. Bei einem Aktienwap handelt es sich um ein derivatives Instrument, das die wirtschaftliche Wertentwicklung und den Kapitalfluss einer traditionellen Aktienanlage nachbilden soll.

Das Aktienwaps eigene Risiko hängt von der Position eines Fonds bei einer Transaktion ab: wenn ein Fonds Aktien-Swaps einsetzt, kann er sich in eine Long Position zum Basiswert bringen. In diesem Fall profitiert der Fonds von allen Wertzuwächsen der Basisaktie und erleidet jede Wertabnahme. Die einer Long Position eigenen Risiken gleichen den mit dem Kauf der Basisaktie einhergehenden Risiken. Umgekehrt kann sich der Fonds in eine Short Position zum Wert der Basisaktie bringen. In diesem Fall profitiert der Fonds von allen Kursverfällen der Basisaktie und erleidet Verluste aus etwaigen Kurszuwächsen. Die mit einer Short Position einhergehenden Risiken sind größer als die einer Long Position: Während es bei einer Long Position einen maximalen Höchstverlust gibt, wenn die Basisaktie mit null bewertet wird, entspricht der maximale Verlust aus einer Short Position der Wertzunahme der Basisaktie. Diese Zunahme ist theoretisch unbegrenzt.

Allerdings ist anzumerken, dass die Short bzw. Long Position eines Aktienwaps auf dem Urteil der Anlageberatungsgesellschaften über die zukünftige Richtung des Basiswertpapiers beruht. Die Position könnte sich nachteilig auf die Wertentwicklung des Fonds auswirken.

**Volatilitäts-Swapvereinbarungen** sind auch als auch Forward-Volatility-Agreement bekannt und sind Vereinbarungen, in deren Rahmen sich die Kontrahenten zu Zahlungen im Zusammenhang mit Veränderungen der Volatilität (d. h. des Ausmaßes der Veränderungen innerhalb eines festgelegten Zeitraums) eines zugrunde liegenden referenzierten Instruments verpflichten, beispielsweise einer Währung, eines Zinssatzes, eines Index, eines Wertpapiers oder eines anderen Finanzinstruments. Volatilitätsswaps gestatten den Parteien den Versuch, das Volatilitätsrisiko abzusichern und/oder Positionen in der prognostizierten künftigen Volatilität eines zugrunde liegenden referenzierten Instruments einzugehen. Der Fonds kann beispielsweise einen Volatilitätsswap eingehen, um eine Position darauf zu bilden, dass die Volatilität des

referenzierten Instruments über einen bestimmten Zeitraum steigen wird. Wenn die Volatilität des referenzierten Instruments in dem festgelegten Zeitraum steigt, erhält der Fonds von dem Kontrahenten eine Zahlung auf Basis des Betrags, um den die realisierte Volatilität des referenzierten Instruments ein zwischen den Parteien vereinbartes Volatilitätsniveau übersteigt. Wenn die Volatilität des referenzierten Instruments in dem festgelegten Zeitraum nicht steigt, leistet der Fonds an den Kontrahenten eine Zahlung auf Basis des Betrags, um den die realisierte Volatilität des referenzierten Instruments unter das zwischen den Parteien vereinbarte Volatilitätsniveau sinkt. Zum Fälligkeitsdatum wird ein Nettokapitalfluss getauscht, wobei der Auszahlungsbetrag der Differenz zwischen der realisierten Kursvolatilität des referenzierten Instruments und dem Ausübungskurs multipliziert mit dem Nennbetrag entspricht. Als Empfänger der realisierten Preisvolatilität erhält der Fonds den Auszahlungsbetrag, wenn die realisierte Kursvolatilität des referenzierten Instruments höher ist als der Strike, bzw. muss den Auszahlungsbetrag zahlen, wenn die Volatilität niedriger ist als der Strike. Als Zahler der realisierten Preisvolatilität muss der Fonds den Auszahlungsbetrag zahlen, wenn die realisierte Kursvolatilität des referenzierten Instruments höher ist als der Strike, bzw. erhält den Auszahlungsbetrag, wenn die Volatilität niedriger ist als der Strike. Zahlungen auf einen Volatilitätsswap sind höher, wenn sie auf dem mathematischen Quadrat der Volatilität beruhen (d. h. der mit sich selbst multiplizierten gemessenen Volatilität, als „Varianz“ bezeichnet). Diese Art von Volatilitätsswap wird häufig als Varianzswap bezeichnet.

## 7. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Innerhalb der durch die Anlageziele und Anlagepolitik der Fonds und nach Maßgabe der von der Zentralbank jeweils festgesetzten Grenzen und des laut Prospektbestimmungen erlaubten Umfangs sind die Finanzderivate und Anlagetechniken von allen Fonds für eine effiziente Portfolioverwaltung einzusetzen. Die Fonds 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 Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt USD 12.441.819/(USD 1.566.978) (31. Dezember 2019: USD 81.178.685/(USD 1.632.754)).

Der durch die umgekehrten Pensionsgeschäfte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt USD 11.891.760/(USD 115.404.360) (31. Dezember 2019: USD 2.601.572/(USD 217.007.735)).

Der durch die Sale-Buyback-Geschäfte im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2020 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt USD 88.246/(USD 3.929.767) (31. Dezember 2019: USD 124.010/(USD 18.342.106)).

## 8. BESTEUERUNG

Nach geltendem Recht und herrschender Praxis qualifiziert sich die Gesellschaft als Investmentgesellschaft gemäß Definition in § 739B des Taxes Consolidation Act von 1997 in seiner jeweils geltenden Fassung, solange sie in Irland ansässig ist. Auf dieser Basis ist sie für ihre Erträge und Kapitalgewinne in Irland nicht steuerpflichtig. Bei Eintritt eines „steuerpflichtigen Ereignisses“ kann jedoch in Irland eine Steuer anfallen. Ein steuerpflichtiges Ereignis schließt alle Ausschüttungszahlungen an Anteilinhaber und alle Einlösungen, Rücknahmen, Stornierungen, Übertragungen oder fiktive Veräußerung (eine fiktive Veräußerung tritt bei Ablauf eines entsprechenden Zeitraums ein) von Anteilen sowie die Vereinnahmung oder Löschung von Anteilen eines Anteilinhabers durch die Gesellschaft, um den auf einen sich aus einer Übertragung ergebenden Gewinn zu zahlenden Steuerbetrag zu begleichen.

Die Gesellschaft unterliegt in Irland keiner Steuer bei steuerpflichtigen Ereignissen mit Bezug auf:

- Anteilinhaber, die im steuerlichen Sinne zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses nicht in Irland ansässig oder gewöhnlich ansässig sind, vorausgesetzt, dass dem Fonds die erforderlichen, unterzeichneten Erklärungen gemäß den Bestimmungen des Taxes Consolidation Act, 1997 in seiner jeweils geltenden Fassung vorliegen, dem Fonds keine Informationen vorliegen, die in angemessener Weise darauf hindeuten, dass die entsprechenden darin enthaltenen Angaben sachlich nicht mehr zutreffen sind, oder der Fonds von der irischen Steuerbehörde bevollmächtigt wurde, mangels entsprechender Erklärungen Brutto-Zahlungen vorzunehmen;
- bestimmte steuerbefreite, in Irland ansässige Anleger, die der Gesellschaft die erforderlichen, unterzeichneten gesetzlichen Erklärungen vorgelegt haben.
- bei Transaktionen in Bezug auf Anteile, die in einem von den Revenue Commissioners benannten anerkannten Clearingsystem gehalten werden;
- eines Tausches von Anteilen eines Teilfonds in Anteile eines anderen Teilfonds des Fonds;

(e) es zu einem Austausch von Anteilen auf Grund einer qualifizierenden Verschmelzung oder Restrukturierung des Fonds mit einem anderen Fonds kommt; und

(f) bestimmter Formen des Anteilaustausches zwischen Ehegatten und ehemaligen Ehegatten.

Wurde keine angemessene Erklärung vorgelegt, unterliegt der Fonds bei Eintritt eines Steuertatbestandes der irischen Steuer.

Vorbehaltlich der Einhaltung der „entsprechenden Maßnahmen“ sieht der Finance Act von 2010 vor, dass die Finanzkommissare es Investmentfonds, die außerhalb Irlands vertrieben werden, genehmigen dürfen, Zahlungen an nicht in Irland wohnhafte Anteilinhaber vorzunehmen, ohne irische Steuern einzubehalten, wenn keine entsprechende Erklärung vorliegt. Ein Fonds, der zugelassen werden möchte, muss dies schriftlich bei den Finanzkommissaren beantragen und die Einhaltung der betreffenden Bedingungen bestätigen.

Dividenden, Zinsen und Kapitalerträge (soweit zutreffend), die der Gesellschaft hinsichtlich ihrer Anlagen (mit Ausnahme von Wertpapieren irischer Emittenten) zufließen, können in den Ländern, in denen sich die Emittenten der Anlagen befinden, steuerpflichtig sein und unter anderem der Quellensteuer unterliegen. Es ist davon auszugehen, dass die Gesellschaft keinen Anspruch auf reduzierte Quellensteuersätze nach den Doppelbesteuerungsabkommen zwischen Irland und diesen Ländern hat. Falls sich diese Rechtslage ändert und die Anwendung eines reduzierten Steuersatzes zu Steuererstattungen an die Gesellschaft führt, werden die Nettoinventarwerte nicht rückwirkend geändert. Vielmehr wird die Erstattung anteilig auf die zum Zeitpunkt der Erstattung bestehenden Anteilinhaber verteilt.

In Übereinstimmung mit dem von der britischen Steuerbehörde United Kingdom HM Revenue and Customs eingeführten, neuen Regelwerk für Reporting Funds wird jede einzelne Anteilklasse zu Zwecken der Besteuerung in Großbritannien als eigenständiger „Offshore-Fonds“ betrachtet. Das Regelwerk für Reporting Funds lässt zu, dass ein Offshore-Fonds beim HM Revenue and Customs vorab um Zulassung für die Behandlung als „Reporting Fund“ ersuchen kann. Sobald ein Offshore-Fonds den Status eines Reporting Fund erhalten hat, behält er diesen Status, so lange er die Bedingungen für einen Reporting Fund erfüllt, ohne dass er dafür die erneute Zulassung bei der HM Revenue and Customs beantragen muss. Jede Anteilklasse der Gesellschaft wird als Reporting Fund behandelt. Dies wurde von HM Revenue and Customs genehmigt.

## 9. DIVIDENDENAUSCHÜTTUNGSPOLITIK

Wie in der jeweiligen Fondsergänzung angegeben, können Dividendenausschüttungen festgesetzt werden auf:

- (i) Nettokapitalerträge, die aus Zinsen und Dividenden abzüglich Aufwendungen bestehen.
- (ii) 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 Fonds dennoch Dividenden aus den Nettokapitalerträgen und/oder Kapital bezahlen.
- (iii) Andere Mittel (einschließlich Kapital), die nach dem Gesetz aus dem betreffenden Fonds bzw. der betreffenden Anteilklasse des betreffenden Fonds 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 Anteilinhaber ausschüttbaren Betrag zu maximieren.

Für die Anteilklasse 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, 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 Anteilinhabers 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 Anteilinhabers jährlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Im Falle aller anderen Fonds mit ausschüttenden Anteilsklassen werden Ausschüttungen vierteljährlich festgesetzt und werden, abhängig von der Entscheidung des Anteilinhabers, 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. Statt dessen wird der NIW je Anteil der thesaurierenden Anteile entsprechend dieser Erträge oder dieses Wertzuwachses erhöht. Dividendenausschüttungen, die nicht in Anteile reinvestiert werden, werden den Anteilinhabern per Banküberweisung ausgezahlt. Dividendenausschüttungen, die nach Ablauf von sechs Jahren ab dem Datum ihrer Erklärung nicht eingefordert werden, verfallen und fließen an den jeweiligen Fonds zurück. Die Anteilinhaber 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 Fonds wurde ein Teil der Dividendenausschüttungen gemäß der Betriebsergebnisrechnung aus dem Kapital gezahlt (Angaben in Tausend):

Fonds	Geschäftsjahr	Geschäftsjahr
	zum 31. Dez. 2020	zum 31. Dez. 2019
PIMCO Capital Securities Fund	\$ 672	\$ 0
Diversified Income Duration Hedged Fund	25	0
Dynamic Bond Fund	674	0
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 5.512	€ 0
Euro Income Bond Fund	2	4.576
Global Bond ESG Fund	\$ 96	\$ 0
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	2.105	2.507
Global Libor Plus Bond Fund	1.003	0
Global Low Duration Real Return Fund	264	0
Income Fund	253	88
UK Corporate Bond Fund	£ 1.430	£ 0

## 10. SOFT COMMISSIONS

Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann Transaktionen im Namen der Fonds 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, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Fonds kaufen, direkt aus ihren eigenen Mitteln bezahlen.

## 11. 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 Fonds der Gesellschaft entstanden oder diesem zuzuordnen sind, ausschließlich aus den Vermögenswerten des betreffenden Fonds zu begleichen, und weder die Gesellschaft noch ein Verwaltungsratsmitglied, Revisor, Insolvenzverwalter, kommissarischer Insolvenzverwalter oder eine sonstige Person dürfen die Vermögenswerte dieses Fonds zum Ausgleich von Verbindlichkeiten im Namen eines anderen Fonds der Gesellschaft verwenden oder sind verpflichtet, sie hierzu zu verwenden, unabhängig davon, wann diese Verbindlichkeit entstanden ist.

## 12. ÄNDERUNGEN AM PROSPEKT, AN DER GRÜNDUNGSUKRUNDE UND DER SATZUNG

Am 7. Januar 2020 wurde der PIMCO European High Yield Bond Fund von der Zentralbank zugelassen, und die Ergänzung für diesen Fonds wurde in den konsolidierten Verkaufsprospekt aufgenommen.

Am 17. Januar 2020 wurde der Euro Low Duration Fund in PIMCO European Short-Term Opportunities Fund umbenannt. Zudem wurde eine Reihe weiterer Änderungen an der Ergänzung von der Zentralbank zur Kenntnis genommen, darunter:

- Der Fonds wird seine Wertentwicklung gegenüber der Euro Short-Term Rate („ESTER“) messen;
- Die Duration des Fonds wird nun zwischen 0 und 5 Jahren liegen;
- Die Währung, auf die die festverzinslichen Instrumente lauten, in die der Fonds mindestens zwei Drittel seines Vermögens investiert, wird von Euro auf paneuropäisch (d. h. die verschiedenen Währungen Europas) geändert.
- Die für Anlagen des Fonds in hochverzinsliche Investment-Grade-Titel geltende Höchstgrenze wird von 10 % auf 20 % des Nettovermögens des Fonds erhöht; und
- Für sämtliche Anteilsklassen wird ein Verzicht auf die Verwaltungsgebühren eingeführt, der drei Jahre ab dem Tag, an dem die überarbeitete (und in der Folge geänderte) Ergänzung zur Kenntnis genommen wurde, in Kraft bleibt.

Am 24. Februar 2020 wurde die Ergänzung für den Diversified Income Duration Hedged Fund aktualisiert, um nähere Einzelheiten zum Vergleichsindex aufzunehmen.

Am 1. Mai 2020 wurde die Ergänzung für den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund aktualisiert, um die Angaben zum Gebührenverzicht zu berücksichtigen.

Am 1. Juli 2020 wurde die Ergänzung für den UK Corporate Bond Fund aktualisiert, um darzulegen, dass der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr nicht mehr gilt. Die Ergänzung für den Euro Credit Fund wurde aktualisiert, um darzulegen, dass der Verzicht auf die jährliche Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse Institutional nicht mehr gilt und der Verzicht auf die jährliche Verwaltungsgebühr für die Klasse H Institutional bis zum 01. Juli 2021 verlängert wurde.

Am 11. August 2020 wurde der überarbeitete Verkaufsprospekt der Gesellschaft von der Zentralbank zur Kenntnis genommen, einschließlich:

- Auflegung einer neuen Class W, die über Vermittler angeboten werden soll, die bestimmte Kriterien erfüllen.
- In den Prospekt wurden Angaben zu epidemie- und pandemiebezogenen Risiken, Abwicklungsrisiken, dem Verwahrstellenrisiko und dem Risiko in Verbindung mit dem Auslaufen der Verwendung des LIBOR aufgenommen.
- Die Angaben mit Blick auf die Anlage in chinesischen Wertpapieren und die Anlage über den China Inter-Bank Bond Market („CIBM“) wurden gemäß den Ratschlägen des chinesischen Beraters aktualisiert.
- In Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften wurden in die einzelnen Fondsergänzungen weitere Angaben zur Nutzung von Benchmarks für die Messung der Duration, die Berechnung des Gesamtengagements des Fonds und/oder zu Zwecken des Performancevergleichs aufgenommen.

Am 28. August 2020 wurde der the Emerging Asia Bond Fund in Asia Strategic Interest Bond Fund umbenannt. Zudem wurde eine Reihe weiterer Änderungen an der Ergänzung von der Zentralbank zur Kenntnis genommen, darunter:

- Das Hauptanlageziel wurde dahin gehend geändert, dass der Fonds die Erwirtschaftung attraktiver und stabiler Erträge anstrebt. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel.
- Der Fonds darf maximal 50 % seines Gesamtvermögens in hochrentierlichen festverzinslichen Wertpapieren halten.
- Die Duration des Fonds schwankt nun zwischen zwei und acht Jahren, basierend auf der Zinsprognose der Anlageberatungsgesellschaft, und wird nicht mehr unter Bezugnahme auf den JPMorgan Asia Credit Index gemessen.
- Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in Anleihen und andere festverzinsliche Instrumente in Asien ohne Japan, kann jedoch bis zu ein Drittel seines Gesamtvermögens in Anleihen und andere festverzinsliche Instrumente außerhalb Asiens ohne Japan investieren.
- Der Fonds kann bis zu 30 % seines Gesamtvermögen in Wertpapiere investieren, die auf lokale Währungen in der Region Asien ohne Japan lauten (d. h. nicht auf USD). Jedoch wird das Engagement des Fonds in anderen Währungen als dem USD durch Währungsabsicherung auf 20 % seines Gesamtvermögens begrenzt.

- Die Gesamtobergrenze von einem Drittel des Gesamtvermögens des Fonds in kombinierten Anlagen in (i) in Aktien wandelbaren Wertpapieren, (ii) Dividendenpapieren (einschließlich Optionsscheinen), (iii) Einlagenzertifikaten und (iv) Bankakzepten wird aufgehoben.
- Das Kreditrating der festverzinslichen Instrumente, in die der Fonds investiert, gilt nicht mehr.

Am 2. September 2020 wurde der PIMCO Climate Bond Fund von der Zentralbank zugelassen, und die Ergänzung für diesen Fonds wurde in den konsolidierten Verkaufsprospekt aufgenommen.

Am 27. Oktober 2020 wurde der Verkaufsprospekt der Gesellschaft überarbeitet und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen, einschließlich:

- der Nutzung elektronischer Signaturen bei der Dokumentation von Zeichnungen/Rücknahmen.
- der Namensänderung einer der Anlageberatungsgesellschaften von PIMCO Deutschland GmbH in PIMCO Europe GmbH.
- der Ergänzung für den Diversified Income Fund in ihrer aktualisierten Fassung für die neuen Anteilsklassen N Retail.

Am 09. Dezember 2020 wurden die Ergänzungen für den PIMCO Asia High Yield Bond Fund, den Commodity Real Return Fund, den Diversified Income Fund, den Emerging Local Bond Fund, den Emerging Markets Bond Fund, den Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund, den PIMCO European High Yield Bond Fund, den Global Bond Fund, den Global High Yield Bond Fund, den Global Investment Grade Credit Fund, den Global Real Return Fund, den Low Average Duration Fund, den Total Return Bond Fund und den US High Yield Bond Fund um die Angabe ergänzt, dass Dividenden aus dem Kapital der GBP Income-Anteilsklassen gezahlt werden dürfen, und diese Änderungen wurden durch die Zentralbank zur Kenntnis genommen. Damit werden diese 14 Fonds an die restlichen Fonds der Gesellschaft angepasst.

Am 10. Dezember 2020 wurde die Ergänzung für den Low Duration Income Fund geändert, um den bestehenden Verzicht auf eine Verwaltungsgebühr für alle Klassen bis zum 01. Januar 2023 zu verlängern.

Am 11. Dezember 2020 wurde die Ergänzung für den Diversified Income Fund um die Angabe ergänzt, dass die Anteilsklassen N Retail auch über andere Stellen angeboten werden sollen, die Vereinbarungen mit einem durch die Vertriebsstelle beauftragten Untervertreter geschlossen haben.

Am 18. Dezember 2020 wurde der Income Fund II von der Zentralbank zugelassen, und die Ergänzung für diesen Fonds wurde in den konsolidierten Verkaufsprospekt aufgenommen.

Am 23. Dezember 2020 wurden die Ergänzungen für den Emerging Markets Bond ESG Fund, den Global Bond ESG Fund und den Global Investment Grade Credit ESG Fund aktualisiert, um Änderungen an der Anlagepolitik aufzunehmen, die den Screening-Vorgang in Bezug auf ökologische, soziale und Unternehmensführungsaspekte („ESG“) und die inbegriffenen Ausschlusslisten verdeutlichen.

An der Gründungsurkunde und der Satzung der Gesellschaft wurden während des Geschäftsjahres keine Änderungen vorgenommen.

### 13. 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 NIWs des jeweiligen Fonds nicht übersteigen.

#### (b) Verwaltungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder liefert für jeden Fonds, wie im Verkaufsprospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste, für die jeder Fonds eine einzige Verwaltungsgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Verwaltungsgebühr (wie im Verkaufsprospekt definiert) für jeden Fonds läuft an jedem Handelstag (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds 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 Fonds erbracht hat.

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Die Verwaltungsgebühr für die einzelnen Klassen der einzelnen Fonds (angegeben in Prozent pro Jahr ihres NIW) lautet wie folgt:

	Anteilklassen Inst'l, G Inst'l, Inv.		Class E, G Retail, M Retail, N Retail, T (%)		
	Admin (%)	H Inst'l (%)		Class R (%)	Class W (%)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	0,65	k. A.	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	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	k. A.	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 <sup>(1)</sup>	0,85	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.
Euro Bond Fund	0,46	k. A.	1,36	k. A.	k. A.
Euro Credit Fund <sup>(2)</sup>	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.
Euro Short-Term Fund	0,40	k. A.	1,15	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 <sup>(3)</sup>	0,32	0,49	0,82	k. A.	k. A.
Global Advantage Fund	0,70	k. A.	1,70	k. A.	k. A.
Global Advantage Real Return Fund	0,69	k. A.	1,59	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.
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 <sup>(4)</sup>	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.
PIMCO RAE Emerging Markets Fund <sup>(5)</sup>	0,95	k. A.	1,80	k. A.	k. A.
PIMCO RAE Europe Fund <sup>(6)</sup>	0,55	k. A.	1,40	k. A.	k. A.
PIMCO RAE Global Developed Fund <sup>(6)</sup>	0,60	k. A.	1,45	k. A.	k. A.
PIMCO RAE US Fund <sup>(6)</sup>	0,50	k. A.	1,35	k. A.	k. A.
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund	0,49	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund	0,39	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund	0,39	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund	0,29	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
StocksPLUS <sup>TM</sup> Fund	0,55	0,72	1,45	k. A.	k. A.
PIMCO StocksPLUS <sup>TM</sup> 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 <sup>(7)</sup>	1,40	k. A.	2,50	k. A.	k. A.
UK Corporate Bond Fund <sup>(8)</sup>	0,46	0,63	k. A.	0,75	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 <sup>(9)</sup>	0,45	0,62	0,85	k. A.	k. A.

- (1) Bei allen Klassen (mit Ausnahme der Class R, Class E, M Retail und T Class) wird bei dieser Zahl ein Gebührenerzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,10 % p. a. berücksichtigt. Der Gebührenerzicht läuft am 1. April 2021 ab, und die Ergänzung wird bei der nächstmöglichen Gelegenheit nach Ablauf des Gebührenerzichts aktualisiert.
- (2) Bei der Class H Institutional wird ein Gebührenerzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,25 % p. a. berücksichtigt. Der Gebührenerzicht verlängert sich bis zum 30. Juni 2021 und läuft zum 01. Juli 2021 ab. Für die Class Institutional wurde bis zum 30. Juni 2020 ein Gebührenerzicht in Höhe von 0,06 % p. a. gewährt. Der Gebührenerzicht endete am 1. Juli 2020. Bei dem in der Tabelle angegebenen Wert ist der Gebührenerzicht nicht berücksichtigt.
- (3) Für die Anteilklassen Institutional und H Institutional wurde ein Gebührenerzicht in Höhe von 0,14 % p. a. gewährt (0,10 % p. a. bis zum 30. April 2020). In den Gebühren der Class E wird ein Gebührenerzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,54 % p. a. (0,50 % p. a. bis zum 30. April 2020) berücksichtigt. Der Gebührenerzicht endet am 18. Januar 2023.
- (4) Bei allen Klassen wird bei dieser Zahl ein Gebührenerzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,05 % p. a. berücksichtigt. Der Gebührenerzicht für alle Klassen verlängert sich bis zum 31. Dezember 2022 und läuft zum 1. Januar 2023 ab.
- (5) Bis zum 31. Oktober 2020 wurde für alle Klassen ein Gebührenerzicht in Höhe von 0,20 % gewährt. Der Gebührenerzicht endete am 1. November 2020. Bei den in der Tabelle angegebenen Werten ist der Gebührenerzicht nicht berücksichtigt.
- (6) Bis zum 31. Oktober 2020 wurde für alle Klassen ein Gebührenerzicht in Höhe von 0,10 % gewährt. Der Gebührenerzicht endete am 1. November 2020. Bei den in der Tabelle angegebenen Werten ist der Gebührenerzicht nicht berücksichtigt.
- (7) Bis zum 31. Juli 2020 wurde von der Verwaltungsgesellschaft für alle Klassen ein Gebührenerzicht in Höhe von 0,15 % p. a. gewährt. Der Gebührenerzicht endete am 1. August 2020. Bei dem in der Tabelle angegebenen Wert ist der Gebührenerzicht nicht berücksichtigt.
- (8) Für die Anteilklassen Institutional und H Institutional wurde bis zum 30. Juni 2020 ein Gebührenerzicht in Höhe von 0,05 % bzw. 0,24 % p. a. gewährt. Der Gebührenerzicht endete am 1. Juli 2020. Bei den in der Tabelle angegebenen Werten sind die Gebührenerzichte nicht berücksichtigt.
- (9) In den Gebühren für die Anteilklassen Class E, G Retail und M Retail wird ein Gebührenerzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,30 % p. a. berücksichtigt. In den Gebühren für die Class R wird ein Gebührenerzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,16 % p. a. berücksichtigt. Die Gebührenerzichte verlängern sich bis zu dem Zeitpunkt, zu dem die Verwaltungsgesellschaft durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilhaber des Fonds entscheidet, diesen Gebührenerzicht künftig nicht mehr anzuwenden oder zu reduzieren.

Die Verwaltungsgebühren aller Fonds blieben mit Ausnahme der oben angeführten Änderungen an den Gebührenverzichteten gegenüber dem 31. Dezember 2019 unverändert.

Der Global Advantage Real Return Fund, der PIMCO RAE Emerging Markets Fund, PIMCO RAE Europe Fund, der PIMCO RAE Global Developed Fund, der PIMCO RAE US Fund, der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund, der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund, der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund und der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund wurden während des Geschäftsjahres aufgelöst. Sie haben keine Anteilhaber mehr und weitere Zeichnungen für die Fonds sind nicht mehr möglich.

Der PIMCO Climate Bond Fund und der PIMCO European High Yield Bond Fund wurden während des Geschäftsjahres 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 Anteilhabern dieser Anteilsklassen der Fonds 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 Anteilhabern 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 Anteilhaber, 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 Fonds 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 Fonds. 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 Fonds. 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 Anteilhaberdienste, die für den Betrieb der Fonds 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 Fonds übernehmen sonstige Aufwendungen im Zusammenhang mit ihrem Betrieb, die nicht von der Verwaltungsgebühr abgedeckt werden und die variieren und die Gesamthöhe der Aufwendungen der Fonds beeinflussen können. Hierzu zählen unter anderem Steuern und staatliche Abgaben, Maklergebühren, Provisionen und sonstige Transaktionskosten (einschließlich u. a. Gebühren und Aufwendungen 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 zahlt an die unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 Gebühren von jeweils 180.000 EUR (31. Dezember 2019: jeweils 180.000 EUR). Darüber hinaus werden jedem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied alle angemessenen Auslagen erstattet. Die nicht unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder haben keinen Anspruch auf eine gesonderte Vergütung für ihre Verwaltungsrats Tätigkeit bei den Fonds. Die Verwaltungsrats honorare sind in den „Sonstigen Aufwendungen“ der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

In der folgenden Tabelle sind die der Gesellschaft während der Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 von den Abschlussprüfern berechneten Gebühren aufgeführt:

Vergütung des Abschlussprüfers	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Prüfung von Gesellschaftsabschlüssen	€ 574.389	€ 625.361
Sonstige Sicherungsdienste	0	22.000
Steuerberatung	0	0
Dienste außerhalb der Abschlussprüfung	0	0

**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 Anteilhaberdienstleistungen oder für die Verwaltung von Plänen oder Programmen, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, und um sonstige verbundene Aufwendungen (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) zu erstatten. Die Verwaltungsgesellschaft erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Anteilhaber der Investor Classes. Alle Anteilhaber der Investor Classes erhalten identische Dienstleistungen für die erhobenen Gebühren. Diese Dienste können beinhalten: die Beantwortung von Anteilhaberanfragen zu den Fonds und ihrer Wertentwicklung, die Unterstützung von Anteilhabern beim Erwerb, der Rücknahme und dem Tausch von Anteilen, die Führung von individueller Kontoinformationen und die Bereitstellung von Kontoauszügen an die Anteilhaber sowie die Führung sonstiger Unterlagen, die für die Anlage der Anteilhaber im Fonds relevant sind.

Pläne oder Programme, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, können fondsgebundene Versicherungsprodukte sowie Pensions-, Altersversorgungs- oder Sparpläne von Arbeitgebern beinhalten. Alle Anteilhaber der Investor Classes erhalten Dienstleistungen entsprechend der Vereinbarungen mit den Finanzintermediären, mit denen die Anteilhaber ein Dienstleistungsverhältnis unterhalten. Die Servicegebühr errechnet sich jährlich aus 0,35 % des NIW des jeweiligen Fonds, der auf die Investor Classes entfällt. Die Servicegebühr hat sich seit dem 31. Dezember 2019 nicht geändert. Die Servicegebühr wird aus dem NIW gezahlt, der auf den NIW der Investor Classes dieser Fonds entfällt. Die Servicegebühr für die einzelnen Fonds 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 Anteilhabern der Fonds erbringt, und für die Führung der Anteilhaberkonten, 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 Anteilhabern regelmäßig Informationen über ihre Beteiligung an den Fondsanteilen liefern, Informationen von der Gesellschaft an die Anteilhaber weitergeben, laufende Beratungsleistungen in Bezug auf die Eignung bestimmter vom Fonds angebotener Anlagemöglichkeiten vor dem Hintergrund der Anteilhaberanforderungen erbringen, Anfragen der Anteilhaber 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 Nettoinventarwerts des jeweiligen Fonds berechnet und den jeweiligen Anteilsklassen der betreffenden Fonds wie im Verkaufsprospekt angegeben zugewiesen. Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Fonds 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 Fonds (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 Bestandspflegegebühr hat sich seit dem 31. Dezember 2019 nicht geändert.

**(e) Vertriebsgebühr**

Die Vertriebsgebühr, die für die Anteilsklassen der Class T anwendbar ist, wird an die Vertriebsstelle für Dienstleistungen bezahlt, die diese Anteilinhabern des Fonds 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 Fonds, 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 Fonds wird eine Vertriebsgebühr in Höhe von 0,30 % p. a. auf den NIW der Anteilsklasse Class T dieser Fonds bezahlt.

Die Vertriebsgebühr für die einzelnen Fonds 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 Verwaltungsgebühren)**

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 Fonds für alle Klassen des Fonds 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 Verwaltungsrats honorare die Summe aus der Verwaltungsgebühr der Klasse dieses Fonds (vor Anrechnung eines etwa anwendbaren Verzichts auf die Verwaltungsgebühr) aus etwa anfallenden Service- und Bestandspflegegebühren sowie aus sonstigen von dieser Fondsklasse zu tragenden Kosten, die die oben beschriebene Verwaltungsgebühr nicht abdeckt, (ausgenommen Gründungskosten und anteilige Verwaltungsrats honorare) zzgl. 0,0049 % pro Jahr (täglich auf Basis des Fonds-NIW berechnet) überschreiten.

In jedem Monat, in dem der Verwaltungsvertrag gilt, darf die Verwaltungsgesellschaft von einem Fonds 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 Fonds 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 Fonds 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.

**14. 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 13 offengelegt.

Zum 31. Dezember 2020 hielt die Verwaltungsgesellschaft 2.472.397 (31. Dezember 2019: 2.894.323) Anteile des US Short-Term Fund.

Bestimmte Fonds halten Umbrellafonds-interne Überkreuzinvestitionen in Class Z-Anteilen anderer Fonds der Gesellschaft. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Class Z und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Class Z dieser Fonds 0,00 % pro Jahr.

Die folgenden Fonds hielten im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Fonds der Gesellschaft eliminiert.

Fonds	31. Dez. 2020 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 Fonds hielten im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Vergleichssumme der Fonds der Gesellschaft eliminiert.

31. Dez. 2019	
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Diversified Income Fund	PIMCO Asia 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	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Mortgage Opportunities Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Asia 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	Global Advantage Real Return Fund
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Income Fund
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Mortgage Opportunities Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia 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 Fonds 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 Fonds 0,00 % pro Jahr.

Bestimmte Fonds 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 Fonds 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 Fonds an die Verwaltungsgesellschaft ausgeglichen, was in der Betriebsergebnisrechnung innerhalb der Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen wird.

Während der Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 kauften und verkauften die unten erwähnten Fonds Wertpapiere verbundener Fonds, sie nahmen Käufe und Verkäufe in Bezug auf Überkreuzinvestitionen und Käufe und Verkäufe von Anlagen in verbundenen Fonds vor (Angaben in Tausend):

Fonds	31. Dez. 2020	
	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 376.579	\$ 285.891
Asia Strategic Interest Bond Fund	50.196	34.436
PIMCO Capital Securities Fund	676.996	944.926
Commodity Real Return Fund	1.282	23.626
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	50.114	57.452
Diversified Income Fund	4.980.080	3.096.779
Diversified Income Duration Hedged Fund	278.062	359.012
Dynamic Bond Fund	780.132	842.696
Dynamic Multi-Asset Fund	483.465	159.919
Emerging Local Bond Fund	2.617.832	2.629.325

Fonds	31. Dez. 2020	
	Käufe	Verkäufe
Emerging Markets Bond Fund	\$ 2.628.063	\$ 2.293.698
Emerging Markets Bond ESG Fund	202.224	125.659
Emerging Markets Corporate Bond Fund	203.131	209.301
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	158.345	155.830
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	36.695	48.068
Euro Bond Fund	440.424	245.012
Euro Credit Fund	322.690	289.880
Euro Income Bond Fund	398.643	436.419
Euro Long Average Duration Fund	38.287	29.599
Euro Short-Term Fund	161.074	20.346
PIMCO European High Yield Bond Fund	36.091	32.483
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	103.726	116.631
Global Advantage Fund	148.606	136.964
Global Advantage Real Return Fund	3.800	5.574
Global Bond Fund	2.490.760	2.600.616
Global Bond ESG Fund	92.262	55.026
Global Bond Ex-US Fund	167.093	200.909
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	666.046	682.448
Global High Yield Bond Fund	1.249.733	1.109.016
Global Investment Grade Credit Fund	8.277.334	7.928.117
Global Investment Grade Credit ESG Fund	39.270	24.173
Global Libor Plus Bond Fund	520.580	582.347
Global Low Duration Real Return Fund	354.813	369.108
Global Real Return Fund	481.870	389.586
Income Fund	31.357.881	33.258.936
Inflation Strategy Fund	48.696	46.123
Low Average Duration Fund	293.079	216.565
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	337.795	297.816
Low Duration Income Fund	336.617	263.058
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	50.706	72.400
Mortgage Opportunities Fund	1.418.812	1.496.871
StocksPLUS™ Fund	800.124	750.583
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	501	200
Strategic Income Fund	537.532	636.126
Total Return Bond Fund	956.843	1.222.885
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	6.401	5.082
UK Corporate Bond Fund	84.099	74.334
UK Long Term Corporate Bond Fund	77.024	147.299
US High Yield Bond Fund	833.321	573.388
US Investment Grade Corporate Bond Fund	911.471	844.401
US Short-Term Fund	1.878.129	2.139.977

Fonds	31. Dez. 2019	
	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 88.743	\$ 71.250
Asia Strategic Interest Bond Fund	18.721	17.469
PIMCO Capital Securities Fund	1.482.190	879.410
Commodity Real Return Fund	0	1.349
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	58.018	66.210
Diversified Income Fund	1.070.845	104.807
Diversified Income Duration Hedged Fund	70.345	298.075
Dynamic Bond Fund	391.272	237.893
Dynamic Multi-Asset Fund	209.992	181.002
Emerging Local Bond Fund	2.456.687	2.689.811
Emerging Markets Bond Fund	2.290.099	2.150.980
Emerging Markets Bond ESG Fund	313.811	385.584
Emerging Markets Corporate Bond Fund	134.290	122.705
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	89.874	80.039
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	51.157	23.935
Euro Bond Fund	240.513	175.332
Euro Credit Fund	395.788	328.573
Euro Income Bond Fund	608.898	141.569

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fonds	31. Dez. 2019	
	Käufe	Verkäufe
Euro Long Average Duration Fund	\$ 58.388	\$ 72.503
Euro Short-Term Fund	41.715	17.464
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	113.007	84.131
Global Advantage Fund	361.083	440.478
Global Advantage Real Return Fund	42.514	42.850
Global Bond Fund	4.786.201	3.613.904
Global Bond ESG Fund	28.621	14.831
Global Bond Ex-US Fund	416.577	376.138
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	643.172	776.146
Global High Yield Bond Fund	328.651	231.449
Global Investment Grade Credit Fund	8.470.318	7.895.851
Global Investment Grade Credit ESG Fund	5.068	1.428
Global Libor Plus Bond Fund	802.283	743.901
Global Low Duration Real Return Fund	545.810	569.673
Global Real Return Fund	628.464	661.932
Income Fund	26.413.432	25.206.705
Inflation Strategy Fund	36.014	36.043
Low Average Duration Fund	157.626	186.399
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	173.312	133.815
Low Duration Income Fund	30.930	38.188
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	10.370	11.250
Mortgage Opportunities Fund	1.162.513	1.022.083
StocksPLUS™ Fund	365.306	44.625
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	888	385
Strategic Income Fund	321.988	238.868
Total Return Bond Fund	614.153	794.293
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	6.051	8.684
UK Corporate Bond Fund	212.056	189.342
UK Long Term Corporate Bond Fund	122.480	116.459
US High Yield Bond Fund	597.069	422.486
US Investment Grade Corporate Bond Fund	487.662	241.110
US Short-Term Fund	1.395.930	1.672.084

Die folgende Tabelle zeigt den Wert der umlaufenden Anteile im Besitz der Allianz-Gruppe, von Fonds der Gesellschaft, von mit der Gesellschaft verbundenen Fonds und von Mitarbeitern der Anlageberatungsgesellschaften in ihrer Eigenschaft als verbundene Parteien der Gesellschaft. Dabei handelt es sich zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 um über 20 % des Nettovermögens des Fonds.

Fonds	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
	% gehalten	% gehalten
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	39,07	60,64
Asia Strategic Interest Bond Fund	76,26	25,41
PIMCO Climate Bond Fund	77,61	k. A.
Emerging Local Bond Fund	k. A.	33,93
Emerging Markets Bond Fund	23,25	39,41
Emerging Markets Bond ESG Fund	k. A.	24,65
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	68,26	84,25
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	44,78	k. A.
PIMCO European High Yield Bond Fund	99,91	k. A.
Global Bond ESG Fund	k. A.	20,60
Global Bond Ex-US Fund	k. A.	23,84
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	57,19	40,72
Mortgage Opportunities Fund	k. A.	23,35
PIMCO RAE Emerging Markets Fund	k. A.	79,44
PIMCO RAE Europe Fund	k. A.	82,32
PIMCO RAE Global Developed Fund	k. A.	33,21
PIMCO RAE US Fund	k. A.	92,69
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund	k. A.	100,00
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund	k. A.	100,00
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund	k. A.	100,00
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund	k. A.	100,00
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	98,47	100,00
Strategic Income Fund	48,81	45,64
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	k. A.	21,67
US Short-Term Fund	30,18	33,68

Fonds, bei denen Anteilinhaber, ausgenommen die Allianz-Gruppe, Fonds der Gesellschaft, mit der Gesellschaft verbundene Fonds und Mitarbeiter des Anlageberaters, mehr als 20 % des Nettovermögens des Fonds halten, sind in Erläuterung 16 separat ausgewiesen.

Während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2020 verkaufte der Income Fund Wertpapiere im Wert von USD 153.126 (31. Dezember 2019: USD 2.120.695) an Repack Bond Collateral Ltd. (die „Körperschaft“), eine nach dem Recht der Kaimaninseln gegründete befreite Gesellschaft mit beschränkter Haftung, die eine verbundene Partei der Anlageberatungsgesellschaft ist. Es wurden keine Gebühren von der Körperschaft an die Anlageberatungsgesellschaft gezahlt. Zum 31. Dezember 2020 hielt der Income Fund 11.128 Schuldverschreibungen (31. Dezember 2019: 11.606 Schuldverschreibungen) von BNP Paribas Issuance BV., die durch von der Körperschaft begebene Schuldverschreibungen besichert sind. Während des Geschäftsjahres zahlte die Gesellschaft dem Income Fund Gesamtausschüttungen in Höhe von USD 45.806 (31. Dezember 2019: USD 46.400) und Drawdowns in Höhe von USD 246.261 (31. Dezember 2019: USD 124.396).

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

Zum 31. Dezember 2020 hielt V. Mangala Ananthanarayanan 8.757,87 (31. Dezember 2019: 8.757,87) Anteile des Dynamic Multi-Asset Fund, 7.990,84 (31. Dezember 2019: 7.761,45) Anteile des Global Investment Grade Credit Fund und 21.184,85 (31. Dezember 2019: 20.342,32) Anteile des Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 2020 hielt Craig A. Dawson 18.118,23 (31. Dezember 2019: Null) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 92.850,51 (31. Dezember 2019: 92.850,51) Anteile des Global Libor Plus Bond Fund und 97.370,98 (31. Dezember 2019: 97.370,98) Anteile des Low Duration Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 2020 hielt David M. Kennedy 5.026,09 (31. Dezember 2019: 5.341,79) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 16.786,79 (31. Dezember 2019: 16.786,79) Anteile des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund. Beide sind Fonds der Gesellschaft.

Während der zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 endenden Geschäftsjahre hielt kein anderes Verwaltungsratsmitglied eine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Während der zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 endenden Geschäftsjahre hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

### 15. WECHSELKURSE

Um einen gemeinsamen Abschluss für die Fonds und Finanzdaten für die Gesellschaft zu erhalten (was nach irischem Gesellschaftsrecht erforderlich ist), wurden die Beträge im Finanzstatus zu dem am 31. Dezember 2020 geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/EUR 0,81729) umgerechnet (31. Dezember 2019: USD/EUR 0,89087) von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/GBP 0,73156) (31. Dezember 2019: USD/GBP 0,75486) umgerechnet. Die Beträge in der Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen wurden zu einem durchschnittlichen während des am 31. Dezember 2020 endenden Geschäftsjahres geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/EUR 0,87772) (31. Dezember 2019: USD/EUR 0,89340) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/GBP 0,78011) (31. Dezember 2019: USD/GBP 0,78364) umgerechnet.

Die folgende Tabelle gibt die für die Umrechnung der Anlagen und sonstigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf von der Funktionswährung des jeweiligen Fonds abweichende Währungen lauten, in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar, die Funktionswährungen von Fonds der Gesellschaft, verwendeten Wechselkurse wieder.

Der Wechselkurs für den Argentinischen Peso („ARS“) zum 31. Dezember 2020 enthält einen 68%igen Abschlag (31. Dezember 2019: 22 %) aufgrund der Abweichung zwischen dem offiziellen und dem inoffiziellen Wechselkurs Argentinien.

Fremd-währung	31. Dez. 2020 Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67315
ARS	172,88760	k. A.	141,30000

Fremd-wahrung	31. Dez. 2020 Präsentationswahrung		
	EUR	GBP	USD
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 (oder €)	1,00000	1,11720	0,81729
GBP (oder £)	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
ILS	3,92857	k. A.	3,21080
INR	89,40173	k. A.	73,06750
JPY (oder ¥)	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 (oder \$)	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

Fremd-wahrung	31. Dez. 2019 Präsentationswahrung		
	EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67315
ARS	81,94246	k. A.	73,00000
AUD	1,59684	1,88456	1,42258
BRL	4,51548	k. A.	4,02270
CAD	1,45560	1,71787	1,29675
CHF	1,08697	k. A.	0,96835
CLP	k. A.	k. A.	751,95000
CNH	7,81838	9,22709	6,96515
CNY	7,81899	k. A.	6,96570
COP	3.683,48208	k. A.	3.281,50000
CZK	25,41401	k. A.	22,64055
DKK	7,47248	8,81887	6,65700
DOP	k. A.	k. A.	53,36000
EGP	k. A.	k. A.	16,05000
EUR (oder €)	1,00000	1,18018	0,89087
GBP (oder £)	0,84733	1,00000	0,75486

Fremd-wahrung	31. Dez. 2019 Präsentationswahrung		
	EUR	GBP	USD
HKD	8,74629	k. A.	7,79180
HUF	330,70985	k. A.	294,61915
IDR	15.583,09920	k. A.	13.882,50000
ILS	k. A.	k. A.	3,45400
INR	80,12194	k. A.	71,37815
JPY (oder ¥)	121,98763	143,96728	108,67500
KRW	1.298,11454	k. A.	1.156,45000
KZT	k. A.	k. A.	382,92500
MXN	21,19728	k. A.	18,88400
MYR	k. A.	k. A.	4,09050
NGN	k. A.	k. A.	362,92000
NOK	9,86374	11,64098	8,78730
NZD	1,66382	1,96361	1,48225
PEN	k. A.	k. A.	3,31110
PHP	k. A.	k. A.	50,64500
PLN	4,25124	k. A.	3,78730
RON	k. A.	k. A.	4,26385
RUB	69,71985	k. A.	62,11125
SEK	10,50777	k. A.	9,36105
SGD	1,50937	1,78133	1,34465
THB	k. A.	k. A.	29,95375
TRY	6,67999	7,88359	5,95100
TWD	33,64917	k. A.	29,97700
UAH	k. A.	k. A.	23,80800
USD (oder \$)	1,12250	1,32475	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	37,42500
VND	k. A.	k. A.	23.172,50000
ZAR	15,69647	k. A.	13,98350

## 16. FINANZIELLE RISIKEN

Die Hauptrisiken, die sich aus den Finanzinstrumenten der Gesellschaft ergeben, sind das Marktpreis-, Devisen-, Zinssatz-, Liquiditats-, Kredit- und Kontrahentenrisiko.

### (a) Marktpreisrisiko

Das Marktpreisrisiko ergibt sich hauptsachlich aus der Unsicherheit der kunftigen Kurse der gehaltenen Finanzinstrumente. Es stellt den potenziellen Verlust dar, der dem Fonds entstehen konnte, wenn Marktpositionen bei nachteiligen Kursbewegungen gehalten werden. Die Anlageberatungsgesellschaften prufen die Vermogensstrukturierung des Portfolios, um das mit bestimmten Landern oder Industriezweigen verbundene Risiko zu minimieren, wahrend sie weiterhin die Anlageziele der Fonds verfolgen.

Die Anlageberatungsgesellschaften verwenden eine Reihe quantitativer Techniken, um die Auswirkungen von Marktrisiken, einschlielich Kreditereignisse, Zinssatzanderungen, Kreditspreads und Beitreibungswerte, auf das Anlageportfolio der Fonds zu bewerten.

Die Anlageberatungsgesellschaften verwendeten die Risikopotenzialanalyse (Value at Risk, „VaR“), eine von Finanzinstituten weitgehend eingesetzte Technik zur Messung, Bewertung und Darstellung des Marktrisikos. Das VaR ist ein statistischer Rahmen, der die Quantifizierung des Marktrisikos in einem Portfolio mit einem bestimmten Konfidenzintervall in einem festgelegten Haltezeitraum unterstutzt. Bestimmte Fonds durfen das relative VaR-Modell oder das absolute VaR-Modell verwenden. Bei Einsatz des relativen VaR-Modells darf das Risikopotenzial eines Fondsportfolios das doppelte Risikopotenzial eines vergleichbaren Benchmark-Portfolios oder Referenzportfolios (d. h. eines ahnlichen Portfolios ohne Derivate) nicht uberschreiten, welches das angestrebte Anlageverhalten des jeweiligen Fonds wiedergibt. Bei Einsatz des absoluten VaR-Modells darf das Risikopotenzial eines Fondsportfolios 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht ubersteigen und die Haltezeitdauer betragt 20 Tage, wobei die Datenhistorie mindestens ein Jahr betragt. Das VaR soll die erwarteten maximalen Verluste in Dollar messen, die aus dem interaktiven Verhalten aller wesentlichen Marktkurse, Spreads, Schwankungen, Zinssatze sowie anderer Risiken, einschlielich des Devisen-, Zinssatz-, Schwellenmarkt- und Konvexitatsrisikos, die aus den historisch beobachteten Verhaltnissen zwischen diesen Markten resultieren konnen.

Obwohl der Einsatz von Derivaten zu zusatzlichen Fremdkapitalrisiken fuhren kann, wird jedes derartige zusatzliche Risiko mithilfe der VaR-Methode in ubereinstimmung mit den Anforderungen der Zentralbank

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

gesichert und gesteuert. Die Anlageberatungsgesellschaften überwachen das Portfoliorisiko täglich mithilfe von Marktfaktoranalysen. Mögliche Marktrisiken werden mit dem parametrischen delta-normalen oder Faktormodellansatz berechnet. Das VaR wird auf Grundlage der Schlusspreise und der Marktinformationen des vorhergehenden Geschäftstages täglich automatisch berechnet und dargestellt. In Abhängigkeit von der Anwendung der Risikostatistiken könnten verschiedene Konfidenzniveaus (z. B. 99 %) und Zeithorizonte (Wochen oder Monate) ausgewählt werden.

Stresstests werden in Bezug auf das VaR-Modell für jeden Fonds monatlich durchgeführt. Die PIMCO Risk Group überwacht die Zusammensetzung der Stresstests und nimmt die entsprechenden Änderungen vor, wenn dies aufgrund der Marktbedingungen und Zusammensetzung des jeweiligen Fonds angebracht ist. Mit den Stresstests werden potenzielle Gewinne oder Verluste aufgrund von Schocks bei finanziellen Variablen geschätzt, wie unter anderem Nominalzinsen für Staatsanleihen, Nominalzinsen für Swaps, Realzinsen, Credit-Spreads, Aktienbewertungen, Rohstoffwerten, Wechselkurse und implizierte Volatilitäten. Abgesehen von den monatlich durchgeführten Stresstests werden drei zusätzliche Arten von Stresstests durchgeführt, von denen einige täglich und einige interaktiv für Analysen verwendet werden. Der erste Test umfasst einen Szenario-Auswirkungs-Test, der die Auswirkungen von unerwarteten Ertragsbewegungen im Markt auf den Wert des Portfolios ermittelt. Diese Durationen werden an jedem Geschäftstag berechnet. Der zweite Test legt eine Datenbank historischer Krisenszenarios zugrunde und untersucht die Reaktionen auf solche Krisen. Die historischen Krisenszenarios enthalten viele unerwartete Veränderungen der Marktbedingungen und Korrelationsmatrizen. Der dritte Test enthält Korrelationsmatrizen, die manuell verändert werden können, um in der Zukunft mögliche Bedingungen zu simulieren, die bisher allerdings noch nicht eingetreten sind.

Berechnungen werden allgemein mithilfe automatischer Simulationsmethoden durchgeführt. Allerdings sind auch Methoden zur manuellen Überprüfung von Änderungen an den Korrelationsmatrizen vorhanden, die sich auf die Portfolios in erheblichem Umfang negativ auswirken würden. Diese Korrelationsänderungen können dann analysiert werden und mögliche, tatsächlich vorkommende Ereignisse, durch die solche Änderungen verursacht werden, können zugeordnet werden.

Natürlich kann nicht ausgeschlossen werden, dass sich tatsächliche wirtschaftliche Ergebnisse von den manuellen und automatischen Szenarios unterscheiden.

Die täglichen VaR-Messungen sind eine Schätzung des Portfolioverlusts für den folgenden Monat, der nach den Annahmen des VaR-Modells zu 99 % nicht überschritten wird.

Nicht alle Risiken, denen das Portfolio ausgesetzt sein kann, sollen vom VaR erfasst werden. Insbesondere will das System nicht das Liquiditätsrisiko, das Kontrahentenrisiko oder extreme Kreditereignisse wie Emittentenverzug erfassen. In der Praxis weichen die tatsächlichen Handelsergebnisse vom VaR ab und vermitteln eventuell keine aussagekräftige Indikation der Gewinne und Verluste in angespannten Marktverhältnissen. Um die Zuverlässigkeit der VaR-Modelle zu bestimmen, werden tatsächliche Ergebnisse überwacht, um die Gültigkeit der für die VaR-Berechnung verwendeten Annahmen und Parameter zu prüfen. Marktrisikopositionen werden ebenfalls regelmäßigen Stresstests unterzogen, um sicherzustellen, dass die einzelnen Fonds einem extremen Marktereignis standhalten können.

In den folgenden Tabellen werden der minimale, maximale, durchschnittliche VaR und der VaR zum Geschäftsjahresende der einzelnen Fonds zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 aufgeführt:

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2020			
			Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Relativ	JP Morgan JACI Non-Investment Grade	85,79 %	117,68 %	99,76 %	102,70 %
Asia Strategic Interest Bond Fund	Relativ	JPMorgan Asia Credit Index	89,81 %	122,95 %	106,75 %	104,70 %
PIMCO Capital Securities Fund <sup>(1)</sup>	Absolut	k. A.	3,70 %	31,03 %	10,65 %	7,51 %
PIMCO Climate Bond Fund	Absolut	k. A.	1,71 %	3,06 %	2,31 %	1,88 %
Commodity Real Return Fund	Relativ	Bloomberg Commodity Index Total Return	86,58 %	143,08 %	114,21 %	111,78 %
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Absolut	k. A.	1,44 %	15,82 %	5,31 %	3,61 %
Diversified Income Fund	Relativ	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	91,29 %	110,32 %	96,31 %	101,08 %
Diversified Income Duration Hedged Fund <sup>(1)</sup>	Absolut	k. A.	3,40 %	36,65 %	10,90 %	7,60 %
Dynamic Bond Fund	Absolut	k. A.	1,04 %	9,99 %	4,63 %	3,13 %
Dynamic Multi-Asset Fund	Absolut	k. A.	3,53 %	8,99 %	5,31 %	6,67 %
Emerging Local Bond Fund	Relativ	JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	104,21 %	124,28 %	113,48 %	110,66 %
Emerging Markets Bond Fund	Relativ	JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	101,61 %	114,00 %	108,36 %	110,74 %
Emerging Markets Bond ESG Fund	Relativ	JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	100,08 %	119,62 %	107,51 %	104,65 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Relativ	JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	99,40 %	128,68 %	112,24 %	118,18 %
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Relativ	50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged	41,32 %	71,49 %	56,96 %	70,81 %
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Relativ	JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	103,96 %	176,53 %	120,69 %	117,01 %
Euro Bond Fund	Relativ	FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	94,41 %	120,79 %	108,58 %	102,15 %
Euro Credit Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index	91,21 %	161,63 %	106,27 %	98,82 %
Euro Income Bond Fund	Absolut	k. A.	1,25 %	14,76 %	5,80 %	3,85 %
Euro Long Average Duration Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index	95,03 %	107,68 %	101,06 %	100,26 %
Euro Short-Term Fund	Absolut	k. A.	0,29 %	5,42 %	1,12 %	0,60 %
PIMCO European High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	76,87 %	102,39 %	93,07 %	89,49 %
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Absolut	k. A.	0,92 %	7,29 %	2,66 %	1,93 %
Global Advantage Fund	Relativ	PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	109,90 %	149,45 %	127,00 %	123,77 %

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2020			
			Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
Global Bond Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index	90,74 %	177,95 %	126,74 %	114,77 %
Global Bond ESG Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index	87,27 %	163,86 %	121,55 %	108,10 %
Global Bond Ex-US Fund <sup>(1)</sup>	Relativ	Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index	85,32 %	204,53 %	134,72 %	126,10 %
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Relativ	60 % MSCI All Country World Index / 40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged	106,17 %	132,01 %	117,12 %	132,01 %
Global High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD	10,15 %	139,00 %	92,49 %	94,33 %
Global Investment Grade Credit Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (USD Hedged)	37,41 %	167,67 %	107,03 %	105,71 %
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (USD Hedged)	35,30 %	137,86 %	103,79 %	103,62 %
Global Libor Plus Bond Fund	Absolut	k. A.	0,83 %	7,52 %	2,83 %	1,75 %
Global Low Duration Real Return Fund	Relativ	Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	109,50 %	159,54 %	132,34 %	117,76 %
Global Real Return Fund	Relativ	Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	93,20 %	117,40 %	106,82 %	105,22 %
Income Fund	Absolut	k. A.	1,35 %	18,58 %	7,03 %	5,15 %
Inflation Strategy Fund <sup>(1)</sup>	Absolut	k. A.	4,83 %	40,23 %	13,03 %	10,31 %
Low Average Duration Fund	Absolut	k. A.	0,57 %	4,28 %	1,05 %	0,57 %
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund <sup>(1)</sup>	Relativ	Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	38,13 %	213,10 %	134,32 %	140,78 %
Low Duration Income Fund	Absolut	k. A.	1,21 %	10,18 %	4,86 %	4,10 %
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Relativ	Alerian MLP Index	69,47 %	97,60 %	89,56 %	96,64 %
Mortgage Opportunities Fund	Absolut	k. A.	0,99 %	10,27 %	4,82 %	3,68 %
StocksPLUS™ Fund	Relativ	S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	94,78 %	117,97 %	102,82 %	100,99 %
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Relativ	S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	97,96 %	120,31 %	106,93 %	104,07 %
Strategic Income Fund <sup>(1)</sup>	Relativ	75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Value Index	114,31 %	211,33 %	166,28 %	178,95 %
Total Return Bond Fund	Relativ	Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index	72,44 %	166,61 %	105,43 %	95,10 %
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Absolut	k. A.	2,32 %	11,97 %	5,73 %	5,56 %
UK Corporate Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	97,51 %	157,60 %	112,43 %	110,03 %
UK Long Term Corporate Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	97,32 %	129,20 %	105,05 %	103,60 %
US High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index	9,14 %	129,26 %	90,33 %	93,10 %
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Relativ	Bloomberg Barclays U.S. Credit Index	36,05 %	151,48 %	100,03 %	98,98 %
US Short-Term Fund	Absolut	k. A.	0,48 %	11,88 %	1,71 %	0,49 %
<b>31. Dez. 2019</b>						
Fonds	Methode	Vergleichsindex	Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Relativ	JP Morgan JACI Non-Investment Grade	92,83 %	107,84 %	98,77 %	99,98 %
Asia Strategic Interest Bond Fund	Relativ	JPMorgan Asia Credit Index	95,62 %	115,76 %	105,65 %	101,73 %
PIMCO Capital Securities Fund	Absolut	k. A.	4,04 %	6,62 %	5,52 %	4,04 %
Commodity Real Return Fund	Relativ	Bloomberg Commodity Index Total Return	92,40 %	113,40 %	109,01 %	107,01 %
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Absolut	k. A.	1,29 %	2,06 %	1,65 %	1,37 %
Diversified Income Fund	Relativ	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	88,26 %	111,86 %	98,36 %	92,47 %
Diversified Income Duration Hedged Fund	Absolut	k. A.	3,32 %	6,86 %	4,92 %	3,40 %
Dynamic Bond Fund	Absolut	k. A.	0,96 %	1,48 %	1,20 %	1,09 %
Dynamic Multi-Asset Fund	Absolut	k. A.	2,82 %	6,14 %	4,29 %	5,45 %
Emerging Local Bond Fund	Relativ	JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	102,07 %	114,21 %	108,17 %	107,82 %
Emerging Markets Bond Fund	Relativ	JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	98,36 %	109,35 %	105,59 %	106,25 %
Emerging Markets Bond ESG Fund	Relativ	JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	98,44 %	109,20 %	105,21 %	102,51 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Relativ	JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	102,62 %	127,31 %	114,33 %	115,07 %

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2019			
			Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Relativ	50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged	41,56 %	122,79 %	55,01 %	47,24 %
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Relativ	JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	104,16 %	112,62 %	108,92 %	111,02 %
Euro Bond Fund	Relativ	FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	81,97 %	106,62 %	94,90 %	105,73 %
Euro Credit Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index	92,27 %	107,94 %	98,90 %	102,77 %
Euro Income Bond Fund	Absolut	k. A.	1,29 %	2,58 %	1,82 %	1,29 %
Euro Long Average Duration Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index	94,36 %	104,43 %	99,16 %	97,99 %
Euro Short-Term Fund	Absolut	k. A.	0,36 %	0,57 %	0,47 %	0,36 %
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Absolut	k. A.	0,56 %	1,03 %	0,77 %	0,92 %
Global Advantage Fund	Relativ	PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	103,36 %	119,76 %	110,14 %	115,33 %
Global Advantage Real Return Fund	Relativ	PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged)	101,27 %	121,16 %	107,96 %	110,08 %
Global Bond Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index	77,22 %	113,28 %	99,37 %	94,51 %
Global Bond ESG Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index	74,37 %	110,70 %	98,60 %	92,20 %
Global Bond Ex-US Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index	68,15 %	110,96 %	96,09 %	94,56 %
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Relativ	60 % MSCI All Country World Index / 40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged	84,76 %	118,75 %	99,72 %	116,25 %
Global High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD	85,07 %	112,90 %	95,62 %	89,59 %
Global Investment Grade Credit Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (USD Hedged)	91,22 %	105,32 %	98,27 %	103,30 %
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Global Aggregate-Credit Index (USD Hedged)	97,26 %	110,33 %	103,08 %	103,76 %
Global Libor Plus Bond Fund	Absolut	k. A.	0,84 %	1,21 %	1,01 %	0,85 %
Global Low Duration Real Return Fund	Relativ	Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	104,10 %	130,83 %	116,31 %	124,52 %
Global Real Return Fund	Relativ	Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	90,32 %	103,00 %	97,61 %	99,63 %
Income Fund	Absolut	k. A.	1,39 %	2,26 %	1,69 %	1,39 %
Inflation Strategy Fund	Absolut	k. A.	4,84 %	5,90 %	5,32 %	4,99 %
Low Average Duration Fund	Absolut	k. A.	0,98 %	1,75 %	1,36 %	1,29 %
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Relativ	Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	99,26 %	133,29 %	117,63 %	130,86 %
Low Duration Income Fund	Absolut	k. A.	0,90 %	1,59 %	1,24 %	1,26 %
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Relativ	Alerian MLP Index	87,94 %	102,47 %	96,25 %	90,88 %
Mortgage Opportunities Fund	Absolut	k. A.	1,00 %	1,51 %	1,22 %	1,16 %
StocksPLUS™ Fund	Relativ	S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	92,13 %	108,54 %	101,58 %	102,06 %
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Relativ	S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	99,83 %	111,53 %	103,87 %	105,07 %
Strategic Income Fund	Relativ	75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Value Index	101,85 %	128,17 %	117,16 %	128,17 %
Total Return Bond Fund	Relativ	Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index	88,23 %	118,08 %	104,17 %	109,53 %
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Absolut	k. A.	3,16 %	9,67 %	5,72 %	5,05 %
UK Corporate Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	96,93 %	106,04 %	101,39 %	98,51 %
UK Long Term Corporate Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	95,11 %	102,77 %	98,30 %	97,51 %
US High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index	87,71 %	106,69 %	94,64 %	89,75 %
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Relativ	Bloomberg Barclays U.S. Credit Index	91,60 %	106,07 %	98,63 %	98,22 %
US Short-Term Fund	Absolut	k. A.	0,74 %	2,24 %	1,24 %	0,74 %

<sup>(1)</sup> In der vorstehenden Tabelle enthaltene VaR-Verstöße während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2020 waren vorübergehend, im Kontext ungewöhnlich hoher Marktvolatilität aufgrund des Coronavirus-Ausbruchs. Seit Ende Mai 2020 blieben alle Fonds innerhalb ihrer VaR-Grenzen.

Equity Fund, der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund, der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund und der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund wurden allesamt während des Geschäftsjahres aufgelöst, weshalb keine Sensitivitätsanalyse in Bezug auf diese Fonds zum 31. Dezember 2020 vorgenommen wurde.

Der PIMCO RAE Europe Fund, der PIMCO RAE Global Developed Fund, der PIMCO RAE US Fund, der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets

Die nachfolgende Sensitivitätsanalyse bezieht sich auf die vorstehend genannten Fonds zum 31. Dezember 2019 und geht von der Annahme aus, dass sich der Marktpreis der Anlagen verändert, während alle anderen Variablen konstant bleiben. Hätte sich der Marktpreis von Anlagen zum 31. Dezember 2019 um 5 % erhöht oder verringert, so hätte sich das Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilhaber bei Annahme ansonsten konstanter Variablen aus der Geschäftstätigkeit ungefähr um die folgenden Beträge erhöht oder verringert (Angaben in Tausend):

Fonds	31. Dez. 2019 Auswirkungen auf den Nettoinventarwert	
	Zunahme	Abnahme
PIMCO RAE Europe Fund	€ 1.169	€ (1.169)
PIMCO RAE Global Developed Fund	\$ 2.768	\$ (2.768)
PIMCO RAE US Fund	706	(706)
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund	\$ 562	\$ (562)
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund	€ 256	€ (256)
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund	\$ 282	\$ (282)
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund	170	(170)

Der PIMCO RAE Emerging Markets Fund wurde am 23. November 2020 aufgelöst. Zum 31. Dezember 2020 hielt dieser Fonds einen Restbestand von 1.335 Aktien von China Life Insurance Co. Ltd. mit einem Marktwert von 1.057 USD (31. Dezember 2019: 292.000 Aktien mit einem Marktwert von 249.509 USD). Dabei handelte es sich um eine Position in chinesischen Stammaktien aus der Finanzbranche, die zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 in Stufe 1 eingeordnet wurde. Diese Position wurde am 4. Januar 2021 verkauft.

Vor der Auflösung des Fonds nutzte dieser den Commitment-Ansatz. In der folgenden Tabelle sind das minimale, maximale und durchschnittliche Engagement des Fonds sowie das Engagement des Fonds zum Berichtszeitraums-/Jahresende für den Berichtszeitraum zum 23. November 2020 (Auflösungsdatum des Fonds) und das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019 angegeben:

	Ende des Berichtszeitraums/ Geschäftsjahres			
	Min.	Max.	Durchschnitt	
23. Nov. 2020	0,00 %	10,57 %	4,32 %	0,00 %
31. Dez. 2019	0,00 %	2,48 %	0,87 %	2,44 %

Die Zentralbank verlangt, dass alle Fonds ein Maß für die Fremdfinanzierung offenlegen, das auf Basis eines nominellen Brutto-Engagements berechnet wird. Die Höhe des nominellen Bruttoengagements wird, wie von der Zentralbank gefordert, mithilfe der Summe der absoluten Werte der Nominalwerte der eingesetzten Derivate berechnet (wobei davon ausgegangen wird, dass bestimmte Terminkontrakte enthalten sind) und berücksichtigt daher keine vom Fonds eingegangenen Netting- und Absicherungsvereinbarungen. Der Einsatz von Derivaten (ob für Absicherungs- oder Anlagezwecke) kann zu einem höheren nominellen Brutto-Engagement führen. Es wird erwartet, dass das nominelle Brutto-Engagement der Fonds auf höhere Werte ansteigt, wenn es die Anlageberatungsgesellschaften beispielsweise für angemessen halten, Derivate zur Änderung des Zinssatzes, des Währungs- oder Kreditengagements des Fonds einzusetzen.

In den folgenden Tabellen werden die durchschnittlichen nominellen Brutto-Engagements für die Fonds für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 aufgeführt:

Fonds	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019*
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	45 %	44 % <sup>(2)</sup>
Asia Strategic Interest Bond Fund	47 %	48 %
PIMCO Capital Securities Fund	80 %	92 %
PIMCO Climate Bond Fund	59 % <sup>(1)</sup>	k. A.
Commodity Real Return Fund	408 %	350 %
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	135 %	105 %
Diversified Income Fund	107 %	120 %
Diversified Income Duration Hedged Fund	142 %	142 %
Dynamic Bond Fund	116 %	120 %
Dynamic Multi-Asset Fund	135 %	142 %
Emerging Local Bond Fund	436 %	298 %

Fonds	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019*
Emerging Markets Bond Fund	56 %	51 %
Emerging Markets Bond ESG Fund	44 %	42 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	29 %	34 %
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	321 %	127 % <sup>(2)</sup>
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	297 %	199 %
Euro Bond Fund	233 %	252 %
Euro Credit Fund	120 %	120 %
Euro Income Bond Fund	143 %	137 %
Euro Long Average Duration Fund	334 %	307 %
Euro Short-Term Fund	45 %	51 %
PIMCO European High Yield Bond Fund	56 % <sup>(1)</sup>	k. A.
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	200 %	128 %
Global Advantage Fund	387 %	462 %
Global Advantage Real Return Fund	k. A.	446 %
Global Bond Fund	332 %	421 %
Global Bond ESG Fund	277 %	389 %
Global Bond Ex-US Fund	373 %	435 %
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	394 %	492 %
Global High Yield Bond Fund	24 %	20 %
Global Investment Grade Credit Fund	94 %	123 %
Global Investment Grade Credit ESG Fund	74 %	65 %
Global Libor Plus Bond Fund	110 %	110 %
Global Low Duration Real Return Fund	289 %	315 %
Global Real Return Fund	243 %	257 %
Income Fund	147 %	136 %
Inflation Strategy Fund	298 %	369 %
Low Average Duration Fund	114 %	211 %
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	73 %	84 %
Low Duration Income Fund	133 %	143 %
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	76 %	80 %
Mortgage Opportunities Fund	401 %	460 %
PIMCO RAE Emerging Markets Fund	k. A.	0 %
StocksPLUS™ Fund	232 %	266 %
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	223 %	167 % <sup>(2)</sup>
Strategic Income Fund	125 %	113 %
Total Return Bond Fund	133 %	275 %
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	964 %	915 %
UK Corporate Bond Fund	97 %	98 %
UK Long Term Corporate Bond Fund	95 %	95 %
US High Yield Bond Fund	6 %	7 %
US Investment Grade Corporate Bond Fund	63 %	111 %
US Short-Term Fund	100 %	298 %

<sup>(1)</sup> Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2020 aufgelöst.

<sup>(2)</sup> Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2019 aufgelöst.

\* Für die folgenden Fonds sind keine Beträge angegeben: 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 und PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund, da diese keine OTC Finanzderivate hielten.

#### (b) Devisenrisiko

Legen die Fonds direkt in Fremdwährungen oder Wertpapiere an, die in Fremdwährungen gehandelt werden und Einnahmen davon erhalten, oder in Finanzderivaten, die Beteiligungen an Fremdwährungen bieten, unterliegen sie dem Risiko, dass der Wert dieser Währungen im Verhältnis zur Funktionswährung der Fonds fällt, oder, im Fall von Absicherungspositionen, dass der Wert der Funktionswährung der Fonds im Verhältnis zur abgesicherten Währung fällt. Devisenkurse im Ausland können innerhalb kurzer Zeiträume aus einer Reihe von Gründen erheblich schwanken. Dazu zählen Änderungen der Zinssätze, Interventionen (oder das verpasste Intervenieren) seitens der US- oder ausländischer Regierungen, Zentralbanken oder supranationaler Organisationen wie dem Internationalen Währungsfonds, oder auferlegte Währungskontrollen oder sonstige politische Entwicklungen in oder außerhalb der USA. Im Ergebnis können die Anlagen der Fonds in auf ausländische Währungen lautenden Wertpapieren die Erträge der Fonds schmälern.

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Der PIMCO Climate Bond Fund, der Low Duration Income Fund, der Mortgage Opportunities Fund, der StocksPLUS™ Fund und der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund wiesen zum 31. Dezember 2020 bzw. 31. Dezember 2019 kein wesentliches Fremdwährungsengagement auf. Die folgenden Tabellen zeigen das Gesamtengagement des Fremdwährungsrisikos bei Währungen, bei denen das Fremdwährungsengagement für wesentlich gehalten wird (d. h. bei denen unter Konstanthaltung aller anderen Variablen die Auswirkungen einer vernünftigerweise möglichen Entwicklung des Wechselkurses zu einer deutlichen Schwankung des Nettovermögens führen würden) (Angaben in Tausend):

		PIMCO Asia High Yield Bond Fund					
		Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar		\$ 71	\$ 0	\$ 71	\$ 0	\$ 4.592	\$ 4.592
		Asia Strategic Interest Bond Fund					
		Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar		\$ 1.759	\$ (1.722)	\$ 37	\$ 19	\$ 758	\$ 777
Indonesische Rupie		3.393	16	3.409	0	0	0
		\$ 5.152	\$ (1.706)	\$ 3.446	\$ 19	\$ 758	\$ 777
		PIMCO Capital Securities Fund					
		Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro		\$ 4.204.119	\$ (5.775.868)	\$ (1.571.749)	\$ 3.086.653	\$ (3.010.897)	\$ 75.756
		Commodity Real Return Fund					
		Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro		\$ 111.052	\$ (214.685)	\$ (103.633)	\$ 128.625	\$ (133.427)	\$ (4.802)
		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund					
		Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Japanischer Yen		\$ 17	\$ 1.383	\$ 1.400	\$ 55	\$ 4.192	\$ 4.247
		Diversified Income Fund					
		Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro		\$ 3.598.610	\$ (7.168.574)	\$ (3.569.964)	\$ 2.014.477	\$ (2.002.218)	\$ 12.259
		Diversified Income Duration Hedged Fund					
		Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro		\$ 312.668	\$ (626.809)	\$ (314.141)	\$ 232.546	\$ (237.460)	\$ (4.914)
		Dynamic Bond Fund					
		Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Chinese Renminbi (Mainland)		\$ 74.994	\$ 0	\$ 74.994	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Chinese Renminbi (Offshore)		0	(75.502)	(75.502)	0	0	0
Euro		308.302	(678.257)	(369.955)	231.830	(356.228)	(124.398)
		\$ 383.296	\$ (753.759)	\$ (370.463)	\$ 231.830	\$ (356.228)	\$ (124.398)
		Dynamic Multi-Asset Fund					
		Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
		Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real		€ 0	€ (97)	€ (97)	€ 0	€ 62.806	€ 62.806
Britisches Pfund Sterling		42.011	(166.094)	(124.083)	17.730	(15.548)	2.182
Chilenischer Peso		0	116.611	116.611	0	0	0
Hongkong-Dollar		434.317	(230.287)	204.030	64.509	(50.895)	13.614
Japanischer Yen		664.627	(519.872)	144.755	234.173	(302.544)	(68.371)
Südkoreanischer Won		78.442	34.714	113.156	0	(1.083)	(1.083)
Schwedische Krone		37.893	(30.667)	7.226	0	46.305	46.305
Taiwanesischer Dollar		141.487	(2.646)	138.841	0	(2.682)	(2.682)
US-Dollar		1.837.155	(3.485.003)	(1.647.848)	655.751	(630.125)	25.626
		€ 3.235.932	€ (4.283.341)	€ (1.047.409)	€ 972.163	€ (893.766)	€ 78.397

	Emerging Local Bond Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 149.695	\$ 83.602	\$ 233.297	\$ 150.202	\$ 140.190	\$ 290.392
Chilenischer Peso	92.286	(14.985)	77.301	120.016	(31.971)	88.045
Chinese Renminbi (Mainland)	333.955	6.185	340.140	46.659	(8.714)	37.945
Chinese Renminbi (Offshore)	0	(90.221)	(90.221)	0	(48.862)	(48.862)
Kolumbianischer Peso	199.569	31.063	230.632	234.336	(68.599)	165.737
Tschechische Krone	81.720	97.036	178.756	34.751	72.176	106.927
Ungarischer Forint	155.799	(13.495)	142.304	208.554	98.385	306.939
Indonesische Rupie	327.173	(59.533)	267.640	270.676	20.175	290.851
Malaysischer Ringgit	178.506	23.268	201.774	97.575	67.814	165.389
Mexikanischer Peso	196.563	187.890	384.453	203.077	84.486	287.563
Peruanischer Nuevo Sol	161.650	(84.247)	77.403	177.362	(64.583)	112.779
Polnischer Zloty	142.809	84.700	227.509	247.099	215.000	462.099
Rumänischer Leu	68.947	15.879	84.826	19.197	51.499	70.696
Russischer Rubel	205.872	26.998	232.870	258.990	4.277	263.267
Südafrikanischer Rand	332.623	49.103	381.726	272.356	(68.582)	203.774
Thailändischer Baht	167.142	76.083	243.225	119.338	137.826	257.164
	\$ 2.794.309	\$ 419.326	\$ 3.213.635	\$ 2.460.188	\$ 600.517	\$ 3.060.705

  

	Emerging Markets Bond Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 237.674	\$ (434.726)	\$ (197.052)	\$ 245.118	\$ (237.150)	\$ 7.968

  

	Emerging Markets Bond ESG Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 113.485	\$ (211.358)	\$ (97.873)	\$ 63.310	\$ (62.644)	\$ 666

  

	Emerging Markets Corporate Bond Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 12.276	\$ (24.532)	\$ (12.256)	\$ 8.638	\$ (8.731)	\$ (93)

  

	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 3.028	\$ 5.115	\$ 8.143	\$ 2.630	\$ 0	\$ 2.630
Chinese Renminbi (Mainland)	4.909	0	4.909	(26)	0	(26)
Dominikanischer Peso	6.926	(4.886)	2.040	4.116	0	4.116
Euro	15.702	(6.962)	8.740	5.431	(5.534)	(103)
Ungarischer Forint	4.561	(61)	4.500	4.300	(3.342)	958
Indonesische Rupie	0	7.510	7.510	0	5.376	5.376
Mexikanischer Peso	10.010	(2.543)	7.467	19.529	(16.968)	2.561
Russischer Rubel	4.281	3.914	8.195	3.476	(27)	3.449
	\$ 49.417	\$ 2.087	\$ 51.504	\$ 39.456	\$ (20.495)	\$ 18.961

  

	Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 595	\$ 1.474	\$ 2.069	\$ 2.040	\$ 1.461	\$ 3.501
Chilenischer Peso	1.469	(967)	502	1.386	101	1.487
Chinese Renminbi (Mainland)	408	1.249	1.657	455	6.580	7.035
Chinese Renminbi (Offshore)	0	1.375	1.375	0	(141)	(141)
Kolumbianischer Peso	1.075	(64)	1.011	3.534	(2.845)	689
Tschechische Krone	0	1.279	1.279	0	2.746	2.746
Ägyptisches Pfund	962	(968)	(6)	5	1.497	1.502
Ungarischer Forint	75	716	791	3.055	(1.256)	1.799
Indische Rupie	0	2.745	2.745	0	5.917	5.917
Indonesische Rupie	0	1.273	1.273	0	3.402	3.402
Malaysischer Ringgit	0	1.602	1.602	1	3.365	3.366
Mexikanischer Peso	2.933	2.151	5.084	3.782	3.723	7.505
Polnischer Zloty	7	1.695	1.702	0	3.821	3.821
Russischer Rubel	50	2.324	2.374	797	4.677	5.474
Singapur-Dollar	0	2.464	2.464	0	5.649	5.649

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Fortsetzung)						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Südafrikanischer Rand	\$ 1.532	\$ (598)	\$ 934	\$ 946	\$ (624)	\$ 322
Südkoreanischer Won	0	3.348	3.348	0	7.446	7.446
Taiwanesischer Dollar	0	1.892	1.892	0	4.423	4.423
Thailändischer Baht	0	1.637	1.637	0	3.670	3.670
Türkische Lira	0	1.331	1.331	0	2.801	2.801
	\$ 9.106	\$ 25.958	\$ 35.064	\$ 16.001	\$ 56.413	\$ 72.414

  

Euro Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 759.598	€ (659.959)	€ 99.639	€ 682.051	€ (432.758)	€ 249.293

  

Euro Credit Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 208.941	€ (439.542)	€ (230.601)	€ 321.181	€ (224.210)	€ 96.971

  

Euro Income Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 1.118.116	€ (1.519.305)	€ (401.189)	€ 1.120.162	€ (774.493)	€ 345.669

  

Euro Long Average Duration Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 28.857	€ (14.321)	€ 14.536	€ 26.447	€ (17.130)	€ 9.317

  

Euro Short-Term Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 56.161	€ (109.039)	€ (52.878)	€ 45.456	€ (51.927)	€ (6.471)

  

PIMCO European High Yield Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 9.538	€ (17.280)	€ (7.742)	€ k. A.	€ k. A.	€ k. A.

  

PIMCO European Short-Term Opportunities Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 71.926	€ (50.403)	€ 21.523	€ 14.467	€ (19.265)	€ (4.798)

  

Global Advantage Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 28.769	\$ (5.181)	\$ 23.588	\$ 11.025	\$ 12.859	\$ 23.884
Brasilianischer Real	4.350	13.293	17.643	5.375	10.452	15.827
Britisches Pfund Sterling	46.888	(13.430)	33.458	45.141	(5.087)	40.054
Kanadischer Dollar	3.127	10.450	13.577	2.677	9.494	12.171
Chinese Renminbi (Mainland)	9.297	675	9.972	12.030	5.326	17.356
Chinese Renminbi (Offshore)	0	7.972	7.972	0	(17.159)	(17.159)
Euro	123.551	4.756	128.307	96.743	27.813	124.556
Indische Rupie	0	14.486	14.486	0	11.528	11.528
Japanischer Yen	18.636	34.580	53.216	21.532	20.004	41.536
Mexikanischer Peso	107	6.142	6.249	1.417	8.423	9.840
Russischer Rubel	5.938	4.696	10.634	7.754	3.941	11.695
Südkoreanischer Won	4.282	9.482	13.764	4.064	3.328	7.392
	\$ 244.945	\$ 87.921	\$ 332.866	\$ 207.758	\$ 90.922	\$ 298.680

  

Global Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 711.355	\$ (331.214)	\$ 380.141	\$ 204.420	\$ 113.025	\$ 317.445
Britisches Pfund Sterling	1.536.036	(1.255.723)	280.313	1.227.408	(830.490)	396.918
Chinese Renminbi (Mainland)	1.077.372	(37.505)	1.039.867	639.526	45.367	684.893

	Global Bond Fund (Fortsetzung)					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Chinese Renminbi (Offshore)	\$ 0	\$ (903.313)	\$ (903.313)	\$ 0	\$ (703.972)	\$ (703.972)
Euro	3.438.909	(5.815.436)	(2.376.527)	3.393.294	(3.536.667)	(143.373)
	\$ 6.763.672	\$ (8.343.191)	\$ (1.579.519)	\$ 5.464.648	\$ (4.912.737)	\$ 551.911
	Global Bond ESG Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 61.248	\$ (26.254)	\$ 34.994	\$ 16.061	\$ (279)	\$ 15.782
Britisches Pfund Sterling	127.181	(102.888)	24.293	62.510	(42.227)	20.283
Chinese Renminbi (Mainland)	99.220	(10.547)	88.673	31.139	0	31.139
Chinese Renminbi (Offshore)	0	(77.917)	(77.917)	0	(31.822)	(31.822)
Euro	337.694	(623.337)	(285.643)	170.126	(144.045)	26.081
	\$ 625.343	\$ (840.943)	\$ (215.600)	\$ 279.836	\$ (218.373)	\$ 61.463
	Global Bond Ex-US Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 54.770	\$ (32.812)	\$ 21.958	\$ 22.311	\$ 923	\$ 23.234
Britisches Pfund Sterling	93.910	(65.170)	28.740	98.578	(65.056)	33.522
Chinese Renminbi (Mainland)	103.966	(21.723)	82.243	71.548	2.401	73.949
Chinese Renminbi (Offshore)	0	(79.847)	(79.847)	0	(80.534)	(80.534)
Euro	243.820	(268.050)	(24.230)	288.124	(236.389)	51.735
	\$ 496.466	\$ (467.602)	\$ 28.864	\$ 480.561	\$ (378.655)	\$ 101.906
	PIMCO Global Core Asset Allocation Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 732	\$ 10.599	\$ 11.331	\$ 898	\$ (18.268)	\$ (17.370)
Chinese Renminbi (Mainland)	62.901	(36.242)	26.659	0	317	317
Chinese Renminbi (Offshore)	0	(26.752)	(26.752)	0	(726)	(726)
Euro	24.000	91.987	115.987	26.800	(22.577)	4.223
Japanischer Yen	34.963	13.811	48.774	106.820	(89.013)	17.807
Mexikanischer Peso	(1.778)	8.214	6.436	20.785	445	21.230
Schwedische Krone	39	6.925	6.964	43	21.326	21.369
	\$ 120.857	\$ 68.542	\$ 189.399	\$ 155.346	\$ (108.496)	\$ 46.850
	Global High Yield Bond Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 1.206.545	\$ (2.366.901)	\$ (1.160.356)	\$ 455.408	\$ (451.471)	\$ 3.937
	Global Investment Grade Credit Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 4.452.519	\$ (5.096.564)	\$ (644.045)	\$ 2.836.734	\$ (2.910.617)	\$ (73.883)
Japanischer Yen	9.469	265.847	275.316	11.124	616.390	627.514
	\$ 4.461.988	\$ (4.830.717)	\$ (368.729)	\$ 2.847.858	\$ (2.294.227)	\$ 553.631
	Global Investment Grade Credit ESG Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 108.682	\$ (196.229)	\$ (87.547)	\$ 18.877	\$ (19.501)	\$ (624)
	Global Libor Plus Bond Fund					
	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Chinese Renminbi (Mainland)	\$ 60.057	\$ 0	\$ 60.057	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Chinese Renminbi (Offshore)	0	(60.430)	(60.430)	0	0	0
Euro	300.392	(642.039)	(341.647)	211.947	(272.819)	(60.872)
	\$ 360.449	\$ (702.469)	\$ (342.020)	\$ 211.947	\$ (272.819)	\$ (60.872)

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Global Low Duration Real Return Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 265.026	\$ (515.176)	\$ (250.150)	\$ 256.418	\$ (175.586)	\$ 80.832

  

Global Real Return Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 731.810	\$ (1.422.059)	\$ (690.249)	\$ 441.048	\$ (348.905)	\$ 92.143

  

Income Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Mexikanischer Peso	\$ 37.505	\$ 1.790.610	\$ 1.828.115	\$ 60.036	\$ 984.411	\$ 1.044.447
Russischer Rubel	665.000	841.414	1.506.414	0	1.963.103	1.963.103
	\$ 702.505	\$ 2.632.024	\$ 3.334.529	\$ 60.036	\$ 2.947.514	\$ 3.007.550

  

Inflation Strategy Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 1.710	\$ 3.433	\$ 5.143	\$ 1.628	\$ 3.838	\$ 5.466
Mexikanischer Peso	1.499	712	2.211	1.414	1.846	3.260
	\$ 3.209	\$ 4.145	\$ 7.354	\$ 3.042	\$ 5.684	\$ 8.726

  

Low Average Duration Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Chinesische Renminbi (Offshore)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (30.838)	\$ (30.838)
Japanischer Yen	95.929	(96.522)	(593)	1.255	36.174	37.429
	\$ 95.929	\$ (96.522)	\$ (593)	\$ 1.255	\$ 5.336	\$ 6.591

  

Low Duration Global Investment Grade Credit Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 157.630	\$ (299.029)	\$ (141.399)	\$ 87.751	\$ (88.811)	\$ (1.060)
Japanischer Yen	356	5.318	5.674	44	14.646	14.690
	\$ 157.986	\$ (293.711)	\$ (135.725)	\$ 87.795	\$ (74.165)	\$ 13.630

  

PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Kanadischer Dollar	\$ 5.166	\$ (5.234)	\$ (68)	\$ 19.641	\$ (28.529)	\$ (8.888)

  

PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 803	\$ 0	\$ 03
Hongkong-Dollar	0	0	0	1.323	0	1.323
Indonesische Rupie	0	0	0	244	0	244
Russischer Rubel	0	0	0	638	0	638
Südafrikanischer Rand	0	0	0	499	0	499
Südkoreanischer Won	0	0	0	1.788	0	1.788
Taiwanesischer Dollar	453	0	453	1.400	0	1.400
Thailändischer Baht						

  

Strategic Income Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 22.244	\$ 3.341	\$ 25.585	\$ 9.332	\$ (849)	\$ 8.483
Euro	96.670	(123.487)	(26.817)	103.981	(48.881)	55.100
Japanischer Yen	32.422	(756)	31.666	92.448	(42.918)	49.530
	\$ 151.336	\$ (120.902)	\$ 30.434	\$ 205.761	\$ (92.648)	\$ 113.113

  

Total Return Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Chinesische Renminbi (Offshore)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (108.620)	\$ (108.620)
Euro	867.847	(1.730.834)	(862.987)	642.037	(564.634)	77.403
Japanischer Yen	2.787	(4.713)	(1.926)	2.035	144.590	146.625
	\$ 870.634	\$ (1.735.547)	\$ (864.913)	\$ 644.072	\$ (528.664)	\$ 115.408

  

PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 18	\$ 1.204	\$ 1.222	\$ 9	\$ 168	\$ 177
Brasilianischer Real	(11)	352	341	(24)	648	624
Britisches Pfund Sterling	258	2.611	2.869	15	614	629
Kanadischer Dollar	152	3.146	3.298	37	1.329	1.366
Chilenischer Peso	41	756	797	0	(546)	(546)
Kolumbianischer Peso	53	893	946	0	103	103

PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Fortsetzung)						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Ungarischer Forint	\$ 12	\$ 323	\$ 335	\$ (176)	\$ (354)	\$ (530)
Indische Rupie	37	462	499	0	878	878
Indonesische Rupie	0	352	352	0	651	651
Japanischer Yen	79	3.548	3.627	1.289	(3.970)	(2.681)
Mexikanischer Peso	49	842	891	(32)	972	940
Neuseeländischer Dollar	1	2.088	2.089	0	1.418	1.418
Norwegische Krone	0	1.144	1.144	0	888	888
Philippinischer Peso	0	374	374	0	627	627
Russischer Rubel	0	431	431	0	586	586
Singapur-Dollar	34	539	573	106	465	571
Schwedische Krone	1	2.150	2.151	1	(251)	(250)
Schweizer Franken	1	2.266	2.267	0	0	0
Thailändischer Baht	12	836	848	0	892	892
	\$ 737	\$ 24.317	\$ 25.054	\$ 1.225	\$ 5.118	\$ 6.343

  

UK Corporate Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	£ 72.323	(87.438)	(15.115)	59.226	(73.549)	(14.323)

  

UK Long Term Corporate Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	£ 41.755	£ (45.096)	£ (3.341)	£ 41.053	£ (52.854)	£ (11.801)

  

US High Yield Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 89.968	\$ (173.016)	\$ (83.048)	\$ 29.281	\$ (25.153)	\$ 4.128

  

US Investment Grade Corporate Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Japanischer Yen	\$ 204	\$ 8.752	\$ 8.956	\$ 82	\$ 21.350	\$ 21.432

  

US Short-Term Fund						
Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 61.534	\$ (119.460)	\$ (57.926)	\$ 12.332	\$ (59.805)	\$ (47.473)
Japanischer Yen	0	57.175	57.175	6.655	43.504	50.159
	\$ 61.534	\$ (62.285)	\$ (751)	\$ 18.987	\$ (16.301)	\$ 2.686

Die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Fonds wurden während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2020 aufgelöst und waren zum Ende des Geschäftsjahres keinem wesentlichen Fremdwährungsrisiko ausgesetzt, mit Ausnahme des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund. Wären die jeweiligen Basiswährungen der Fonds zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 gegenüber allen anderen von den Fonds gehaltenen Währungen um 5 % gestiegen, so wären das Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber und die Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit gemäß der Betriebsergebnisrechnung bei Annahme ansonsten konstanter Variablen wie in der nachfolgenden Tabelle dargestellt gestiegen/gefallen.

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
PIMCO RAE Emerging Markets Fund	k. A.	\$ 5.729
PIMCO RAE Europe Fund	k. A.	€ 1.169
PIMCO RAE Global Developed Fund	k. A.	\$ 2.768
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund	\$ 23	562
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund	k. A.	€ 256
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund	k. A.	\$ 282

Eine 5 %ige Abschwächung der Basiswährungen gegenüber allen anderen von den Fonds gehaltenen Währungen hätte bei Annahme ansonsten konstanter Variablen einen gleich starken jedoch umgekehrten Effekt auf die oben angegebenen Beträge im Abschluss gehabt.

Der PIMCO RAE US Fund und der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund wurden ebenfalls im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 geschlossen. Vor der Auflösung dieser Teilfonds wurden ihre Anlagen in der Funktionswährung der Teilfonds erworben, so dass zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 kein Fremdwährungsengagement bestand.

### (c) Zinsrisiko

Das Zinsrisiko ist das Risiko, dass der Wert von Rentenwerten aufgrund veränderter Zinssätze sinkt. Bei einem Anstieg des Nominalzinssatzes sinkt voraussichtlich der Wert bestimmter, von den Fonds gehaltener Rentenwerte. Der Nominalzinssatz lässt sich als Summe des realen Zinssatzes und der voraussichtlichen Inflationsrate beschreiben. Rentenwerte mit längeren Laufzeiten reagieren eher empfindlich auf Änderungen der Zinssätze, was sie volatil macht als Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten. Die Duration dient hauptsächlich als Maß für die Sensitivität des Marktpreises eines Rentenpapiers gegenüber Zinssatzschwankungen (d. h. Renditeschwankungen).

Vor ihrer Auflösung während des Geschäftsjahres war die Mehrheit der finanziellen durch den PIMCO RAE Emerging Markets Fund, den PIMCO RAE Europe Fund, den PIMCO RAE Global Developed Fund, den PIMCO RAE US Fund, den PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund, den PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund, den PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund und den PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund gehaltenen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten nicht zinsbringend. Demzufolge unterlagen diese Fonds keinen wesentlichen Risiken aufgrund von Schwankungen der vorherrschenden Marktzinsen. Alle übrigen Fonds sind vornehmlich in Rentenwerten investiert und somit den Risiken ausgesetzt, die mit den Auswirkungen der Schwankungen der geltenden Marktzinsen auf ihre Finanzpositionen und Cashflows zusammenhängen. Diese Anlagen sind in der Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen. Überschüssige Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente werden zu kurzfristigen Marktzinsen investiert.

Die Sensitivität der Exponierung der Gesellschaft gegenüber dem Zinsrisiko ist in den VaR-Gesamtberechnungen in Erläuterung 16 (a) angegeben.

**(d) Liquiditätsrisiko**

Das Liquiditätsrisiko eines Fonds wird hauptsächlich durch die Rücknahme von Anteilen beeinflusst. Gewinnberechtigte Anteilinhaber können in Übereinstimmung mit dem Prospekt einige oder alle ihre umlaufenden Anteile zurückgeben. Rückgabeberechtigte Anteile werden auf Ansuchen des Anteilinhabers zurückgenommen und im Finanzstatus ausgewiesen. Die Vermögenswerte des Fonds bestehen hauptsächlich aus jederzeit veräußerbaren Wertpapieren, die umgehend verkauft werden können, um Rücknahmen von Anteilinhabern in Übereinstimmung mit dem Prospekt ausführen zu können. Ein Liquiditätsrisiko liegt vor, wenn sich bestimmte Anlagen schwer kaufen oder verkaufen lassen. Auch kann es bei illiquiden Wertpapieren die Bewertung schwieriger werden, insbesondere bei wechselhaften Märkten. Die Anlagen eines Fonds in illiquiden Wertpapieren können die Erträge des Fonds schmälern, da dieser eventuell nicht in der Lage ist, die illiquiden Wertpapiere zu einer günstigen Zeit oder einem günstigen Kurs zu veräußern. Fonds mit Kapitalanlagestrategien, die Devisen, Derivate oder Wertpapiere mit beträchtlichen Markt- und/oder Kreditrisiken enthalten, neigen dazu, am anfälligsten für Liquiditätsrisiken zu sein.

Darüber hinaus kann der Markt für bestimmte Anlagen bei widrigen Markt- oder Wirtschaftsbedingungen illiquide werden, unabhängig von individuellen ungünstigen Veränderungen der Lage eines bestimmten Emittenten. In diesen Fällen kann ein Fonds aufgrund von Beschränkungen bei der Anlage in illiquiden Wertpapieren und der Schwierigkeit, solche Wertpapiere oder Instrumente zu kaufen und zu verkaufen, nicht in der Lage sein, das gewünschte Maß an Engagement in einem bestimmten Sektor zu erreichen. Soweit die Hauptanlagestrategien eines Fonds Wertpapiere von Unternehmen mit geringeren Marktkapitalisierungen, ausländischen Wertpapieren, illiquiden Sektoren festverzinslicher Wertpapiere oder Wertpapiere mit erheblichem Markt- und/oder Kreditrisiko umfassen, weist der Fonds tendenziell ein höheres Engagement im Liquiditätsrisiko auf. Ferner könnten festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten einem erhöhten Liquiditätsrisiko im Vergleich zu festverzinslichen Wertpapieren mit kürzeren Laufzeiten ausgesetzt sein.

Und schließlich bezieht sich das Liquiditätsrisiko auch auf das Risiko ungewöhnlich umfangreicher Rücknahmeanträge oder sonstiger ungewöhnlicher Marktbedingungen, die es einem Fonds erschweren können, Rücknahmeanträge innerhalb des zulässigen Zeitraums vollständig auszuführen. Die Erfüllung solcher Rücknahmeanträge könnte es erforderlich machen, dass ein Fonds Wertpapiere zu niedrigeren Kursen oder unter ungünstigen Bedingungen verkauft, was den Wert des Fonds verringern würde. Es kann auch der Fall sein, dass andere Marktteilnehmer versuchen, festverzinsliche Positionen zur gleichen Zeit wie ein Fonds zu liquidieren, was zu einem erhöhten Angebot auf dem Markt führen und zu Liquiditätsrisiko und Abwärtspreisdruk beitragen kann.

Für alle Fonds ist die Gesellschaft berechtigt, die Anzahl der Anteile eines Fonds, die an einem Geschäftstag zurückgegeben werden können, auf 10 % der Gesamtzahl der ausgegebenen Anteile dieses Fonds zu beschränken. In diesem Fall wird die Gesellschaft alle Rücknahmeanträge an diesem Handelstag anteilig verringern und die Rücknahmeanträge so behandeln, als wären sie am jeweils nächsten Handelstag eingegangen, bis alle Anteile, auf die sich der ursprüngliche Antrag bezog, zurückgenommen wurden.

Die Satzung enthält besondere Bestimmungen für den Fall, dass infolge des Rücknahmeantrags eines Anteilinhabers Anteile in Höhe von mehr als 5 % des NIW der Anteile eines Fonds an einem Handelstag durch die Gesellschaft zurückgenommen würden. In einem solchen Fall kann die Gesellschaft in ihrem alleinigen Ermessen (soweit nicht anders in der maßgeblichen Fondsergänzung

beschrieben) den Rücknahmeantrag durch die Übertragung von Vermögenswerten des jeweiligen Fonds an den Anteilinhaber in Sachwerten (in Wertpapieren) erfüllen, deren Wert dem Rücknahmepreis der zurückgenommenen Anteile entspricht, als würden die Rücknahmeerlöse in bar abzüglich etwaiger Rücknahmegebühren und sonstiger Übertragungskosten gezahlt, sofern eine solche Auszahlung den Interessen der verbleibenden Anteilinhaber dieses Fonds nicht abträglich ist. Wenn der Anteilinhaber, der eine solche Rücknahme beantragt, über die Absicht der Gesellschaft benachrichtigt wird, den Rücknahmeantrag durch eine solche Auszahlung von Vermögenswerten zu erfüllen, kann dieser Anteilinhaber von der Gesellschaft verlangen, anstelle der Übertragung dieser Vermögenswerte deren Verkauf zu arrangieren und die Erlöse des Verkaufs an diesen Anteilinhaber zu zahlen, wobei die anfallenden Kosten durch den jeweiligen Anteilinhaber getragen werden.

Die derzeit bekannten Verbindlichkeiten der Fonds sind im Finanzstatus ausgewiesen. Der Großteil dieser Verbindlichkeiten ist innerhalb von drei Monaten zahlbar. Hiervon ausgenommen sind Verbindlichkeiten aus Finanzderivaten und leerverkauften Wertpapieren. Die frühesten vertraglichen Fälligkeitstermine für Verbindlichkeiten aus Finanzderivaten werden in der Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen.

Derivative Finanzinstrumente bestehen aus dem Marktwert von Devisenterminkontrakten, Terminkontrakten, Optionskontrakten und Swaps zum Ende des Geschäftsjahres. Derivative Finanzinstrumente sind Finanzvermögen und -verbindlichkeiten, die zu Handelszwecken gehalten und hauptsächlich zum kurzfristigen Verkauf erworben werden. Da nicht davon auszugehen ist, dass die Instrumente bis zur Fälligkeit oder Beendigung gehalten werden, stellt der aktuelle Marktwert den geschätzten Kapitalfluss dar, der erforderlich sein kann, um die Positionen zu veräußern. Zukünftige Kapitalflüsse der Fonds und realisierte Verbindlichkeiten können von den kurzfristigen Verbindlichkeiten aufgrund veränderter Marktbedingungen abweichen.

Die Anlageberatungsgesellschaften verwalten das Liquiditätsrisiko, indem sie die Portfolios überwachen und Anlagen prüfen, die als illiquide oder nicht jederzeit und sofort verkäuflich gelten, um sicherzustellen, dass ausreichend liquide Vermögenswerte vorhanden sind, um die ausstehenden Verbindlichkeiten der Fonds zu begleichen.

Einige Fonds können eine konzentrierte Anteilinhaberbasis aufweisen, wobei große institutionelle Anteilinhaber einen erheblichen Anteil am Nettovermögen eines Fonds halten. Die setzt die anderen Anteilinhaber des Fonds gewissen Risiken aus. Zu diesen Risiken zählt das Risiko, dass an einem beliebigen Tag ein großer Teil der Vermögenswerte eines Fonds zurückgenommen werden kann, was die allgemeine Wirtschaftlichkeit des Fonds oder die Fähigkeit anderer Anteilinhaber beeinträchtigen könnte, die an diesem Tag keine Rücknahmeanträge gestellt haben, Rücknahmen beim Fonds zu beantragen, wenn es beispielsweise erforderlich werden kann, eine eingeschränkte Bearbeitung der Rücknahmeanträge zu veranlassen. Die nachfolgend aufgeführten Fonds sind einem erheblichen Konzentrationsrisiko ausgesetzt, da sie Anteilinhaber haben, die mehr als 20 % des Nettovermögens des Fonds halten. Eine solche Konzentration der Anteilinhaberbeteiligungen könnte wesentliche Auswirkungen auf den Fonds haben, sollte einer dieser Anteilinhaber die Rückzahlung erheblicher Kapitalbeträge beantragen. Der prozentuale Anteilsbesitz der Allianz-Gruppe, von Fonds der Gesellschaft, von mit der Gesellschaft verbundenen Fonds und von Mitarbeitern der Anlageberatungsgesellschaften wird nachstehend nicht angegeben, da dieser separat in Erläuterung 14 angegeben wird.

Fondsbezeichnung	31. Dez. 2020		31. Dez. 2019	
	Name des Anteilinhabers	Beteiligung in %	Name des Anteilinhabers	Beteiligung in %
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Anteilinhaber C	28,44	Anteilinhaber C	k. A.
Commodity Real Return Fund	Anteilinhaber E	k. A.	Anteilinhaber E	21,16
Emerging Markets Bond ESG Fund	Anteilinhaber A	k. A.	Anteilinhaber A	30,97
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Anteilinhaber O	48,17	Anteilinhaber O	29,97
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Anteilinhaber Y	22,27	Anteilinhaber Y	k. A.
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Anteilinhaber G	k. A.	Anteilinhaber G	35,92
Euro Credit Fund	Anteilinhabern M	k. A.	Anteilinhabern M	28,09
Euro Income Bond Fund	Anteilinhaber D	28,90	Anteilinhaber D	32,02
Euro Long Average Duration Fund	Anteilinhaber J	25,33	Anteilinhaber J	27,23
Euro Short-Term Fund	Anteilinhaber W	26,82	Anteilinhaber W	k. A.
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Anteilinhaber F	23,57	Anteilinhaber F	57,91
Global Advantage Fund	Anteilinhaber N	29,38	Anteilinhaber N	29,33
Global Bond ESG Fund	Anteilinhaber T	k. A.	Anteilinhaber T	21,63
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Anteilinhaber U	k. A.	Anteilinhaber U	27,57
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Anteilinhaber C	24,97	Anteilinhaber C	20,39
Inflation Strategy Fund	Anteilinhaber K	29,25	Anteilinhaber K	27,20

Fondsbezeichnung
Inflation Strategy Fund
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund
Low Duration Income Fund
Low Duration Income Fund
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund
Mortgage Opportunities Fund
Mortgage Opportunities Fund
PIMCO RAE Global Developed Fund
StocksPLUS™ Fund
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
UK Long Term Corporate Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund

#### (e) Kredit- und Kontrahentenrisiken

Die Fonds setzen sich gegenüber Parteien, mit denen sie Geschäfte tätigen, einem Kreditrisiko aus. Hinzu kommt das Risiko eines Zahlungsausfalls. Die Fonds handeln mit Kontrahenten, die derzeit ein Mindestrating von BBB/Baa2 halten. Die Fonds minimieren die Konzentration des Kreditrisikos, indem sie Transaktionen gegebenenfalls mit einer Vielzahl von Kunden und Kontrahenten an anerkannten und renommierten Börsen durchführen. OTC-Derivatgeschäfte sind dem Risiko ausgesetzt, dass der Kontrahent der Transaktion seinen vertraglichen Verpflichtungen gegenüber der jeweils anderen Partei nicht nachkommt, da viele der im Rahmen zentral abgerechneter Derivattransaktionen geltenden Schutzmechanismen für OTC-Derivatgeschäfte gegebenenfalls nicht zur Verfügung stehen. Für derivative Finanzinstrumente, die an Börsen oder über Clearingstellen gehandelt werden, betrifft das primäre Kreditrisiko die Bonität des Clearing-Brokers des Fonds bzw. der Börse oder Clearingstelle selbst. Die Fonds können Geld verlieren, wenn der Emittent oder Garant eines Rentenwerts oder der Kontrahent eines Finanzderivats, Pensionsgeschäfts oder eines Darlehens von Portfoliowertpapieren nicht in der Lage oder nicht bereit ist, Kapital- und/oder Zinszahlungen rechtzeitig vorzunehmen oder anderweitig seinen Verpflichtungen nachzukommen. Wertpapiere und Finanzderivate unterliegen Kreditrisiken unterschiedlichen Grades, die sich oft in den Bonitätsbewertungen widerspiegeln.

Wie beim Kreditrisiko können die Fonds dem Kontrahentenrisiko oder dem Risiko ausgesetzt sein, dass eine Organisation oder eine andere Einheit, mit der die Fonds unbeglichene oder offene Transaktionen haben, säumig wird. PIMCO und die Anlageberatungsgesellschaften minimieren die Kontrahentenrisiken der Fonds auf mehrere Arten. Vor Abschluss einer Transaktion mit einem neuen Kontrahenten führt das Counterparty Risk Committee (Ausschuss für Kontrahentenrisiken) von PIMCO eine umfassende Bonitätsprüfung des Kontrahenten durch und muss die Verwendung des betreffenden vorab Kontrahenten genehmigen. Darüber hinaus gilt gemäß den Bestimmungen des zugrundeliegenden Vertrags: wenn nicht eingezahlte Beträge, die einem Fonds geschuldet werden, eine vorab festgelegte Schwelle überschreiten, muss dieser Kontrahent dem Fonds Sicherheiten in Form von Barmitteln oder Wertpapieren in der Höhe vorschießen, die dem Wert des nicht eingezahlten und dem Fonds geschuldeten Betrags entsprechen. Der Fonds darf diese Sicherheiten in Wertpapiere oder andere Instrumente anlegen und zahlt dem Kontrahenten gewöhnlich Zinsen auf die erhaltenen Sicherheiten. Verringert sich der einem jeden Fonds geschuldete Betrag später, wäre der Fonds verpflichtet, die zuvor gestellten Sicherheiten ganz oder teilweise an den Kontrahenten zurückzugeben.

Alle Geschäfte mit notierten Wertpapieren werden bei Lieferung durch zugelassene Kontrahenten abgewickelt/bezahlt. Das Zahlungsunfähigkeitsrisiko gilt als minimal, da die Lieferung der verkauften Wertpapiere ausschließlich erfolgt, wenn die Fonds die Zahlung erhalten haben. Die Zahlung für einen Kauf erfolgt, sobald der Kontrahent die Wertpapiere geliefert hat. Das Geschäft schlägt fehl, wenn eine der Parteien ihre Verpflichtungen nicht erfüllt.

**Rahmenaufrechnungsverträge** Bestimmte Fonds unterliegen gegebenenfalls unterschiedlichen Rahmenaufrechnungsvereinbarungen („Rahmenverträge“) mit ausgewählten Kontrahenten. Die Rahmenverträge legen die Bedingungen bestimmter Transaktionen fest und verringern das Kontrahentenrisiko, das mit den jeweiligen Transaktionen verbunden ist, indem Schutzmechanismen für die Kreditrisikoerhöhung sowie Standardisierungen eingesetzt werden, die die rechtliche Sicherheit erhöhen. Jede Art von Rahmenvertrag regelt bestimmte Arten von Transaktionen. Verschiedene Arten von Transaktionen können von verschiedenen Körperschaften oder verbundenen Parteien einer bestimmten Organisation gehandelt werden, was zur Folge hat, dass mit ein und demselben Kontrahenten mehrere Vereinbarungen notwendig sind. Da die Rahmenverträge für individuelle Aspekte unterschiedlicher Vermögensarten spezifisch sind, ist den Fonds im Verzugsfall hinsichtlich aller einem einzigen Rahmenvertrag mit einem Kontrahenten unterliegenden Transaktionen eine Glatstellung und Aufrechnung des Gesamtengagement bei einem Kontrahenten möglich. Für Zwecke der Finanzberichterstattung werden derivative Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

31. Dez. 2020		31. Dez. 2019	
Name des Anteilinhabers	Beteiligung in %	Name des Anteilinhabers	Beteiligung in %
Anteilinhaber L	30,96	Anteilinhaber L	29,77
Anteilinhaber I	60,79	Anteilinhaber I	67,80
Anteilinhaber J	74,29	Anteilinhaber J	72,26
Anteilinhaber S	21,08	Anteilinhaber S	21,25
Anteilinhaber P	35,53	Anteilinhaber P	20,50
Anteilinhaber V	25,88	Anteilinhaber V	k. A.
Anteilinhaber C	k. A.	Anteilinhaber C	22,36
Anteilinhaber Q	k. A.	Anteilinhaber Q	32,17
Anteilinhaber B	21,74	Anteilinhaber B	22,69
Anteilinhaber X	47,33	Anteilinhaber X	k. A.
Anteilinhaber H	31,45	Anteilinhaber H	30,22
Anteilinhaber R	k. A.	Anteilinhaber R	33,51
Anteilinhaber Z	27,53	Anteilinhaber Z	k. A.

im Finanzstatus grundsätzlich auf Bruttobasis ausgewiesen, was die vollständigen Risiken und Engagements vor Saldierung abbildet.

Rahmenverträge können zu einer Verringerung des Kontrahentenrisikos beitragen, indem Vereinbarungen über das Stellen von Sicherheiten bei vorher festgelegten Risikoniveaus vorgegeben werden. Laut den meisten Rahmenverträgen werden Sicherheiten routinemäßig übertragen, wenn das Nettoengagement insgesamt bei bestimmten Transaktionen (ohne die bereits bestehenden Sicherheiten), die dem betreffenden Rahmenvertrag mit einem Kontrahenten unterliegen, in einem bestimmten Konto über eine bestimmte Schwelle hinausgeht, die normalerweise zwischen Null bis 250.000 USD liegt, je nach dem Kontrahenten und der Art des Rahmenvertrags. United States Treasury Bills und Barmittel in US-Dollar sind im Allgemeinen die bevorzugten Formen von Sicherheiten, obwohl in Abhängigkeit von den im jeweiligen Rahmenvertrag festgelegten Bedingungen auch andere Formen von mit AAA bewerteten Wertpapieren oder staatliche Schuldtitel verwendet werden können. Wertpapiere und Barmittel, die als Sicherheiten verwendet werden, werden im Finanzstatus als Vermögenswerte entweder als eine Komponente in dem ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten Finanzvermögen (übertragbare Wertpapiere) oder als Einlagen bei Kontrahenten (Barmittel) ausgewiesen. Erhaltene Barsicherheiten werden üblicherweise nicht in einem gesonderten Konto gehalten und werden somit im Finanzstatus als Verbindlichkeit als Einlagen von Kontrahenten ausgewiesen. Der Marktwert von als Sicherheiten erhaltene Wertpapiere wird nicht als Komponente des NIW ausgewiesen. Das allgemeine Kontrahentenrisiko für die Fonds kann sich innerhalb kurzer Zeit erheblich ändern, da es sich mit jeder Transaktion gemäß dem jeweiligen Rahmenvertrag ändert.

Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte und globale Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte (einzeln und zusammen „Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte“) regeln Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und Sale-Buyback-Geschäfte zwischen den Fonds und ausgewählten Kontrahenten. Die Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte enthalten unter anderem Bestimmungen für den Abschluss, Ertragszahlungen, Verzugsereignisse sowie die Bereitstellung von Sicherheiten. Der Marktwert von Transaktionen gemäß dem Rahmenvertrag für Pensionsgeschäfte, die verpfändeten oder erhaltenen Sicherheiten und das Nettoengagement je Kontrahent zum Ende des Geschäftsjahres sind in den Erläuterungen zur Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen.

Rahmenverträge für Wertpapier-Termingeschäfte („Rahmenverträge für Termingeschäfte“) regeln bestimmte in der Zukunft liegende Abwicklungen, wie TBA-(to-be-announced)-, Delayed-Delivery- oder Sale-Buyback-Geschäfte zwischen den Fonds und ausgewählten Kontrahenten. Die Rahmenverträge für Wertpapier-Termingeschäfte enthalten unter anderem Bestimmungen für den Abschluss und die Bestätigung, die Zahlung und Übertragung, Säumigkeit, die Beendigung sowie die Bereitstellung von Sicherheiten. Der Marktwert von Transaktionen mit in der Zukunft liegender Abwicklungen, die verpfändeten oder erhaltenen Sicherheiten und das Nettoengagement je Kontrahent zum Ende des Geschäftsjahres sind in den Erläuterungen zur Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen.

Die Rahmenverträge und Besicherungsanhänge (Credit Support Annexes) der International Swaps and Derivatives Association, Inc. („ISDA-Rahmenverträge“) regeln OTC-Derivatgeschäfte zwischen den Fonds und ausgewählten Kontrahenten. Die ISDA-Rahmenverträge enthalten Bestimmungen zu allgemeinen Verpflichtungen, Zusicherungen, Vereinbarungen, Sicherheiten und Säumigkeit bzw. Auflösung. Ereignisse, die zur Kündigung des Vertrags führen, umfassen Umstände, die Kontrahenten dazu ermächtigen können, den Vertrag vorzeitig zu beenden und die Begleichung aller ausstehenden Transaktionen nach dem geltenden ISDA-Rahmenvertrag einzuleiten. Eine Entscheidung, den Vertrag vorzeitig zu beenden, könnte sich wesentlich auf den Abschluss auswirken. Unter bestimmten Umständen kann der ISDA-Rahmenvertrag weitere

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Bestimmungen enthalten, wodurch zusätzlicher Kontrahentenschutz entsteht, der über den Schutz des täglich vorhandenen Risikos hinausgeht, wenn sich die Kreditqualität des Kontrahenten unter ein vorab festgelegtes Niveau verringert. Diese etwaigen Beträge können bei einer dritten Verwahrstelle gesondert gehalten werden. Der Marktwert von OTC-Finanzderivaten, die erhaltenen oder verpfändeten Sicherheiten und das Nettoengagement je Kontrahent zum Ende des Geschäftsjahres sind in den Erläuterungen zur Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen. Die Anlageberatungsgesellschaft führt

umfangreiche Recherchen und Analysen durch, um das Kreditrisiko der Fonds zu bestimmen und zu messen. Die Anlageberatungsgesellschaft überprüft ständig das Kreditrisiko der Fonds, um Erträge zu erzielen, indem Anlagen entweder vorgenommen oder gemieden werden. Wertpapiere unterliegen Kreditrisiken unterschiedlichen Grades, die sich oft in den Bonitätsbewertungen widerspiegeln. Die Tabelle unten fasst die Gestaltung der Bonität des Nettovermögens der einzelnen Fonds zusammen.

	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund		PIMCO Capital Securities Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	33 %	39 %	63 %	75 %	70 %	64 %
Non-Investment Grade	67 %	61 %	37 %	25 %	30 %	36 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	84 %	k. A.	98 %	98 %	46 %	50 %
Non-Investment Grade	16 %	k. A.	2 %	2 %	54 %	50 %
Nicht bewertet	0 %	k. A.	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	k. A.	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund		Dynamic Bond Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	77 %	75 %	67 %	71 %	81 %	85 %
Non-Investment Grade	23 %	25 %	33 %	29 %	19 %	15 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund		Emerging Markets Bond Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	96 %	91 %	76 %	80 %	60 %	64 %
Non-Investment Grade	4 %	9 %	24 %	20 %	40 %	36 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	55 %	60 %	56 %	59 %	66 %	79 %
Non-Investment Grade	45 %	40 %	44 %	41 %	34 %	21 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	77 %	80 %	98 %	97 %	97 %	99 %
Non-Investment Grade	23 %	20 %	2 %	3 %	3 %	1 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	79 %	86 %	99 %	99 %	93 %	96 %
Non-Investment Grade	21 %	14 %	1 %	1 %	7 %	4 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities		Global Advantage Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	43 %	k. A.	95 %	92 %	91 %	91 %
Non-Investment Grade	57 %	k. A.	5 %	8 %	9 %	9 %
Nicht bewertet	0 %	k. A.	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	k. A.	100 %	100 %	100 %	100 %

	Global Advantage Real Return Fund		Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	k. A.	92 %	96 %	96 %	96 %	96 %
Non-Investment Grade	k. A.	8 %	4 %	4 %	4 %	4 %
Nicht bewertet	k. A.	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	k. A.	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	Global Bond Ex-US Fund		PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		Global High Yield Bond Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	94 %	95 %	92 %	93 %	17 %	25 %
Non-Investment Grade	6 %	5 %	8 %	7 %	83 %	75 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Libor Plus Bond Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	89 %	93 %	92 %	95 %	90 %	93 %
Non-Investment Grade	11 %	7 %	8 %	5 %	10 %	7 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund		Income Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	99 %	99 %	98 %	98 %	76 %	77 %
Non-Investment Grade	1 %	1 %	2 %	2 %	24 %	23 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	Inflation Strategy Fund		Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	92 %	89 %	99 %	100 %	93 %	97 %
Non-Investment Grade	8 %	11 %	1 %	0 %	7 %	3 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	Low Duration Income Fund		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		Mortgage Opportunities Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	79 %	84 %	100 %	100 %	86 %	83 %
Non-Investment Grade	21 %	16 %	0 %	0 %	14 %	17 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	PIMCO RAE Emerging Markets Fund		PIMCO RAE Europe Fund		PIMCO RAE Global Developed Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	k. A.	100 %	k. A.	100 %	k. A.	100 %
Non-Investment Grade	k. A.	0 %	k. A.	0 %	k. A.	0 %
Nicht bewertet	k. A.	0 %	k. A.	0 %	k. A.	0 %
	k. A.	100 %	k. A.	100 %	k. A.	100 %

  

	PIMCO RAE US Fund		PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund		PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	k. A.	100 %	k. A.	100 %	k. A.	100 %
Non-Investment Grade	k. A.	0 %	k. A.	0 %	k. A.	0 %
Nicht bewertet	k. A.	0 %	k. A.	0 %	k. A.	0 %
	k. A.	100 %	k. A.	100 %	k. A.	100 %

  

	PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund		PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund		StocksPLUS™ Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	k. A.	100 %	k. A.	100 %	99 %	99 %
Non-Investment Grade	k. A.	0 %	k. A.	0 %	1 %	1 %
Nicht bewertet	k. A.	0 %	k. A.	0 %	0 %	0 %
	k. A.	100 %	k. A.	100 %	100 %	100 %

	PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	94 %	86 %	78 %	80 %	94 %	98 %
Non-Investment Grade	6 %	14 %	22 %	20 %	6 %	2 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	99 %	97 %	95 %	93 %	95 %	94 %
Non-Investment Grade	1 %	3 %	5 %	7 %	5 %	6 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

  

	US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund	
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019
Investment Grade	19 %	18 %	91 %	95 %	99 %	99 %
Non-Investment Grade	81 %	82 %	9 %	5 %	1 %	1 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

Im Wesentlichen werden alle Wertpapiere der Gesellschaft zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 von State Street Custodial Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) treuhänderisch gehalten. Diese Vermögenswerte werden in gesonderten Konten für jeden Fonds (in Übereinstimmung mit den OGAW-Richtlinien der Zentralbank) gehalten, was das Ausfallrisiko für den Besitz der aufbewahrten Vermögenswerte reduziert. Die Gesellschaft ist jedoch dem Kreditrisiko eines Kreditinstituts ausgesetzt, das ihre Einlagen hält.

Das langfristige Bonitätsrating der State Street Corporation, der obersten Muttergesellschaft der Verwahrstelle, war zum 31. Dezember 2020 AA- (31. Dezember 2019: AA-), ausgestellt von der Ratingagentur Fitch.

#### 17. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN FÜR DIE IN HONGKONG VERTRIEBENEN FONDS

Verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind jene, die im Code on Unit Trusts and Mutual Funds der Securities and Futures Commission of Hong Kong (der „SFC-Code“) definiert sind. Alle Transaktionen, die während des Geschäftsjahres zwischen den durch die SFC zugelassenen Fonds („durch die SFC zugelassene Fonds“), wie im Abschnitt zu den allgemeinen Merkmalen des Abschlusses beschrieben, und der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften und/oder den Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und den Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft sowie deren jeweiligen verbundenen Personen eingegangen wurden, wurden im Rahmen der normalen Geschäftstätigkeit und zu den üblichen Geschäftsbedingungen abgeschlossen.

Folgende Transaktionen wurden in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 über einen Broker ausgeführt, bei dem es sich um eine verbundene Person der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft handelt:

Fonds	31. Dez. 2020		31. Dez. 2019	
	Summe Käufe und Verkäufe ('000)	% Summe Käufe und Verkäufe	Summe Käufe und Verkäufe ('000)	% Summe Käufe und Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 1.206.572	20,07	\$ 531.424	25,59
Asia Strategic Interest Bond Fund	205.602	20,18	108.306	21,08
Commodity Real Return Fund	699.704	2,31	511.576	2,18
Diversified Income Fund	18.637.753	2,41	12.755.390	1,93
Emerging Local Bond Fund	2.998.245	3,19	1.761.432	2,19
Emerging Markets Bond Fund	2.180.400	3,97	1.889.867	6,43
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	293.553	6,07	185.145	4,40
Global Bond Fund	20.135.083	3,22	12.068.196	2,47
Global High Yield Bond Fund	1.090.534	1,22	1.736.881	1,40
Global Investment Grade Credit Fund	11.224.941	2,34	6.043.656	1,53
Global Real Return Fund	4.218.359	3,38	2.262.610	3,08
Income Fund	37.069.660	2,17	46.364.144	3,16
Low Average Duration Fund	812.219	1,59	565.526	1,36
Total Return Bond Fund	4.408.963	1,96	3.074.203	1,58
US High Yield Bond Fund	1.680.957	3,11	1.506.252	1,30

Es wurde in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 keine Provision für die Transaktionen in der vorstehenden Tabelle erhoben.

Einzelheiten zu Aktien, die in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 durch Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft in durch die SFC zugelassenen Fonds gehalten wurden, sind Erläuterung 14 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 an Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft gezahlt wurden, sind Erläuterung 13 zu entnehmen.

Einzelheiten zum Wert der umlaufenden Anteile, die in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 durch verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften gehalten wurden und über 20 % des Nettovermögens von durch die SFC zugelassenen Fonds betragen, sind

Erläuterung 14 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die an die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften gezahlt wurden, sind Erläuterung 13 und der Betriebsergebnisrechnung zu entnehmen.

Verwaltungsratsmitglieder und leitende Angestellte der Verwahrstelle hielten in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 keine Anteile der durch die SFC zugelassenen Fonds. Wie in Erläuterung 13 angegeben, wurden die Gebühren und Aufwendungen der Verwahrstelle durch die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr oder durch die Anlageberatungsgesellschaften gezahlt. Wie in Erläuterung 4 angegeben, wurden alle Bankguthaben der durch die SFC zugelassenen Fonds entweder von State Street Bank and Trust Co., in ihrer Eigenschaft als

Vertreterin der Verwahrstelle, oder direkt bei einer Unterverwahrstelle gehalten. Gegebenenfalls wurden den durch die SFC zugelassenen Fonds durch die Verwahrstelle Zinsen auf diese Barsalden gezahlt oder berechnet.

## 18. 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 Fonds. Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile werden auf Antrag des Anteilinhabers zurückgenommen und sind als Finanzverbindlichkeiten klassifiziert. Die Anzahl der gewinnberechtigten Anteile hat sich während der zum 31. Dezember 2020 und 31. Dezember 2019 endenden Geschäftsjahre wie folgt verändert (Angaben in Tausend):

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund</b>		
Institutional:		
thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	24.124	3.654
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.141)	(593)
	19.983	3.061
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	3.883	889
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(614)	(1)
	3.275	888
Institutional CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	586	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	586	k. A.
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	83	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	83	k. A.
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	4.977	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.315)	k. A.
	3.662	k. A.
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.125	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5)	k. A.
	1.120	k. A.
Investor:		
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	6.506	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	6.506	k. A.

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)</b>		
Investor AUD (Hedged):		
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	35	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	35	k. A.
Investor EUR (Hedged):		
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	22	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	22	k. A.
Investor RMB (Hedged):		
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	81	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	81	k. A.
Investor SGD (Hedged):		
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	115	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	115	k. A.
Administrative:		
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.213	572
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10)	0
	1.203	572
Class E:		
thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	624	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	624	k. A.
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.326	1.467
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	19	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.373)	(1)
	972	1.468
Class E CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	9	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	9	k. A.
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	3	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	3	k. A.
Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.938	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1.938	k. A.

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Asia Strategic Interest Bond Fund (Fortsetzung)</b>	
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	99	k. A.		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	412	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	0	k. A.
	99	k. A.	0	k. A.
Class E HKD (Unhedged):			412	k. A.
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	71	197		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	1	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29)	0	0	k. A.
	42	197	0	k. A.
Class E SGD (Hedged):			1	k. A.
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1.725	743	1.035	523
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	14	3	2	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.096)	(178)	(672)	(835)
	643	568	365	(310)
M Retail:				
ausschüttend II				
Ausgegeben und aufgerechnet	915	477	531	478
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	13	1	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(187)	0	(260)	(111)
	741	478	271	367
M Retail HKD (Unhedged):				
ausschüttend II				
Ausgegeben und aufgerechnet	249	8	8	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(101)	0	0	k. A.
	149	8	8	k. A.
M Retail SGD (Hedged):				
ausschüttend II				
Ausgegeben und aufgerechnet	519	336	35	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	1	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(133)	(21)	0	k. A.
	392	316	35	k. A.
Class Z:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	18.701	13.673		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.260)	(68)		
	15.441	13.605		
<b>Asia Strategic Interest Bond Fund</b>			<b>PIMCO Capital Securities Fund</b>	
Institutional:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	11.220	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(2)	0	k. A.
	k. A.	(2)	11.220	k. A.
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	362	k. A.	68.162	51.529
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	(49.518)	(20.991)
	362	k. A.	18.644	30.538
Institutional EUR (Unhedged):				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	30.464	52.636
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	6	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(2)	(60.750)	(9.963)
	k. A.	(2)	(30.280)	42.678

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)			PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)	
Institutional BRL (Hedged): thesaurierend			Investor AUD (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	259	254	Ausgegeben und aufgerechnet	1.238	986
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(54)	(172)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(283)	0
	205	82		955	986
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend			Investor CAD (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.359	552	Ausgegeben und aufgerechnet	5	34
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(762)	(616)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5)	(20)
	597	(64)		1	15
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend			Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	66.437	48.656	Ausgegeben und aufgerechnet	1.952	716
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(81.642)	(48.891)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(925)	(1.422)
	(15.205)	(235)		1.027	(706)
ausschüttend			Investor GBP (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	5.693	5.422	Ausgegeben und aufgerechnet	211	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	2	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.313)	(744)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	387	4.680		211	k. A.
ausschüttend II			Investor RMB (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	430	1.236	Ausgegeben und aufgerechnet	5	848
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.931)	(317)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(474)	(70)
	(4.501)	919		(468)	779
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			Investor SGD (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	352	1.115	Ausgegeben und aufgerechnet	116	372
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(753)	(1.633)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(101)	(11)
	(401)	(518)		15	361
ausschüttend			Administrative: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	3.809	4.117	Ausgegeben und aufgerechnet	5.458	4.423
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	64	32	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.467)	(1.796)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.291)	(3.320)
	406	2.353		(833)	1.103
Institutional SGD (Hedged): ausschüttend II			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	2.950	3.755
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(76)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.971)	(2.207)
	k. A.	(76)		(2.018)	1.551
Investor: thesaurierend			Administrative EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	6.726	3.662	Ausgegeben und aufgerechnet	495	270
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.530)	(8.494)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(887)	(722)
	(804)	(4.832)		(392)	(452)
ausschüttend			Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	7.725	6.520	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.267)	(3.167)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(36)
	(1.542)	3.353		k. A.	(36)

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)</b>				
<b>Class E:</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	13.278	8.777		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.504)	(8.041)		
	(226)	736		
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1.278	3.244		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	25	15		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.787)	(2.552)		
	(2.484)	707		
<b>Class E CHF (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	157	238		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(270)	(350)		
	(113)	(112)		
<b>Class E EUR (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	10.725	8.417		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.552)	(16.290)		
	(6.827)	(7.873)		
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1.171	2.547		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.164)	(2.001)		
	(2.993)	546		
<b>M Retail:</b>				
ausschüttend II				
Ausgegeben und aufgerechnet	6.656	10.098		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	2		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.353)	(11.422)		
	(4.694)	(1.322)		
<b>M Retail HKD (Unhedged):</b>				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	0	1.123		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.028)	(1.380)		
	(1.028)	(257)		
<b>M Retail SGD (Hedged):</b>				
ausschüttend II				
Ausgegeben und aufgerechnet	3.700	1.015		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	12		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.536)	(1.878)		
	2.170	(851)		
<b>Class R:</b>				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	189	1.118		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(813)	(640)		
	(624)	478		
<b>Class R EUR (Hedged):</b>				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	714	321		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.689)	(364)		
	(975)	(43)		
<b>PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)</b>				
<b>Class R GBP (Hedged):</b>				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	83	3		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	7		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(51)	(161)		
	39	(151)		
<b>Class T:</b>				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	376	312		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	4		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(261)	(188)		
	120	128		
<b>Class T EUR (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1.120	3.646		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.595)	(1.372)		
	(1.475)	2.274		
<b>Class Z:</b>				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	51	2.114		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	264	384		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.405)	(1.424)		
	(3.090)	1.074		
<b>Class Z AUD (Hedged):</b>				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	2.301	4.786		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	475	396		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.278)	(979)		
	498	4.203		
<b>PIMCO Climate Bond Fund</b>				
<b>Institutional:</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	449	k. A.		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.		
	449	k. A.		
<b>Institutional CHF (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	23	k. A.		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.		
	23	k. A.		
<b>Institutional EUR (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1.646	k. A.		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.		
	1.646	k. A.		
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	5.992	k. A.		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.		
	5.992	k. A.		

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>PIMCO Climate Bond Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Commodity Real Return Fund (Fortsetzung)</b>	
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	169	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	2.097	1.645
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.195)	(2.015)
	169	k. A.		(98)	(370)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			G Institutional EUR (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	50	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	0	5
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7)	(7)
	50	k. A.		(7)	(2)
Class Z: thesaurierend				<b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>	
Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.	Institutional: thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	521	961
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	1	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(759)	(469)
				(238)	492
	<b>Commodity Real Return Fund</b>		Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Institutional: thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	0	23
Ausgegeben und aufgerechnet	16.915	20.931	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23)	(76)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(59.265)	(16.779)		(23)	(53)
	(42.350)	4.152			
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend			Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	5.175	35	Ausgegeben und aufgerechnet	1.258	162
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(637)	(617)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(600)	(198)
	4.538	(582)		658	(36)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			ausschüttend II		
Ausgegeben und aufgerechnet	3.083	1.460	Ausgegeben und aufgerechnet	0	48
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.075)	(963)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(78)	(16)
	8	497		(78)	33
Investor: thesaurierend			Investor: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.597	292	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.916)	(2.146)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	(319)	(1.854)		k. A.	(1)
Class E: thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	3.000	1.777	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.900)	(6.277)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	(900)	(4.500)		k. A.	(1)
ausschüttend			Class E: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	107	Ausgegeben und aufgerechnet	552	550
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(483)	(176)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.107)	(725)
	(483)	(69)		(555)	(175)
			Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	149	143
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.224)	(414)
				(1.075)	(271)

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Fortsetzung)</b>		<b>Diversified Income Fund (Fortsetzung)</b>	
<b>Class T EUR (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	0	27		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(103)	(41)		
	(103)	(14)		
	<b>Diversified Income Fund</b>			
<b>Institutional:</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	29.190	31.188		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23.937)	(13.303)		
	5.253	17.885		
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	37.146	23.155		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	187	68		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.594)	(966)		
	23.739	22.257		
<b>Institutional CAD (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	34.510	6.580		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.890)	(1.049)		
	30.620	5.531		
<b>Institutional CHF (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1.038	706		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.022)	(164)		
	16	542		
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1.739	591		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(453)	(78)		
	1.286	513		
<b>Institutional EUR (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	60.724	30.674		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(28.896)	(17.953)		
	31.828	12.721		
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	25.124	36.579		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	391	669		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(32.066)	(2.094)		
	(6.551)	35.154		
<b>Institutional GBP (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	40.684	13.354		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.599)	(17.031)		
	36.085	(3.677)		
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	63.879	22.136		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	520	637		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29.325)	(9.046)		
	35.074	13.727		
<b>Institutional MXN (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	53	k. A.		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.		
	53	k. A.		
<b>Institutional SEK (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	(331)		
	(1)	(331)		
<b>Institutional SGD (Hedged):</b>				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	2.593	858		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(506)	0		
	2.088	858		
<b>Investor:</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	2.927	1.705		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.337)	(584)		
	1.590	1.121		
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	2.635	1.524		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	5		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(458)	(417)		
	2.183	1.112		
<b>Investor EUR (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1.111	715		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(659)	(210)		
	452	505		
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	461	151		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(83)		
	461	68		
<b>Administrative:</b>				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	8.890	5.312		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	16	10		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.877)	(621)		
	6.029	4.701		
<b>Administrative AUD (Hedged):</b>				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	439	2		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30)	0		
	411	2		
<b>Administrative EUR (Hedged):</b>				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	532	478		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(281)	(126)		
	251	352		

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Diversified Income Fund (Fortsetzung)			Diversified Income Fund (Fortsetzung)	
Administrative GBP (Hedged):			ausschüttend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	2	k. A.
Ausgegeben und aufgerechnet	774	134	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(87)	(63)		2	k. A.
	687	71	M Retail:		
Administrative SEK (Hedged):			ausschüttend		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	20.623	34.637
Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	95	75
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21.319)	(14.739)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.		(601)	19.973
	1	k. A.	ausschüttend II		
Administrative SGD (Hedged):			Ausgegeben und aufgerechnet	67.100	39.293
ausschüttend			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	25	10
Ausgegeben und aufgerechnet	11.708	4.202	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(39.800)	(24.403)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	14	3		27.325	14.900
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.987)	(249)	M Retail AUD (Hedged):		
	8.735	3.956	ausschüttend		
Class E:			Ausgegeben und aufgerechnet	12.039	7.952
thesaurierend			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	8	8
Ausgegeben und aufgerechnet	49.951	23.742	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.972)	(3.444)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		7.075	4.516
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25.445)	(6.638)	N Retail:		
	24.506	17.104	ausschüttend II		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.
Ausgegeben und aufgerechnet	48.063	50.644	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	135	166	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(37.386)	(40.411)		1	k. A.
	10.812	10.399	Class R:		
Class E CHF (Hedged):			ausschüttend		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Ausgegeben und aufgerechnet	734	178	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(159)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(191)	0		k. A.	(159)
	543	178	Class T:		
Class E EUR (Hedged):			thesaurierend		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	1.462	1.154
Ausgegeben und aufgerechnet	59.936	36.891	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(468)	(195)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(31.688)	(8.710)		994	959
	28.248	28.181	ausschüttend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	586	236
Ausgegeben und aufgerechnet	36.549	73.151	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	8	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(112)	(99)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23.405)	(10.217)		478	138
	13.150	62.942	Class T EUR (Hedged):		
Class E SGD (Hedged):			thesaurierend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	2.078	1.798
Ausgegeben und aufgerechnet	8.249	1.022	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(945)	(452)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.294)	0		1.133	1.346
	6.955	1.022	ausschüttend		
H Institutional:			Ausgegeben und aufgerechnet	958	2.197
thesaurierend			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Ausgegeben und aufgerechnet	32.256	39.165	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.055)	(371)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		(97)	1.826
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(20.660)	(4.163)			
	11.596	35.002			

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Diversified Income Fund (Fortsetzung)			Diversified Income Duration Hedged Fund	
Class W:			Institutional:		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	4.534	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	2.023	2.756
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(81)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.807)	(7.247)
	4.453	k. A.		(3.784)	(4.491)
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	3.617	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	0	86
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(62)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(62)	(313)
	3.555	k. A.		(62)	(227)
Class W CAD (Hedged):			Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	4.591	3.629
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.049)	(3.171)
	1	k. A.		542	458
Class W CHF (Hedged):			ausschüttend II		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	622	4.339
Ausgegeben und aufgerechnet	1.240	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.933)	(8.226)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11)	k. A.		(1.311)	(3.887)
	1.229	k. A.	Institutional GBP (Hedged):		
ausschüttend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	9.536	4.521
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.749)	(1.761)
	1	k. A.		1.787	2.760
Class W EUR (Hedged):			ausschüttend		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	21.478	247
Ausgegeben und aufgerechnet	1.042	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(430)	(1.329)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14)	k. A.		21.048	(1.082)
	1.028	k. A.	Investor:		
ausschüttend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	757	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	368	55
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(57)	(849)
	756	k. A.		311	(794)
Class W GBP (Hedged):			ausschüttend		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	0	51
Ausgegeben und aufgerechnet	40	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	2
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25)	(187)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.		(25)	(134)
	40	k. A.	Class E:		
ausschüttend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	75	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	1.633	750
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.160)	(1.756)
	75	k. A.		473	(1.006)
Class W SGD (Hedged):			ausschüttend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	180	459
Ausgegeben und aufgerechnet	330	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	12	18
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.151)	(988)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.		(959)	(511)
	330	k. A.			

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Diversified Income Duration Hedged Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)</b>		
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	5.408	7.916	Ausgegeben und aufgerechnet	19.615	22.236
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.498)	(8.847)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21.637)	(11.312)
	(2.090)	(931)		(2.022)	10.924
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	441	1.231	Ausgegeben und aufgerechnet	1.893	23.107
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	111	231
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.134)	(1.840)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(713)	(713)
	(1.693)	(609)		1.291	22.625
Class R:			Institutional NOK (Hedged): thesaurierend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	91	2.511
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(54)	(7.243)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(155)		37	(4.732)
		(155)	Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Class T:			Ausgegeben und aufgerechnet	162	64
thesaurierend			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Ausgegeben und aufgerechnet	0	185	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(364)	(1)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		(202)	63
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(207)	(142)	Investor:		
	(207)	43	thesaurierend		
<b>Dynamic Bond Fund</b>			Ausgegeben und aufgerechnet	585	2.068
Institutional:			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
thesaurierend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.176)	(1.805)
Ausgegeben und aufgerechnet	7.803	21.045		(1.591)	263
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	ausschüttend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(40.868)	(14.047)	Ausgegeben und aufgerechnet	92	206
	(33.065)	6.998	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	7
ausschüttend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(237)	(148)
Ausgegeben und aufgerechnet	1.946	4.024		(141)	65
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	8	7	Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.503)	(98)	Ausgegeben und aufgerechnet	406	33
	(1.549)	3.933	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Institutional CAD (Hedged): thesaurierend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(237)	(313)
Ausgegeben und aufgerechnet	3	3		169	(280)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Administrative: thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(258)	(420)	Ausgegeben und aufgerechnet	570	373
	(255)	(417)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(500)	(568)
Ausgegeben und aufgerechnet	35	398		70	(195)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Administrative EUR (Hedged): thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(154)	(143)	Ausgegeben und aufgerechnet	3	473
	(119)	255	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(496)	(437)
Ausgegeben und aufgerechnet	9.596	32.765		(493)	36
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30.520)	(23.377)	Ausgegeben und aufgerechnet	30	68
	(20.924)	9.388	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
ausschüttend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(177)	(380)
Ausgegeben und aufgerechnet	519	709		(147)	(312)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.583)	(804)			
	(1.064)	(95)			

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)</b>		
Class E:			Class Z AUD (Hedged):		
thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.004	3.829	Ausgegeben und aufgerechnet	1.160	786
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	126	191
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.947)	(2.759)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.104)	(2.405)
	(1.943)	1.070		(818)	(1.428)
ausschüttend			<b>Dynamic Multi-Asset Fund</b>		
Ausgegeben und aufgerechnet	275	1.310	Institutional:		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	12	thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.163)	(836)	Ausgegeben und aufgerechnet	133.848	17.841
	(881)	486	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Class E CHF (Hedged):			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25.997)	(28.066)
thesaurierend				107.851	(10.225)
Ausgegeben und aufgerechnet	43	82	ausschüttend II		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	17.503	714
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(306)	(308)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(263)	(226)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.462)	(386)
Class E EUR (Hedged):				16.041	328
thesaurierend			Institutional CHF (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.740	3.481	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	223	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.236)	(6.434)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(3.496)	(2.953)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
Class E GBP (Hedged):				223	0
thesaurierend			Institutional GBP (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	93	121	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	8.529	14.681
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(49)	(219)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	44	(98)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.815)	(507)
G Retail EUR (Hedged):				714	14.174
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	23	56	Ausgegeben und aufgerechnet	48	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.683)	(546)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1.660)	(490)		47	1
H Institutional:			Institutional USD (Hedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	712	116	Ausgegeben und aufgerechnet	9.561	1.103
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(389)	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(940)	(2.384)
	323	116		8.621	(1.281)
ausschüttend			Investor:		
Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	589	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
	1	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
Class R:				589	k. A.
thesaurierend			Class E:		
Ausgegeben und aufgerechnet	67	46	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	145.255	24.934
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(162)	(187)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(95)	(141)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(58.579)	(8.159)
ausschüttend				86.676	16.775
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	0	153
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(42)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	k. A.	(42)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(137)	(17)
				(137)	136

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Emerging Local Bond Fund (Fortsetzung)</b>	
ausschüttend			Institutional CHF (Unhedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	97	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	20	35
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24)	(11.142)
	97	k. A.		(4)	(11.107)
Class E USD (Hedged):			Institutional EUR (Unhedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	17.846	176	Ausgegeben und aufgerechnet	9.404	6.484
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.270)	(39)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.880)	(8.551)
	9.576	137		2.524	(2.067)
ausschüttend			ausschüttend		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	22.664	8.710
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	237	248
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(71.846)	(16.354)
	k. A.	(1)		(48.945)	(7.396)
H Institutional USD (Hedged):			Institutional GBP (Unhedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	7.073	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	88	1.682
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(575)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.855)	(1.895)
	6.498	k. A.		(3.767)	(213)
M Retail SGD (Hedged):			Investor:		
ausschüttend II			thesaurierend		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	34	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	1.687	2.688
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.464)	(2.144)
	34	k. A.		223	544
M Retail USD (Hedged):			Investor CHF (Unhedged):		
ausschüttend II			thesaurierend		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	13.890	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	0	2
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.433)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(121)	(34)
	7.457	k. A.		(121)	(32)
Class T:			Investor EUR (Unhedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	4.187	370	Ausgegeben und aufgerechnet	0	63
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(517)	(535)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(328)	0
	3.670	(165)		(328)	63
Class Z:			thesaurierend		
thesaurierend			thesaurierend		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.955	5.188	Ausgegeben und aufgerechnet	262	82
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(802)	(87)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(117)
	1.153	5.101		262	(35)
	<b>Emerging Local Bond Fund</b>		Class E:		
Institutional:			thesaurierend		
thesaurierend			thesaurierend		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	110.128	64.958	Ausgegeben und aufgerechnet	1.064	1.449
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(72.332)	(36.195)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.183)	(1.365)
	37.796	28.763		(119)	84
ausschüttend			ausschüttend		
thesaurierend			thesaurierend		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.937	743	Ausgegeben und aufgerechnet	560	750
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.035)	(1.133)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(666)	(714)
	902	(390)		(104)	39

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020		Zum 31. Dez. 2019			Zum 31. Dez. 2020		Zum 31. Dez. 2019	
	Emerging Local Bond Fund (Fortsetzung)					Emerging Markets Bond Fund (Fortsetzung)			
<b>Class E EUR (Unhedged):</b>					<b>Institutional GBP (Hedged):</b>				
thesaurierend					thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1.645		3.021		Ausgegeben und aufgerechnet	130		403	
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0		Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0	
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.375)		(2.706)		Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(543)		(217)	
	(730)		315			(413)		186	
ausschüttend					ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	3		4		Ausgegeben und aufgerechnet	4.570		7.584	
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0		Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	152		154	
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25)		(30)		Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.919)		(6.301)	
	(22)		(26)			(4.197)		1.437	
<b>Class T EUR (Unhedged):</b>					<b>Institutional SGD (Hedged):</b>				
thesaurierend					thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.		0		Ausgegeben und aufgerechnet	1.116		453	
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.		0		Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0	
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.		(29)		Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(293)		(38)	
	k. A.		(29)			823		415	
<b>Class Z:</b>					<b>Investor:</b>				
ausschüttend					thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	0		299		Ausgegeben und aufgerechnet	49		45	
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	143		200		Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0	
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0		(1.214)		Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(43)		(39)	
	143		(715)			6		6	
<b>Emerging Markets Bond Fund</b>					<b>Investor EUR (Hedged):</b>				
Institutional:					thesaurierend				
thesaurierend					Ausgegeben und aufgerechnet	0		46	
Ausgegeben und aufgerechnet	35.155		13.973		Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0	
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0		Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(93)		0	
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.230)		(8.651)			(93)		46	
	17.925		5.322		ausschüttend				
ausschüttend					Ausgegeben und aufgerechnet	395		43	
Ausgegeben und aufgerechnet	2.419		1.640		Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0	
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	63		70		Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(51)		(42)	
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.521)		(2.204)			344		1	
	961		(494)		<b>Administrative:</b>				
Institutional CHF (Hedged):					thesaurierend				
ausschüttend					Ausgegeben und aufgerechnet	141		103	
Ausgegeben und aufgerechnet	1.114		379		Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0	
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0		Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(78)		(99)	
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(146)		(248)			63		4	
	968		131		<b>Class E:</b>				
Institutional EUR (Hedged):					thesaurierend				
thesaurierend					Ausgegeben und aufgerechnet	2.817		1.917	
Ausgegeben und aufgerechnet	12.811		21.094		Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0	
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0		Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.526)		(1.017)	
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12.662)		(12.697)			1.291		900	
	149		8.397		ausschüttend				
ausschüttend					Ausgegeben und aufgerechnet	22.695		16.513	
Ausgegeben und aufgerechnet	32.305		41.532		Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	56		83	
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	442		412		Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(19.174)		(19.110)	
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(77.536)		(4.604)			3.577		(2.514)	
	(44.789)		37.340						
Institutional EUR (Unhedged):									
thesaurierend									
Ausgegeben und aufgerechnet	3.021		10.800						
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0		0						
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.118)		(1.852)						
	(97)		8.948						

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Emerging Markets Bond Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Emerging Markets Bond ESG Fund (Fortsetzung)</b>		
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.135	3.111	Ausgegeben und aufgerechnet	1.805	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.236)	(1.848)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	(101)	1.263		1.805	1
Class E SGD (Hedged): thesaurierend			Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	131	161	Ausgegeben und aufgerechnet	37.612	6.693
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(104)	(182)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12.789)	(5.816)
	27	(21)		24.823	877
H Institutional: thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	9.458	2.618	Ausgegeben und aufgerechnet	8.569	6.648
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.284)	(1.375)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14.235)	(1)
	5.174	1.243		(5.666)	6.647
ausschüttend			Institutional GBP (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	335	19
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14)	0
	1	k. A.		322	19
M Retail: ausschüttend			Institutional GBP (Unhedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.259	178	Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	14	16	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.195)	(812)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	78	(618)		1	k. A.
ausschüttend II			Investor NOK (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	23.173	19.301	Ausgegeben und aufgerechnet	29	18
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(22.718)	(19.261)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(37)	(9)
	457	41		(8)	9
M Retail AUD (Hedged): ausschüttend			Investor SEK (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	878	1.534	Ausgegeben und aufgerechnet	155	205
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	5	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(537)	(1.409)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(158)	(202)
	344	130		(3)	3
Class T EUR (Hedged): thesaurierend			Administrative: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	101	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(60)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	k. A.	(60)		101	1
Class Z: ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	113	Ausgegeben und aufgerechnet	27	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	24	40	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(469)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	24	(316)		27	1
<b>Emerging Markets Bond ESG Fund</b>			Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Institutional: thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	6.761	787
Ausgegeben und aufgerechnet	14.500	3.054	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(246)	(12)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.594)	(1.548)		6.515	775
	10.906	1.506			

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>		<b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Fortsetzung)</b>	
Institutional:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	2.110	2.829	3.422	12.700
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.407)	(2.461)	(747)	(66)
	(1.297)	368	2.675	12.634
Institutional EUR (Hedged):				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	5.930	2.337		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.618)	(1.482)		
	2.312	855		
Institutional GBP (Hedged):				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	0	4		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6)	(580)		
	(6)	(576)		
Administrative:				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(52)		
		(52)		
Class E:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	469	721		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(402)	(246)		
	67	475		
Class E CHF (Hedged):				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	23	59		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(172)	(352)		
	(149)	(293)		
Class E EUR (Hedged):				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	422	632		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(731)	(559)		
	(309)	73		
Class Z:				
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	92		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	15		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(426)		
	k. A.	(319)		
	<b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b>		<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>	
Institutional:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1.070	585		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(413)	(28)		
	657	557		
Institutional EUR (Partially Hedged):				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet				
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen				
Rücknahmen während des Geschäftsjahres				
Institutional:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	0	383		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(841)	(578)		
	(841)	(195)		
Institutional EUR (Unhedged):				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	2.204	1.575		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.829)	(155)		
	(1.625)	1.420		
Class E:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	81	138		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(150)	(232)		
	(69)	(94)		
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	0	190		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(271)	(149)		
	(271)	41		
Class E EUR (Unhedged):				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	274	543		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(335)	(517)		
	(61)	26		
	<b>Euro Bond Fund</b>		<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>	
Institutional:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	27.109	34.348		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24.081)	(18.064)		
	3.028	16.284		
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	7.233	20.076		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.792)	(2.244)		
	(559)	17.832		
Institutional CHF (Hedged):				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1.034	1.151		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.588)	(796)		
	(554)	355		

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Euro Bond Fund (Fortsetzung)</b>		<b>Euro Credit Fund (Fortsetzung)</b>	
Investor:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	523	917	1.484	9.187
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(275)	(367)	(9.336)	(1.004)
	248	550	(7.852)	8.183
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1	19		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9)	(15)		
	(8)	4		
Administrative:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	83	179		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(81)	(145)		
	2	34		
Class E:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	4.613	7.568		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.351)	(1.833)		
	1.262	5.735		
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet	1.918	2.902		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.982)	(794)		
	(64)	2.108		
Class T:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(107)		
	k. A.	(107)		
	<b>Euro Credit Fund</b>			
Institutional:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	31.269	25.851		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(15.386)	(26.270)		
	15.883	(419)		
ausschüttend II				
Ausgegeben und aufgerechnet	10.066	1.524		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	24	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.624)	(9.187)		
	7.466	(7.663)		
Class E:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	895	2.317		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.611)	(2.107)		
	(5.716)	210		
H Institutional:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet	9.910	20.917		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12.800)	(2.991)		
	(2.890)	17.926		
ausschüttend II				
Ausgegeben und aufgerechnet			1.484	9.187
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen			0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres			(9.336)	(1.004)
			(7.852)	8.183
Institutional:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet			37.618	62.672
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen			0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres			(31.450)	(22.374)
			6.168	40.298
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet			9.880	18.697
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen			144	91
Rücknahmen während des Geschäftsjahres			(13.453)	(8.685)
			(3.429)	10.103
Institutional USD (Hedged):				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet			k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen			k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres			k. A.	(6.029)
			k. A.	(6.029)
Investor:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet			683	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen			0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres			(69)	0
			614	1
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet			588	1.440
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen			1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres			(828)	(83)
			(239)	1.358
Class E:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet			23.735	67.401
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen			0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres			(21.458)	(18.957)
			2.277	48.444
ausschüttend				
Ausgegeben und aufgerechnet			9.919	32.162
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen			1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres			(21.251)	(12.012)
			(11.331)	20.150
Ausschüttend Q				
Ausgegeben und aufgerechnet			480	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen			0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres			(26)	0
			454	1
Class T:				
thesaurierend				
Ausgegeben und aufgerechnet			980	2.513
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen			0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres			(882)	(429)
			98	2.084

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Euro Income Bond Fund (Fortsetzung)</b>			<b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Fortsetzung)</b>		
ausschüttend Ausgegeben und aufgerechnet	693	1.220	H Institutional: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	11.455	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(487)	(464)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.999)	k. A.
	206	756		8.456	k. A.
<b>Euro Long Average Duration Fund</b>			<b>Global Advantage Fund</b>		
Institutional: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	2.080	2.704	Institutional: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	16	735
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.060)	(7.139)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(206)	(130)
	20	(4.435)		(190)	605
<b>Euro Short-Term Fund</b>			<b>Institutional CHF (Partially Hedged): ausschüttend</b>		
Institutional: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	64.333	22.429	Ausgegeben und aufgerechnet	5	3.294
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	145	307
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(31.865)	(24.459)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3)	(272)
	32.468	(2.030)		147	3.329
ausschüttend II Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	<b>Institutional DKK (Partially Hedged): thesaurierend</b>		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(10)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
	k. A.	(10)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(54.268)
<b>Class E:</b>			<b>Institutional EUR (Partially Hedged): thesaurierend</b>		
thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	1.741	3.788	Ausgegeben und aufgerechnet	4.388	7.401
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(28.404)	(7.327)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.049)	(21.526)
	(26.663)	(3.539)		339	(14.125)
<b>PIMCO European High Yield Bond Fund</b>			<b>Institutional GBP (Partially Hedged): thesaurierend</b>		
Institutional: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	918	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	0	275
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(2.562)
	918	k. A.		0	(2.287)
<b>Class Z:</b>			<b>Institutional NOK (Partially Hedged): thesaurierend</b>		
thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	14.501	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	144	5
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	14.501	k. A.		144	5
<b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b>			<b>Class E:</b>		
Institutional: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	9.226	13.153	thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	0	29
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(15.743)	(10.135)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(264)	(158)
	(6.517)	3.018		(264)	(129)
<b>Class E:</b>			<b>ausschüttend</b>		
thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	429	977	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.895)	(831)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(12)
	(1.466)	146		k. A.	(12)
			<b>Class E EUR (Partially Hedged): thesaurierend</b>		
			Ausgegeben und aufgerechnet	40	117
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(152)	(136)
				(112)	(19)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Global Advantage Real Return Fund			Global Bond Fund	
Institutional:			Institutional:		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	11	Ausgegeben und aufgerechnet	50.723	47.609
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(538)	(710)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(38.876)	(22.335)
	(538)	(699)		11.847	25.274
Institutional CHF (Partially Hedged):			ausschüttend		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	5.118	6.342
Ausgegeben und aufgerechnet	0	14	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	30	43
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.324)	(2.459)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(755)	(191)		1.824	3.926
	(755)	(177)	Institutional (Currency Exposure):		
Institutional EUR (Partially Hedged):			thesaurierend		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	5.611	4.703
Ausgegeben und aufgerechnet	0	1.945	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.363)	(4.589)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(96)	(3.911)		(752)	114
	(96)	(1.966)	ausschüttend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	400	1.214
Ausgegeben und aufgerechnet	0	140	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(160)	(782)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24)	(1.170)		240	432
	(24)	(1.030)	Institutional CAD (Hedged):		
Institutional GBP (Partially Hedged):			thesaurierend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	579	9
Ausgegeben und aufgerechnet	0	62	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(976)	(1.591)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(444)	(108)		(397)	(1.582)
	(444)	(46)	Institutional CHF (Hedged):		
Class E:			thesaurierend		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	2.125	4.332
Ausgegeben und aufgerechnet	0	29	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.169)	(2.002)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(245)	(95)		(1.044)	2.330
	(245)	(66)	ausschüttend		
Class E EUR (Partially Hedged):			Ausgegeben und aufgerechnet	801	2.766
thesaurierend			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	55	126
Ausgegeben und aufgerechnet	0	36	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.016)	(368)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		(160)	2.524
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.222)	(74)	Institutional EUR (Currency Exposure):		
	(1.222)	(38)	thesaurierend		
G Institutional EUR (Partially Hedged):			Ausgegeben und aufgerechnet	7.536	12.950
ausschüttend			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Ausgegeben und aufgerechnet	0	1	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.378)	(8.184)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		158	4.766
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5)	(6)	Institutional EUR (Hedged):		
	(5)	(5)	thesaurierend		
Class Z:			Ausgegeben und aufgerechnet	58.978	64.557
ausschüttend			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(73.172)	(38.229)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	22		(14.194)	26.328
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	(1.512)	ausschüttend		
	(1)	(1.490)	Ausgegeben und aufgerechnet	7.370	14.991
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	204	236
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.516)	(1.057)
				3.058	14.170
			ausschüttend II		
			Ausgegeben und aufgerechnet	0	613
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(48)	(780)
				(48)	(167)

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Global Bond Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Global Bond Fund (Fortsetzung)</b>		
Institutional GBP (Currency Exposure):			Investor (Currency Exposure):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	178	178	Ausgegeben und aufgerechnet	23	29
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(242)	(278)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(59)	(47)
	(64)	(100)		(36)	(18)
Institutional GBP (Hedged):			Investor CHF (Hedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	3.765	3.461	Ausgegeben und aufgerechnet	1.261	1.532
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.347)	(1.416)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.292)	(2.203)
	(582)	2.045		(2.031)	(671)
ausschüttend			Investor EUR (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	7.461	8.546	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	21	26	Ausgegeben und aufgerechnet	1.607	834
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(27.266)	(3.810)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(19.784)	4.762	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(572)	(505)
Institutional ILS (Hedged):				1.035	329
thesaurierend			Investor GBP (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	1	12	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	135	115
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12)	(53)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(11)	(41)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(99)	(147)
Institutional NOK (Hedged):				36	(32)
thesaurierend			Investor NOK (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.499	4.280	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	58	1.243
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.282)	(3.645)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(4.783)	635	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(141)	(1.267)
Institutional NZD (Hedged):				(83)	(24)
ausschüttend			Administrative:		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.423	2.176	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	36	50	Ausgegeben und aufgerechnet	459	80
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.082)	(83)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	377	2.143	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(95)	(248)
Institutional SEK (Hedged):				364	(168)
thesaurierend			Administrative EUR (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	601	2.706	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	0	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.913)	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(2.312)	2.706	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9)	(4)
Institutional SGD (Hedged):				(9)	(1)
thesaurierend			Administrative GBP (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	4.321	1.093	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(743)	(68)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
	3.578	1.025	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(16)
Investor:				k. A.	(16)
thesaurierend			Class E:		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.138	1.872	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	10.121	10.001
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.113)	(9.304)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	25	(7.432)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.120)	(4.047)
ausschüttend				2.001	5.954
Ausgegeben und aufgerechnet	242	206	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	2	Ausgegeben und aufgerechnet	7.427	17.481
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(719)	(284)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	15	43
	(476)	(76)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.018)	(29.533)
				(2.576)	(12.009)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Global Bond Fund (Fortsetzung)			Global Bond Fund (Fortsetzung)	
Class E (Currency Exposure): thesaurierend			M Retail:		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.486	3.848	ausschüttend II		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	131	2.406
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.541)	(877)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	945	2.971	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.074)	(1.372)
				(943)	1.034
ausschüttend			M Retail HKD (Unhedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	700	548	ausschüttend II		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	0	3.332
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(328)	(226)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	372	322	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.375)	(2.534)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend				(1.375)	798
Ausgegeben und aufgerechnet	119	160	Class R:		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(40)	(21)	Ausgegeben und aufgerechnet	0	83
	79	139	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(96)	(79)
Ausgegeben und aufgerechnet	25.285	22.014		(96)	4
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Class R (Currency Exposure): thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(20.266)	(9.653)	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
	5.019	12.361	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
ausschüttend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(21)
Ausgegeben und aufgerechnet	2.586	2.717		k. A.	(21)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Class R EUR (Hedged): thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.423)	(550)	Ausgegeben und aufgerechnet	370	459
	1.163	2.167	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Class E GBP (Hedged): ausschüttend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(761)	(249)
Ausgegeben und aufgerechnet	63	83		(391)	210
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Class R GBP (Hedged): ausschüttend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(236)	(84)	Ausgegeben und aufgerechnet	0	477
	(173)	(1)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	2
G Retail EUR (Hedged): ausschüttend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(426)	(212)
Ausgegeben und aufgerechnet	1.270	523		(426)	267
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Class R SEK (Hedged): thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.329)	(3.370)	Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
	(1.059)	(2.847)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
H Institutional: thesaurierend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
Ausgegeben und aufgerechnet	21.258	30.035		0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Class T: thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23.784)	(8.893)	Ausgegeben und aufgerechnet	1.391	2.004
	(2.526)	21.142	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
ausschüttend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(830)	(203)
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0		561	1.801
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	ausschüttend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)	Ausgegeben und aufgerechnet	117	251
	k. A.	(1)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
ausschüttend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(138)	(61)
Ausgegeben und aufgerechnet	380	k. A.		(20)	191
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5)	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	1.316	767
	375	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(492)	(501)
				824	266

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Global Bond Fund (Fortsetzung)			Global Bond ESG Fund	
Class W:			Institutional:		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.076	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	10.314	5.745
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.323)	(1.345)
	2.070	k. A.		6.991	4.400
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.366	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	1.950	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(124)	k. A.
	1.345	k. A.		1.826	k. A.
Class W (Currency Exposure):			Institutional CHF (Hedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	1.290	254
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(186)	(47)
	1	k. A.		1.104	207
ausschüttend			Institutional EUR (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	27.344	3.735
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	1	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.220)	(1.433)
Class W CHF (Hedged):				11.124	2.302
thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	3.547	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	9.383	10.382
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(39)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.327)	(2.643)
	3.508	k. A.		1.056	7.739
ausschüttend			Institutional GBP (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	1.288	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
	1	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24)	k. A.
Class W EUR (Hedged):				1.264	k. A.
thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.454	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	3.240	2.635
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.770)	(316)
	1.444	k. A.		1.473	2.320
ausschüttend			Institutional GBP (Unhedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	172	k. A.	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
	172	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
Class W GBP (Hedged):				1	k. A.
thesaurierend			Institutional NOK (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	14	k. A.	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	171.943	29.133
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	14	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.782)	(20.270)
ausschüttend				163.161	8.863
Ausgegeben und aufgerechnet	863	k. A.			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.			
	863	k. A.			
Class W SEK (Hedged):					
thesaurierend					
Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.			
	1	k. A.			

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Global Bond ESG Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Global Bond Ex-US Fund (Fortsetzung)</b>	
Institutional NZD (Hedged): ausschüttend			Institutional GBP (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.334	0	Ausgegeben und aufgerechnet	0	20
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	68	94	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	1.402	94		0	20
Investor: thesaurierend			Investor: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.846	78	Ausgegeben und aufgerechnet	218	360
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(325)	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(83)	(87)
	1.521	78		135	273
Administrative: thesaurierend			Administrative: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	1	Ausgegeben und aufgerechnet	69	58
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(67)	(46)
	0	1		2	12
ausschüttend			Class E: ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	1	Ausgegeben und aufgerechnet	2.858	6.458
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	56	91
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.347)	(8.875)
	0	1		(6.433)	(2.326)
Class E: ausschüttend			Class E (Currency Exposure): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	527	41	Ausgegeben und aufgerechnet	759	372
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	(13)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.315)	(1.484)
	526	28		(555)	(1.111)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			H Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	3.556	818	Ausgegeben und aufgerechnet	6.473	4.901
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.262)	(503)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.622)	(3.325)
	2.294	315		4.851	1.576
Class Z AUD (Hedged): ausschüttend			Class Z: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	5.897	2.639	Ausgegeben und aufgerechnet	0	15.001
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	124	61	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(956)	(332)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.952)	0
	5.065	2.368		(1.952)	15.001
	<b>Global Bond Ex-US Fund</b>			<b>PIMCO Global Core Asset Allocation Fund</b>	
Institutional: thesaurierend			Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	4.209	3.572	Ausgegeben und aufgerechnet	175	730
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.013)	(9.520)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.018)	(5.411)
	(1.804)	(5.948)		(9.843)	(4.681)
ausschüttend			Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	108	367	Ausgegeben und aufgerechnet	3.632	1.160
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	38	49	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(350)	(461)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.272)	(4.796)
	(204)	(45)		1.360	(3.636)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend					
Ausgegeben und aufgerechnet	2.131	6.555			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.939)	(2.330)			
	(4.808)	4.225			

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)</b>	
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	39	Ausgegeben und aufgerechnet	11.615	19.211
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	71	328
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(92)	(30)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.916)	(5.477)
	(92)	9		3.770	14.062
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	70	522
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(77)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(68)	(14)
	k. A.	(77)		2	508
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	1.020	385
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14)	(130)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(983)	(231)
	(14)	(130)		37	154
Investor: thesaurierend			Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	4	Ausgegeben und aufgerechnet	46.963	20.056
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(18)	(147)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(34.274)	(13.501)
	(18)	(143)		12.689	6.555
Class E: thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	171	234	Ausgegeben und aufgerechnet	1.906	2.952
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	61	78
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(558)	(483)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.825)	(3.279)
	(387)	(249)		(7.858)	(249)
ausschüttend			Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	119	224	Ausgegeben und aufgerechnet	20.379	218
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(138)	(156)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(15.118)	(286)
	(18)	69		5.261	(68)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.904	3.436	Ausgegeben und aufgerechnet	40.253	29.942
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	56	53
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.404)	(2.820)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24.989)	(18.646)
	(1.500)	616		15.320	11.349
ausschüttend			Investor: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.097	1.850	Ausgegeben und aufgerechnet	99	626
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.499)	(637)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(228)	(884)
	(402)	1.213		(129)	(258)
Class Z: thesaurierend			Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	127	288
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.608)	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(69)	(300)
	(1.608)	0		58	(12)
	<b>Global High Yield Bond Fund</b>		Administrative: thesaurierend		
Institutional: thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	153	377
Ausgegeben und aufgerechnet	32.243	18.210	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(585)	(487)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23.543)	(13.825)		(432)	(110)
	8.700	4.385			

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)</b>	
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.782	365	Ausgegeben und aufgerechnet	898	2.354
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(796)	(330)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.355)	(1.051)
	986	35		(1.455)	1.306
Administrative EUR (Hedged): ausschüttend			M Retail: ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	59	63	Ausgegeben und aufgerechnet	776	1.301
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	24	26
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(47)	(26)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.254)	(1.475)
	13	38		(454)	(148)
Administrative GBP (Hedged): ausschüttend			ausschüttend II		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	36.368	28.726
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8)	(15)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(37.500)	(26.604)
	(8)	(15)		(1.129)	2.124
Class E: thesaurierend			Class R: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	4.606	4.165	Ausgegeben und aufgerechnet	4.362	271
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.815)	(3.630)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(296)	(210)
	(209)	535		4.066	61
ausschüttend			Class R GBP (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	28.724	20.432	Ausgegeben und aufgerechnet	0	12
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	57	63	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	4
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(27.816)	(21.831)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(135)	(189)
	965	(1.336)		(135)	(173)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			Class T: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	5.816	6.335	Ausgegeben und aufgerechnet	190	221
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.890)	(4.634)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(249)	(126)
	(74)	1.701		(59)	95
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	921	1.832	Ausgegeben und aufgerechnet	71	124
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.833)	(1.050)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(126)	(135)
	(911)	782		(55)	(11)
Class E GBP (Hedged): ausschüttend			Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	65	120	Ausgegeben und aufgerechnet	96	42
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(324)	(149)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(28)	(142)
	(259)	(29)		68	(100)
Class E SGD (Hedged): ausschüttend				<b>Global Investment Grade Credit Fund</b>	
Ausgegeben und aufgerechnet	783	679	Institutional: thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	6	Ausgegeben und aufgerechnet	141.197	133.387
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(516)	(358)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	274	327	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(134.315)	(82.377)
H Institutional: thesaurierend				6.882	51.010
Ausgegeben und aufgerechnet	9.750	9.783	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	67.047	32.626
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.502)	(1.829)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	184	192
	248	7.954	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(41.801)	(23.570)
				25.430	9.248

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)			Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)	
Institutional (Currency Exposure): thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.937	2.381	Ausgegeben und aufgerechnet	127.307	62.424
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	56	76
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.966)	(1.919)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(49.606)	(41.079)
	971	462		77.757	21.421
ausschüttend			Institutional HUF (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.845	1.006	Ausgegeben und aufgerechnet	1.918	1.531
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	28.674	32.590
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(580)	(1.721)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	2.265	(715)		30.592	34.121
Institutional AUD (Hedged): ausschüttend			Institutional ILS (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	19.035	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	544	112
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.522)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.713)	(583)
	17.513	k. A.		(2.169)	(471)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend			Institutional NOK (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	13.013	9.656	Ausgegeben und aufgerechnet	474	287
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.251)	(11.730)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(283)	(3.480)
	3.762	(2.074)		191	(3.193)
ausschüttend			Institutional PLN (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.901	2.107	Ausgegeben und aufgerechnet	1.514	2.940
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.804)	(994)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.036)	(1.107)
	1.099	1.113		(522)	1.833
Institutional CZK (Hedged): ausschüttend			Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	10.903	8.609	Ausgegeben und aufgerechnet	48.622	1.475
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.893	3.278	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(530)	(1.083)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(15.942)	(374)
	13.266	10.804		32.680	1.101
Institutional EUR (Currency Exposure): thesaurierend			Institutional SGD (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.934	1.403	Ausgegeben und aufgerechnet	4.092	2.882
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.706)	(678)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.907)	(359)
	228	725		2.185	2.523
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend			Investor: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	157.691	84.297	Ausgegeben und aufgerechnet	128.138	129.411
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(114.229)	(75.635)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(125.695)	(111.101)
	43.462	8.662		2.443	18.310
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	19.789	14.595	Ausgegeben und aufgerechnet	14.360	7.580
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	344	830	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	26	26
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25.473)	(13.340)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.286)	(2.128)
	(5.340)	2.085		7.100	5.478
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend					
Ausgegeben und aufgerechnet	22.315	12.066			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30.054)	(22.822)			
	(7.739)	(10.756)			

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)			Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)	
Investor AUD (Hedged): ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	384	569	Ausgegeben und aufgerechnet	15.638	9.148
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	6
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(148)	(38)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.735)	(1.067)
	236	532		7.908	8.087
Investor CAD (Hedged): ausschüttend			Administrative CHF (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	228	36	Ausgegeben und aufgerechnet	11	10
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(29)
	229	37		11	(19)
Investor CHF (Hedged): thesaurierend			Administrative EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	384	1.339	Ausgegeben und aufgerechnet	626	420
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.163)	(263)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(467)	(172)
	(1.779)	1.076		159	248
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	210	384	Ausgegeben und aufgerechnet	943	1.069
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(665)	(224)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.491)	(144)
	(455)	160		(548)	925
Investor EUR (Hedged): thesaurierend			Administrative GBP (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	4.493	5.560	Ausgegeben und aufgerechnet	274	90
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.106)	(3.709)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(652)	(289)
	387	1.851		(377)	(198)
ausschüttend			Administrative HKD (Unhedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	715	720	Ausgegeben und aufgerechnet	1.395	27.124
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	33	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.154)	(213)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.869)	(22.828)
	(437)	508		(1.441)	4.296
Investor GBP (Hedged): ausschüttend			Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	240	268	Ausgegeben und aufgerechnet	102.040	68.353
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(51)	(361)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(72.302)	(50.313)
	189	(93)		29.738	18.040
Investor RMB (Hedged): ausschüttend			Administrative SGD (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	52	9	Ausgegeben und aufgerechnet	2.963	1.143
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11)	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(903)	0
	41	10		2.060	1.143
Investor SGD (Hedged): ausschüttend			Class E: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	959	1.260	Ausgegeben und aufgerechnet	48.467	30.904
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(214)	(117)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(32.223)	(13.900)
	745	1.143		16.244	17.004
Administrative: thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	6.639	1.992	Ausgegeben und aufgerechnet	49.648	51.324
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	120	153
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(976)	(1.814)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(52.456)	(44.377)
	5.663	178		(2.688)	7.100

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)			Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)	
Class E CHF (Hedged): thesaurierend			M Retail HKD (Unhedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.632	2.354	Ausgegeben und aufgerechnet	3.548	3.194
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.239)	(8.854)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.036)	(1.779)
	393	(6.500)		1.512	1.415
E Class EUR (Currency Exposure): ausschüttend			Class R: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	143	0	Ausgegeben und aufgerechnet	1.707	667
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(641)	(348)
	143	0		1.066	319
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	30.463	13.643	Ausgegeben und aufgerechnet	417	267
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(19.892)	(9.708)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(240)	(139)
	10.571	3.935		177	128
ausschüttend			Class R EUR (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	6.504	8.391	Ausgegeben und aufgerechnet	675	499
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	4	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.369)	(4.849)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.156)	(1.224)
	1.138	3.546		(481)	(725)
Class E GBP (Hedged): ausschüttend			Class R GBP (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.296	799	Ausgegeben und aufgerechnet	1.216	1.590
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	5	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(742)	(749)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.283)	(754)
	557	55		(67)	837
Class E SGD (Hedged): ausschüttend			Class T: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	7.414	4.905	Ausgegeben und aufgerechnet	2.302	2.107
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	12	19	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.389)	(2.784)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(968)	(277)
	2.037	2.140		1.334	1.830
H Institutional: thesaurierend			Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	17.446	10.274	Ausgegeben und aufgerechnet	352	202
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.448)	(4.689)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(290)	(224)
	3.998	5.585		62	(22)
ausschüttend			Class W: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.255	1.253	Ausgegeben und aufgerechnet	6.858	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	27	16	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.406)	(39)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(15)	k. A.
	(124)	1.230		6.843	k. A.
M Retail: ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	10.094	2.845	Ausgegeben und aufgerechnet	2.996	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	5	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.754)	(1.280)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	6.346	1.570		2.996	k. A.
ausschüttend II			Class W CHF (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	48.119	51.909	Ausgegeben und aufgerechnet	3.673	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	8	5	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(47.486)	(43.445)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(81)	k. A.
	641	8.469		3.592	k. A.

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)</b>	
Class W EUR (Hedged): thesaurierend			Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.371	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	4.591	195
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(524)	(26)
	1.367	k. A.		4.067	169
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	402	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	2.243	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	402	k. A.		2.243	k. A.
Class W GBP (Hedged): thesaurierend			Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	1.363	484
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(522)	(80)
	1	k. A.		841	404
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.523	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	955	1.152
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(41)	(1.151)
	1.521	k. A.		914	1
Class W SGD (Hedged): ausschüttend			Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	3.399	25
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(150)	0
	1	k. A.		3.249	25
	<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund</b>		Class E: thesaurierend		
Institutional: thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	1.234	k. A.
Ausgegeben und aufgerechnet	2.900	154	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(223)	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(703)	(38)		1.011	k. A.
	2.197	116	ausschüttend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	350	k. A.
Ausgegeben und aufgerechnet	1.602	1.542	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11)	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(423)	(15)		339	k. A.
	1.179	1.527	Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	189	k. A.
Ausgegeben und aufgerechnet	2.086	781	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(905)	(344)		189	k. A.
	1.181	437	ausschüttend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	3	k. A.
Ausgegeben und aufgerechnet	19	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.		3	k. A.
	19	k. A.	Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	661	k. A.
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(19)	k. A.
				642	k. A.

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Global Libor Plus Bond Fund (Fortsetzung)</b>		
ausschüttend			Investor:		
Ausgegeben und aufgerechnet	55	k. A.	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
	55	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
				k. A.	(1)
Class E GBP (Hedged):			Investor EUR (Hedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	51	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	294	2.135
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(564)	(875)
	51	k. A.		(270)	1.260
ausschüttend			Class E EUR (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	26	k. A.	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	215	724
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(15)	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	11	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(318)	(932)
Class Z:				(103)	(208)
thesaurierend					
Ausgegeben und aufgerechnet	0	580	<b>Global Low Duration Real Return Fund</b>		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Institutional:		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0	thesaurierend		
	0	580	Ausgegeben und aufgerechnet	7.973	6.050
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
<b>Global Libor Plus Bond Fund</b>			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.070)	(9.602)
Institutional:				(97)	(3.552)
thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.219	11.069	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.381)	(2.930)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	(3.162)	8.139		k. A.	(1)
ausschüttend			Institutional CHF (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	781	2.807	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	338	329
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.838)	(920)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(1.057)	1.887	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(146)	(85)
Institutional EUR (Hedged):				192	244
thesaurierend			Institutional EUR (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	3.156	4.244	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	11.546	14.415
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.804)	(352)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(648)	3.892	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21.639)	(22.464)
ausschüttend				(10.093)	(8.049)
Ausgegeben und aufgerechnet	218	1.189	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	29	46	Ausgegeben und aufgerechnet	1.131	2.551
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(970)	(79)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(723)	1.156	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.016)	(2.327)
Institutional GBP (Hedged):				115	224
thesaurierend			ausschüttend II		
Ausgegeben und aufgerechnet	38.935	54.718	Ausgegeben und aufgerechnet	0	161
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.665)	(32.131)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(270)	(185)
	33.270	22.587		(270)	(24)
ausschüttend					
Ausgegeben und aufgerechnet	13.035	34.340			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	57			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.391)	(5.307)			
	5.644	29.090			

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Global Low Duration Real Return Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Global Real Return Fund (Fortsetzung)</b>	
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.812	1.161	Ausgegeben und aufgerechnet	515	205
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.410)	(1.049)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(141)	(559)
	402	112		374	(354)
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.624	7.053	Ausgegeben und aufgerechnet	101	158
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	5	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12.784)	(6.795)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(140)	(1.392)
	(11.160)	263		(39)	(1.234)
Investor:			Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	27.463	9.274
Ausgegeben und aufgerechnet	5	66	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.653)	(7.232)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(112)	(440)		17.810	2.042
	(107)	(374)	ausschüttend		
Investor EUR (Hedged): thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	5.420	1.954
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	29
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.111)	(1.691)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)		2.310	292
	k. A.	(1)	Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Class E:			Ausgegeben und aufgerechnet	2.276	128
thesaurierend			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Ausgegeben und aufgerechnet	114	372	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(198)	(142)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		2.078	(14)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(643)	(2.142)	ausschüttend		
	(529)	(1.770)	Ausgegeben und aufgerechnet	1.589	1.404
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	5
Ausgegeben und aufgerechnet	848	512	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.177)	(3.855)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		(588)	(2.446)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.308)	(4.283)	Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
	(2.460)	(3.771)	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(21)
				k. A.	(21)
			Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Institutional:			Ausgegeben und aufgerechnet	158	461
thesaurierend			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Ausgegeben und aufgerechnet	11.639	12.843	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(204)	(18)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		(46)	443
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.649)	(18.283)	Investor:		
	(6.010)	(5.440)	thesaurierend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	1.922	351
Ausgegeben und aufgerechnet	822	1.153	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(804)	(1.674)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(563)	(1.687)		1.118	(1.323)
	259	(534)	ausschüttend		
Institutional (Currency Exposure): thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	1.205	175
Ausgegeben und aufgerechnet	285	232	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(245)	(202)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.294)	(2.226)		960	(27)
	(2.009)	(1.994)			

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>Global Real Return Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Global Real Return Fund (Fortsetzung)</b>		
Investor CHF (Hedged):			Class R:		
ausschüttend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	61	11	Ausgegeben und aufgerechnet	43	121
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(33)	(43)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(178)	(42)
	28	(32)		(135)	79
Investor EUR (Hedged):			Class R EUR (Hedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	544	89	Ausgegeben und aufgerechnet	0	28
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(171)	(57)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(40)	(67)
	373	32		(40)	(39)
ausschüttend			Class R GBP (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	58	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	363	430
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(264)	(123)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(264)	(65)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(510)	(851)
Administrative:				(147)	(421)
thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	428	316	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(762)	(842)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(25)
	(334)	(526)		k. A.	(25)
Class E:			Class T EUR (Hedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	7.336	2.811	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.878)	(4.313)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(17)
	1.458	(1.502)		k. A.	(17)
ausschüttend			Class Z AUD (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	988	282	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	237
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(611)	(959)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	9
	377	(677)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1.164)
Class E EUR (Hedged):				k. A.	(918)
thesaurierend					
Ausgegeben und aufgerechnet	4.955	1.207	<b>Income Fund</b>		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Institutional:		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.767)	(2.866)	thesaurierend		
	1.188	(1.659)	Ausgegeben und aufgerechnet	358.313	411.802
Class E GBP (Hedged):			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
ausschüttend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(412.100)	(234.971)
Ausgegeben und aufgerechnet	38	49		(53.787)	176.831
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	ausschüttend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(61)	(98)	Ausgegeben und aufgerechnet	174.045	197.116
	(23)	(49)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.298	1.002
H Institutional:			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(163.249)	(73.890)
thesaurierend				12.094	124.228
Ausgegeben und aufgerechnet	4.862	2.477	Institutional AUD (Hedged):		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.977)	(1.312)	Ausgegeben und aufgerechnet	2.979	2.996
	(115)	1.165	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.186)	(93)
				(207)	2.903

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Income Fund (Fortsetzung)			Income Fund (Fortsetzung)	
Institutional BRL (Hedged):			Institutional HKD (Unhedged):		
thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	9.169	2.468	Ausgegeben und aufgerechnet	6.128	189.252
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	12	17
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.513)	(9.454)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(159.208)	(124.305)
	4.656	(6.986)		(153.068)	64.964
Institutional CAD (Hedged):			Institutional JPY (Hedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	973	1.049	Ausgegeben und aufgerechnet	32	1.251
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.871)	(1.373)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.102)	0
	(7.898)	(324)		(2.070)	1.251
ausschüttend			Institutional NOK (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	9.649	540	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	49	20	Ausgegeben und aufgerechnet	7.210	5.484
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(212)	(34)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	9.486	526	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.342)	(4.076)
Institutional CHF (Hedged):				5.868	1.408
thesaurierend			Institutional SGD (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	4.798	7.759	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	226	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.538)	(4.070)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
	1.260	3.689	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8)	k. A.
ausschüttend				218	k. A.
Ausgegeben und aufgerechnet	7.139	7.861	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	4	Ausgegeben und aufgerechnet	10.723	17.492
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.451)	(1.711)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	63	8
	(312)	6.154	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.278)	(2.304)
Institutional EUR (Hedged):				(492)	15.196
thesaurierend			Investor:		
Ausgegeben und aufgerechnet	799.103	861.070	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	50.596	112.691
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.136.271)	(613.079)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(337.168)	247.991	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(70.790)	(35.333)
ausschüttend				(20.194)	77.358
Ausgegeben und aufgerechnet	32.541	43.731	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	468	306	Ausgegeben und aufgerechnet	49.872	80.379
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(67.503)	(17.335)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	164	334
	(34.494)	26.702	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(57.103)	(29.143)
ausschüttend II				(7.067)	51.570
Ausgegeben und aufgerechnet	1.565	2.647	Investor AUD (Hedged):		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	12	24	ausschüttend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(955)	(3.774)	Ausgegeben und aufgerechnet	2.113	2.624
	622	(1.103)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Institutional GBP (Hedged):			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(396)	(25)
thesaurierend				1.718	2.599
Ausgegeben und aufgerechnet	1.456	1.867	Investor EUR (Hedged):		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.575)	(496)	Ausgegeben und aufgerechnet	446.751	461.766
	(119)	1.371	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
ausschüttend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(542.208)	(291.213)
Ausgegeben und aufgerechnet	11.826	16.261		(95.457)	170.553
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	73	104	ausschüttend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14.477)	(8.757)	Ausgegeben und aufgerechnet	2.007	2.252
	(2.578)	7.608	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	2
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.567)	(959)
				441	1.295

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Income Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Income Fund (Fortsetzung)</b>	
ausschüttend A			Administrative GBP (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	375	381	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen			Ausgegeben und aufgerechnet	2.289	8.714
von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen		
Rücknahmen während des			von Ausschüttungen	42	35
Geschäftsjahres	(753)	(606)	Rücknahmen während des		
	(378)	(225)	Geschäftsjahres	(6.940)	(1.198)
Investor GBP (Hedged):				(4.609)	7.551
ausschüttend			Administrative HKD (Unhedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	390	k. A.	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen			Ausgegeben und aufgerechnet	39.582	601.395
von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen		
Rücknahmen während des			von Ausschüttungen	82	277
Geschäftsjahres	0	k. A.	Rücknahmen während des		
	390	k. A.	Geschäftsjahres	(616.226)	(333.049)
Investor RMB (Hedged):				(576.562)	268.623
thesaurierend			Administrative SGD (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	609	1.558	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen			Ausgegeben und aufgerechnet	18.194	32.714
von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen		
Rücknahmen während des			von Ausschüttungen	206	250
Geschäftsjahres	(50)	(1)	Rücknahmen während des		
	559	1.557	Geschäftsjahres	(37.453)	(17.680)
Investor SGD (Hedged):				(19.053)	15.284
thesaurierend			Class E:		
Ausgegeben und aufgerechnet	219	k. A.	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen			Ausgegeben und aufgerechnet	107.342	210.740
von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen		
Rücknahmen während des			von Ausschüttungen	0	0
Geschäftsjahres	(207)	k. A.	Rücknahmen während des		
	12	k. A.	Geschäftsjahres	(156.565)	(95.617)
ausschüttend				(49.223)	115.123
Ausgegeben und aufgerechnet	3.316	3.805	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen			Ausgegeben und aufgerechnet	250.451	377.660
von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen		
Rücknahmen während des			von Ausschüttungen	1.518	1.316
Geschäftsjahres	(4.048)	(406)	Rücknahmen während des		
	(732)	3.399	Geschäftsjahres	(310.403)	(228.383)
Administrative:				(58.434)	150.593
thesaurierend			Ausschüttend Q		
Ausgegeben und aufgerechnet	24.744	31.509	Ausgegeben und aufgerechnet	195	1
Emissionen aus Wiederanlagen			Emissionen aus Wiederanlagen		
von Ausschüttungen	0	0	von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des			Rücknahmen während des		
Geschäftsjahres	(25.543)	(5.735)	Geschäftsjahres	(16)	0
	(799)	25.774		179	1
ausschüttend			Class E AUD (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	146.165	131.088	ausschüttend		
Emissionen aus Wiederanlagen			Ausgegeben und aufgerechnet	20.237	62.338
von Ausschüttungen	369	469	Emissionen aus Wiederanlagen		
Rücknahmen während des			von Ausschüttungen	284	154
Geschäftsjahres	(179.266)	(38.476)	Rücknahmen während des		
	(32.732)	93.081	Geschäftsjahres	(27.367)	(23.234)
Administrative AUD (Hedged):				(6.846)	39.258
ausschüttend			Class E CHF (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	7.818	24.102	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen			Ausgegeben und aufgerechnet	1.119	2.072
von Ausschüttungen	58	36	Emissionen aus Wiederanlagen		
Rücknahmen während des			von Ausschüttungen	0	0
Geschäftsjahres	(14.443)	(2.882)	Rücknahmen während des		
	(6.567)	21.256	Geschäftsjahres	(1.360)	(1.606)
Administrative EUR (Hedged):				(241)	466
thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	11.227	16.566	Ausgegeben und aufgerechnet	3.589	6.569
Emissionen aus Wiederanlagen			Emissionen aus Wiederanlagen		
von Ausschüttungen	0	0	von Ausschüttungen	0	2
Rücknahmen während des			Rücknahmen während des		
Geschäftsjahres	(14.030)	(1.220)	Geschäftsjahres	(3.341)	(2.864)
	(2.803)	15.346		248	3.707
ausschüttend			Class E EUR (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	13.764	34.326	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen			Ausgegeben und aufgerechnet	137.327	185.877
von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen		
Rücknahmen während des			von Ausschüttungen	0	0
Geschäftsjahres	(46.777)	(15.517)	Rücknahmen während des		
	(33.013)	18.809	Geschäftsjahres	(185.421)	(139.682)
				(48.094)	46.195

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Income Fund (Fortsetzung)			Income Fund (Fortsetzung)	
ausschüttend			H Institutional:		
Ausgegeben und aufgerechnet	76.501	195.027	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen			Ausgegeben und aufgerechnet	48.132	36.314
von Ausschüttungen	65	72	Emissionen aus Wiederanlagen		
Rücknahmen während des			von Ausschüttungen	0	0
Geschäftsjahres	(212.758)	(114.195)	Rücknahmen während des		
	(136.192)	80.904	Geschäftsjahres	(33.288)	(3.264)
				14.844	33.050
ausschüttend II			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	4.793	9.928	Ausgegeben und aufgerechnet	25.137	8.833
Emissionen aus Wiederanlagen			Emissionen aus Wiederanlagen		
von Ausschüttungen	0	0	von Ausschüttungen	304	214
Rücknahmen während des			Rücknahmen während des		
Geschäftsjahres	(4.424)	(1.494)	Geschäftsjahres	(6.970)	(1.426)
	369	8.434		18.471	7.621
Ausschüttend II Q			H Institutional EUR (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	3.928	1	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen			Ausgegeben und aufgerechnet	121	448
von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen		
Rücknahmen während des			von Ausschüttungen	0	0
Geschäftsjahres	(493)	0	Rücknahmen während des		
	3.435	1	Geschäftsjahres	(463)	(241)
Class E GBP (Hedged):				(342)	207
ausschüttend			Class R:		
Ausgegeben und aufgerechnet	7.113	22.745	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen			Ausgegeben und aufgerechnet	3.959	45
von Ausschüttungen	36	30	Emissionen aus Wiederanlagen		
Rücknahmen während des			von Ausschüttungen	0	0
Geschäftsjahres	(10.408)	(10.628)	Rücknahmen während des		
	(3.259)	12.147	Geschäftsjahres	(1.112)	0
Class E HKD (Unhedged):				2.847	45
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	35.851	881.840	Ausgegeben und aufgerechnet	2.757	5.059
Emissionen aus Wiederanlagen			Emissionen aus Wiederanlagen		
von Ausschüttungen	190	282	von Ausschüttungen	41	62
Rücknahmen während des			Rücknahmen während des		
Geschäftsjahres	(494.882)	(714.171)	Geschäftsjahres	(3.749)	(1.201)
	(458.841)	167.951		(951)	3.920
Class E JPY (Hedged):			Class R EUR (Hedged):		
thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.425	302	Ausgegeben und aufgerechnet	510	699
Emissionen aus Wiederanlagen			Emissionen aus Wiederanlagen		
von Ausschüttungen	0	0	von Ausschüttungen	4	1
Rücknahmen während des			Rücknahmen während des		
Geschäftsjahres	(1.053)	(179)	Geschäftsjahres	(228)	(177)
	1.372	123		286	523
Class E RMB (Hedged):			Class R GBP (Hedged):		
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.720	2.298	Ausgegeben und aufgerechnet	615	876
Emissionen aus Wiederanlagen			Emissionen aus Wiederanlagen		
von Ausschüttungen	13	8	von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des			Rücknahmen während des		
Geschäftsjahres	(963)	(352)	Geschäftsjahres	(2.056)	(697)
	770	1.954		(1.441)	179
Class E SGD (Hedged):			Class T:		
ausschüttend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	68.518	141.429	Ausgegeben und aufgerechnet	9.193	14.441
Emissionen aus Wiederanlagen			Emissionen aus Wiederanlagen		
von Ausschüttungen	1.001	720	von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des			Rücknahmen während des		
Geschäftsjahres	(107.714)	(38.021)	Geschäftsjahres	(7.397)	(3.353)
	(38.195)	104.128		1.796	11.088
G Retail EUR (Hedged):			ausschüttend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	3.773	5.606
Ausgegeben und aufgerechnet	1.442	1.890	Emissionen aus Wiederanlagen		
Emissionen aus Wiederanlagen			von Ausschüttungen	87	67
von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des		
Rücknahmen während des			Geschäftsjahres	(3.114)	(1.966)
Geschäftsjahres	(1.650)	(516)		746	3.707
	(208)	1.374	Class T EUR (Hedged):		
G Retail EUR (Unhedged):			thesaurierend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	2.927	7.928
Ausgegeben und aufgerechnet	108	21	Emissionen aus Wiederanlagen		
Emissionen aus Wiederanlagen			von Ausschüttungen	0	0
von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des		
Rücknahmen während des			Geschäftsjahres	(8.877)	(7.357)
Geschäftsjahres	(100)	0		(5.950)	571
	8	21			

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Income Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Low Average Duration Fund</b>	
ausschüttend			Institutional:		
Ausgegeben und aufgerechnet	3.814	8.987	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	29.114	25.294
von Ausschüttungen			Emissionen aus Wiederanlagen	0	0
Rücknahmen während des			von Ausschüttungen		
Geschäftsjahres	(7.387)	(7.317)	Rücknahmen während des	(26.466)	(23.753)
	(3.573)	1.670	Geschäftsjahres		
Class Z:				2.648	1.541
thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	2.726	Ausgegeben und aufgerechnet	4.452	783
Emissionen aus Wiederanlagen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen	7	15
von Ausschüttungen			von Ausschüttungen		
Rücknahmen während des			Rücknahmen während des	(4.408)	(8.477)
Geschäftsjahres	(5.427)	(9.614)	Geschäftsjahres		
	(5.427)	(6.888)		51	(7.679)
Class Z AUD (Hedged):			Institutional AUD (Hedged):		
ausschüttend II			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	20.278	49.254	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen	3.411	2.224	Emissionen aus Wiederanlagen	k. A.	0
von Ausschüttungen			von Ausschüttungen		
Rücknahmen während des			Rücknahmen während des	k. A.	0
Geschäftsjahres	(15.734)	(2.341)	Geschäftsjahres		
	7.955	49.137		k. A.	0
	<b>Inflation Strategy Fund</b>		Institutional EUR (Hedged):		
Institutional:			thesaurierend		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	6.230	11.629
Ausgegeben und aufgerechnet	378	2.389	Emissionen aus Wiederanlagen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen	0	0	von Ausschüttungen		
von Ausschüttungen			Rücknahmen während des	(14.478)	(15.834)
Rücknahmen während des			Geschäftsjahres		
Geschäftsjahres	(405)	(337)		(8.248)	(4.205)
	(27)	2.052	ausschüttend		
Institutional EUR (Partially			Ausgegeben und aufgerechnet	1.972	76
Hedged):			Emissionen aus Wiederanlagen	1	2
thesaurierend			von Ausschüttungen		
Ausgegeben und aufgerechnet	340	24	Rücknahmen während des	(1.229)	(529)
Emissionen aus Wiederanlagen	0	0	Geschäftsjahres		
von Ausschüttungen				744	(451)
Rücknahmen während des			Institutional GBP (Hedged):		
Geschäftsjahres	(341)	(2.349)	thesaurierend		
	(1)	(2.325)	Ausgegeben und aufgerechnet	243	4.503
Institutional GBP (Partially			Emissionen aus Wiederanlagen	0	0
Hedged):			von Ausschüttungen		
thesaurierend			Rücknahmen während des	(4.565)	(137)
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Geschäftsjahres		
Emissionen aus Wiederanlagen	0	0		(4.322)	4.366
von Ausschüttungen			ausschüttend		
Rücknahmen während des			Ausgegeben und aufgerechnet	411	1.460
Geschäftsjahres	(6)	(85)	Emissionen aus Wiederanlagen	2	3
	(6)	(85)	von Ausschüttungen		
Class E:			Rücknahmen während des	(1.472)	(823)
thesaurierend			Geschäftsjahres		
Ausgegeben und aufgerechnet	51	37		(1.059)	640
Emissionen aus Wiederanlagen	0	0	Institutional ILS (Hedged):		
von Ausschüttungen			thesaurierend		
Rücknahmen während des			Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
Geschäftsjahres	(133)	(248)	Emissionen aus Wiederanlagen	0	0
	(82)	(211)	von Ausschüttungen		
ausschüttend			Rücknahmen während des	(8)	(33)
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Geschäftsjahres		
Emissionen aus Wiederanlagen	k. A.	0		(8)	(33)
von Ausschüttungen			Investor:		
Rücknahmen während des			thesaurierend		
Geschäftsjahres	k. A.	(121)	Ausgegeben und aufgerechnet	261	557
	k. A.	(121)	Emissionen aus Wiederanlagen	0	0
Class E EUR (Partially Hedged):			von Ausschüttungen		
thesaurierend			Rücknahmen während des	(676)	(3.127)
Ausgegeben und aufgerechnet	65	43	Geschäftsjahres		
Emissionen aus Wiederanlagen	0	0		(415)	(2.570)
von Ausschüttungen			ausschüttend		
Rücknahmen während des			Ausgegeben und aufgerechnet	608	233
Geschäftsjahres	(137)	(282)	Emissionen aus Wiederanlagen	1	7
	(72)	(239)	von Ausschüttungen		
ausschüttend			Rücknahmen während des	(412)	(186)
Ausgegeben und aufgerechnet	39	34	Geschäftsjahres		
Emissionen aus Wiederanlagen	0	0		197	54
von Ausschüttungen					
Rücknahmen während des					
Geschäftsjahres	(148)	(236)			
	(109)	(202)			

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Low Average Duration Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)</b>	
Administrative: thesaurierend			Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	295	203	Ausgegeben und aufgerechnet	0	6
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(331)	(341)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(26)	(9)
	(36)	(138)		(26)	(3)
Class E: thesaurierend			Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	6.984	1.835	Ausgegeben und aufgerechnet	10.350	741
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.521)	(2.574)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.890)	(1.688)
	1.463	(739)		1.460	(947)
ausschüttend			Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	726	149	Ausgegeben und aufgerechnet	1.380	1.065
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	2	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(228)	(286)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(656)	(102)
	499	(135)		724	963
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			Institutional NOK (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.071	493	Ausgegeben und aufgerechnet	3	4.362
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.036)	(806)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.231)	(4.788)
	35	(313)		(1.228)	(426)
H Institutional: thesaurierend			Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	12.118	2.582	Ausgegeben und aufgerechnet	1.280	424
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.212)	(652)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(738)	(572)
	3.906	1.930		542	(148)
ausschüttend					
Ausgegeben und aufgerechnet	1.347	66			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(742)	0			
	610	66			
Class R: thesaurierend					
Ausgegeben und aufgerechnet	390	387			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(386)	(132)			
	4	255			
Class R EUR (Hedged): thesaurierend					
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(115)			
	k. A.	(115)			
	<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>			<b>Low Duration Income Fund</b>	
Institutional: thesaurierend			Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	8.892	1.161	Ausgegeben und aufgerechnet	128	3.130
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.668)	(3.133)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(658)	(5.264)
	4.224	(1.972)		(530)	(2.134)
			ausschüttend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	18	16
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(65)	(148)
				(46)	(131)
			Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	17	150
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(150)
				17	0
			ausschüttend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
				0	0

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Low Duration Income Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Low Duration Income Fund (Fortsetzung)</b>	
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend			Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	27.989	829	Ausgegeben und aufgerechnet	79	113
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(716)	(64)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(50)	(12)
	27.273	765		29	101
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	6.648	7.489	Ausgegeben und aufgerechnet	14	66
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(34)	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(53)	0
	6.614	7.489		(39)	66
ausschüttend			Class E SGD (Hedged): ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	10	25
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0		11	26
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend			H Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	58	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	57	k. A.		1	k. A.
Investor EUR (Hedged): thesaurierend			Class Z EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	0	0		1	k. A.
ausschüttend					
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0			
	0	0			
Class E: thesaurierend					
Ausgegeben und aufgerechnet	12	162			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(146)	(6)			
	(134)	156			
ausschüttend					
Ausgegeben und aufgerechnet	101	0			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0			
	101	0			
Class E CHF (Hedged): thesaurierend					
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0			
	0	0			
ausschüttend					
Ausgegeben und aufgerechnet	0	3			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3)	0			
	(3)	3			

### PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

Institutional: thesaurierend					
Ausgegeben und aufgerechnet	1.875	6.911			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.660)	(3.153)			
	(3.785)	3.758			
ausschüttend					
Ausgegeben und aufgerechnet	2.417	8.090			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	2			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.619)	(4.234)			
	(9.200)	3.858			
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend					
Ausgegeben und aufgerechnet	1.805	3.121			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.044)	(15.760)			
	(239)	(12.639)			
ausschüttend					
Ausgegeben und aufgerechnet	64	173			
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0			
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(431)	(603)			
	(367)	(430)			

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Fortsetzung)	
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	79	2.547
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.433)	(8)
	(2.354)	2.539
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	509	1.797
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	65
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.592)	(1.289)
	(2.083)	573
Investor:		
thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(549)	0
	(549)	0
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	3	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	3	0
Class E:		
thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(55)
	k. A.	(55)
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.426	645
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.277)	(192)
	149	458
ausschüttend II		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4)	(189)
	(4)	(189)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(126)
	k. A.	(126)
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(145)
	k. A.	(145)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Fortsetzung)	
Class R GBP (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
Class Z:		
thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	75	743
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	75	743
Institutional:	Mortgage Opportunities Fund	
thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	28.905	38.896
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(35.867)	(29.094)
	(6.962)	9.802
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	27.238	7.277
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	259	294
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14.328)	(31.852)
	13.169	(24.281)
ausschüttend II		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	6
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6)	(1)
	(6)	5
Institutional BRL (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(475)	(3)
	(475)	(3)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.202	3.600
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.588)	(2.322)
	(6.386)	1.278
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	33.284	16.304
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24.668)	(43.204)
	8.616	(26.900)
ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	205	113
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(185)	(555)
	20	(442)

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Mortgage Opportunities Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Mortgage Opportunities Fund (Fortsetzung)</b>	
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	435	474	Ausgegeben und aufgerechnet	189	555
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(597)	(165)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.972)	(3.748)
	(162)	309		(2.783)	(3.193)
ausschüttend			ausschüttend		
Ausgegeben und aufgerechnet	636	274	Ausgegeben und aufgerechnet	0	40
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	7	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(241)	(792)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(31)	(1.099)
	399	(511)		(31)	(1.059)
Investor:			Class E HKD (Unhedged): thesaurierend		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Ausgegeben und aufgerechnet	2.903	267	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(8)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(343)	(268)		k. A.	(8)
	2.560	(1)	Class E SGD (Hedged): thesaurierend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
Ausgegeben und aufgerechnet	963	540	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	10	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8)	(208)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(565)	(182)		(8)	(208)
	404	368	ausschüttend		
Investor EUR (Hedged): thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(443)	(217)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(10)		(442)	(216)
	k. A.	(10)	H Institutional: thesaurierend		
Administrative: ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	1	k. A.
Ausgegeben und aufgerechnet	0	5	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29)	0		1	k. A.
	(29)	5	M Retail HKD (Unhedged): ausschüttend		
Administrative SGD (Hedged): ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(8)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(41)		k. A.	(8)
	k. A.	(41)	Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Class E: thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	0	2
Ausgegeben und aufgerechnet	1.245	2.064	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25)	(14)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.776)	(10.999)		(25)	(12)
	(1.531)	(8.935)	Class Z: thesaurierend		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	340	10.996
Ausgegeben und aufgerechnet	167	390	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	2	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.876)	(448)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(433)	(1.494)		(3.536)	10.548
	(263)	(1.102)	Class Z EUR (Hedged): thesaurierend		
Class E CHF (Hedged): ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Ausgegeben und aufgerechnet	0	23	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(6.905)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6)	(39)		k. A.	(6.905)
	(6)	(16)			

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>Mortgage Opportunities Fund (Fortsetzung)</b>			<b>PIMCO RAE Emerging Markets Fund (Fortsetzung)</b>	
Class Z GBP (Hedged): thesaurierend			Class Z EUR (Unhedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	11.894	0	Ausgegeben und aufgerechnet	1.221	649
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.321)	(100)
	11.894	0		(5.100)	549
	<b>PIMCO RAE Emerging Markets Fund</b>			<b>PIMCO RAE Europe Fund</b>	
Institutional: thesaurierend			Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	14	218	Ausgegeben und aufgerechnet	1.639	1.566
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(430)	(468)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.035)	(301)
	(416)	(250)		(1.396)	1.265
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend			Institutional GBP (Unhedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.988	5.591	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.834)	(6.787)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	(846)	(1.196)		k. A.	(1)
Institutional GBP (Unhedged): thesaurierend			Institutional USD (Unhedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	6	4	Ausgegeben und aufgerechnet	40	40
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(32)	(1)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(373)	(157)
	(26)	3		(333)	(117)
Class E: thesaurierend			Class E: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	12	57	Ausgegeben und aufgerechnet	123	107
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(200)	(18)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(444)	(79)
	(188)	39		(321)	28
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend			Class E USD (Unhedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	71	1.853	Ausgegeben und aufgerechnet	0	5
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.969)	(414)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5)	(1)
	(1.898)	1.439		(5)	4
Class R GBP (Unhedged): thesaurierend			Class R GBP (Unhedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)		k. A.	(1)
Class T: thesaurierend			Class T: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(25)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(16)
	k. A.	(25)		k. A.	(16)
Class T EUR (Unhedged): thesaurierend			Class T USD (Unhedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(51)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(51)		k. A.	(1)



	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund (Fortsetzung)</b>			<b>PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund (Fortsetzung)</b>	
Institutional GBP (Unhedged): thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Institutional GBP (Unhedged): thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	0		(1)	0
	<b>PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund</b>			<b>StocksPLUS™ Fund</b>	
Institutional: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Institutional: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	48.993	40.820
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(434)	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(55.286)	(44.712)
	(434)	0		(6.293)	(3.892)
Institutional USD (Unhedged): thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	ausschüttend Ausgegeben und aufgerechnet	7	31
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	4
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(86)	(57)
	(1)	0		(79)	(22)
	<b>PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund</b>		Institutional EUR (Hedged): thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	20.268	5.968
Institutional: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.358)	(6.315)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(498)	0		11.910	(347)
	(498)	0	ausschüttend Ausgegeben und aufgerechnet	7	100
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(72)	(228)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0		(65)	(128)
	(1)	0	Investor: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	433	61
Institutional GBP (Unhedged): thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(206)	(421)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0		227	(360)
	(1)	0	Class E: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	1.598	2.127
	<b>PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund</b>		Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Institutional: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	250	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.445)	(1.483)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		(847)	644
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(548)	0	Class E EUR (Hedged): thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	2.871	10.558
	(298)	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21.717)	(729)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		(18.846)	9.829
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0	H Institutional: thesaurierend Ausgegeben und aufgerechnet	21.815	k. A.
	(1)	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.714)	k. A.
				16.101	k. A.

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	<b>StocksPLUS™ Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Strategic Income Fund (Fortsetzung)</b>	
Class T:			Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	116	67	Ausgegeben und aufgerechnet	941	6.160
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(51)	(60)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.959)	(2.673)
	65	7		(5.018)	3.487
Class Z:			ausschüttend II		
ausschüttend			Ausgegeben und aufgerechnet	1.259	6.557
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.016)	(2.074)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)		(2.757)	4.483
	k. A.	(1)	Class T EUR (Hedged):		
			thesaurierend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	253	588
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(924)	(587)
				(671)	1
			ausschüttend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	67	238
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(228)	(218)
				(161)	20
				<b>Total Return Bond Fund</b>	
			Institutional:		
			thesaurierend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	26.053	25.401
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21.690)	(14.504)
				4.363	10.897
			ausschüttend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	1.931	410
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	115	164
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.077)	(2.472)
				969	(1.898)
			Institutional CAD (Hedged):		
			ausschüttend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	666	429
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	9
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(715)	(186)
				(43)	252
			Institutional CHF (Hedged):		
			thesaurierend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	454	131
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(86)	(111)
				368	20
			Institutional EUR (Hedged):		
			thesaurierend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	11.975	5.407
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.206)	(11.604)
				5.769	(6.197)
			ausschüttend		
			Ausgegeben und aufgerechnet	3.268	2.461
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	250	293
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.982)	(1.203)
				1.536	1.551

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Total Return Bond Fund (Fortsetzung)			Total Return Bond Fund (Fortsetzung)	
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend			Investor GBP (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	974	222	Ausgegeben und aufgerechnet	0	55
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(410)	(633)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(117)	(160)
	564	(411)		(117)	(105)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			Administrative: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	150	80	Ausgegeben und aufgerechnet	969	1.110
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(541)	(35)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.762)	(2.309)
	(391)	45		(793)	(1.199)
Erträge			Administrative EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	727	450	Ausgegeben und aufgerechnet	146	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	18	28	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(675)	(1.337)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(46)	(51)
	70	(859)		100	(51)
Institutional ILS (Hedged): thesaurierend			Class E: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	52	19	Ausgegeben und aufgerechnet	11.647	5.033
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(199)	(56)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.617)	(4.296)
	(147)	(37)		2.030	737
Institutional JPY (Hedged): thesaurierend			Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	16	Ausgegeben und aufgerechnet	5.189	2.252
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	107	171
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(201)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.052)	(4.081)
	k. A.	(185)		1.244	(1.658)
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend			Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	79	4	Ausgegeben und aufgerechnet	267	71
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4)	(1.197)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(119)	(123)
	75	(1.193)		148	(52)
Investor: thesaurierend			Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	9.843	4.164	Ausgegeben und aufgerechnet	7.515	3.066
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.900)	(4.600)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.610)	(10.021)
	1.943	(436)		(95)	(6.955)
Erträge			Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	4.693	657	Ausgegeben und aufgerechnet	1.208	956
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	9	10	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.057)	(925)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.900)	(2.121)
	3.645	(258)		(692)	(1.165)
Investor CHF (Hedged): thesaurierend			Class E HKD (Unhedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	53	31	Ausgegeben und aufgerechnet	17	284
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(90)	(154)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(61)	(566)
	(37)	(123)		(44)	(282)
Investor EUR (Hedged): thesaurierend			Class E SGD (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	291	133	Ausgegeben und aufgerechnet	904	769
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(429)	(375)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(861)	(816)
	(138)	(242)		43	(47)

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	Total Return Bond Fund (Fortsetzung)			PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
Erträge			Institutional:		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	23	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	2.146	690
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(114)	(44)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(114)	(21)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(320)	(720)
H Institutional:				1.826	(30)
thesaurierend			Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	9.223	653	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.519)	(525)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	4.704	128		k. A.	(1)
Erträge			Institutional CHF (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.143	393	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	11	6	Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(152)	(84)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	1.002	315	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9)	(470)
M Retail HKD (Unhedged):				(9)	(470)
Erträge			Institutional EUR (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	16.578	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	1.023	72
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(724)	(8.118)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(724)	8.460	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(412)	(1.664)
Class R:				611	(1.592)
thesaurierend			Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	32	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	42
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(258)	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(57)
	(258)	32		k. A.	(15)
Erträge			Institutional GBP (Hedged):		
Ausgegeben und aufgerechnet	0	0	Erträge		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	0	6
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(286)	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1
	(286)	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29)	(45)
Class R EUR (Hedged):				(29)	(38)
thesaurierend			Investor:		
Ausgegeben und aufgerechnet	164	436	thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(934)	(469)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(770)	(33)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21)	(13)
Class R GBP (Hedged):				(21)	(13)
Erträge			Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(4)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(18)
	k. A.	(4)		k. A.	(18)
Class T:			Investor EUR (Hedged):		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	1.377	246	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(378)	(210)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(4)
	999	36		k. A.	(4)
Class T EUR (Hedged):			Class E:		
thesaurierend			thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	421	58	Ausgegeben und aufgerechnet	224	90
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(94)	(53)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(117)	(174)
	327	5		107	(84)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Fortsetzung)</b>			<b>UK Corporate Bond Fund</b>		
Erträge			Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	3.148	3.718
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(12)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.096)	(7.712)
	k. A.	(12)		52	(3.994)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend			Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	25.523	20.072
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(12)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.145)	(7.639)
	k. A.	(12)		17.385	12.433
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			H Institutional: Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	132	34	Ausgegeben und aufgerechnet	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(952)	(75)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	(820)	(41)		0	1
Erträge			Class R: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	0	40
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(17)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(103)	(91)
	k. A.	(17)		(103)	(51)
Class E GBP (Hedged): Erträge			Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(5)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(5)		k. A.	(1)
Class R: thesaurierend			Class Z: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	0	8.715
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.000)	0
	k. A.	(1)		(1.000)	8.715
Class R EUR (Hedged): thesaurierend			<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Institutional: thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	1.211	1.988
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(4)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	k. A.	(4)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.675)	(1.868)
Class R GBP (Hedged): Erträge				(464)	120
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Erträge		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Ausgegeben und aufgerechnet	138	140
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(6)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	71	83
	k. A.	(6)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.025)	(1.702)
Class Z: thesaurierend				(3.816)	(1.479)
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	<b>US High Yield Bond Fund</b>		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Institutional: thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)	Ausgegeben und aufgerechnet	64.507	18.096
	k. A.	(1)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(43.774)	(17.382)
				20.733	714

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
	US High Yield Bond Fund (Fortsetzung)			US High Yield Bond Fund (Fortsetzung)	
Erträge			Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	14.671	10.994	Ausgegeben und aufgerechnet	9.479	9.600
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	321	358	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	67	75
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.247)	(4.800)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.605)	(10.306)
	8.745	6.552		1.941	(631)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend			Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	265	k. A.	Ausgegeben und aufgerechnet	989	1.321
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(47)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.384)	(752)
	218	k. A.		(395)	569
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend			H Institutional: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	7.461	2.914	Ausgegeben und aufgerechnet	5.189	1.924
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.087)	(2.311)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.859)	(1.246)
	4.374	603		1.330	678
Erträge			Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	750	6.398	Ausgegeben und aufgerechnet	290	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	299	460	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.892)	(12.121)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(42)	k. A.
	(7.843)	(5.263)		248	k. A.
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			M Retail: Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	513	1.506	Ausgegeben und aufgerechnet	6.312	1.244
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(111)	(2.940)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.027)	(1.666)
	402	(1.434)		287	(419)
Erträge			Class R: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	548	335	Ausgegeben und aufgerechnet	119	97
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.720)	(420)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(81)	(540)
	(3.172)	(85)		38	(443)
Investor: thesaurierend			Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	5.692	2.605	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.970)	(4.018)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(95)
	2.722	(1.413)		k. A.	(95)
Erträge			Class R GBP (Hedged): Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.700	2.271	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	15	106	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.790)	(1.144)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(117)
	(75)	1.233		k. A.	(117)
Investor EUR (Hedged): thesaurierend			Class Z: thesaurierend		
Ausgegeben und aufgerechnet	123	73	Ausgegeben und aufgerechnet	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(130)	(27)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(1.375)
	(7)	46		0	(1.375)
Class E: thesaurierend			<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>		
Ausgegeben und aufgerechnet	2.831	3.007	Institutional: thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Ausgegeben und aufgerechnet	14.087	11.370
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.148)	(1.984)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	683	1.023	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.530)	(2.060)
				4.557	9.310

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019
<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund (Fortsetzung)</b>			<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund (Fortsetzung)</b>		
Erträge			Erträge		
Ausgegeben und aufgerechnet	7.595	4.848	Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	4	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.846)	(1.027)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	1.755	3.825		k. A.	(1)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend			<b>US Short-Term Fund</b>		
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Institutional:		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(24)	Ausgegeben und aufgerechnet	169.833	95.548
	k. A.	(24)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(110.655)	(91.746)
Ausgegeben und aufgerechnet	21.133	15.283		59.178	3.802
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Erträge		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.071)	(5.916)	Ausgegeben und aufgerechnet	20.798	k. A.
	8.062	9.367	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	15	k. A.
Erträge			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.370)	k. A.
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0		19.443	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(49)	Ausgegeben und aufgerechnet	22.231	14.952
	k. A.	(49)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Institutional GBP (Hedged): ausschüttend II			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14.074)	(63.847)
Ausgegeben und aufgerechnet	23.226	25.438		8.157	(48.895)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	835	233	Investor:		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.965)	(758)	thesaurierend		
	6.096	24.913	Ausgegeben und aufgerechnet	1.120	5.162
Class E:			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
thesaurierend			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.136)	(4.424)
Ausgegeben und aufgerechnet	3.533	1		(2.016)	738
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Class E:		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.031)	0	thesaurierend		
	2.502	1	Ausgegeben und aufgerechnet	38.207	41.479
Erträge			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Ausgegeben und aufgerechnet	1.287	81	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(32.892)	(25.992)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		5.315	15.487
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(197)	(104)	Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
	1.090	(23)	Ausgegeben und aufgerechnet	1.146	1.083
Class E EUR (Hedged): thesaurierend			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(543)	(1.847)
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0		603	(764)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(19)	H Institutional:		
	k. A.	(19)	thesaurierend		
Erträge			Ausgegeben und aufgerechnet	1.581	269
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(457)	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(11)		1.124	269
	k. A.	(11)	Class Z:		
H Institutional:			Erträge		
thesaurierend			Ausgegeben und aufgerechnet	42.594	2.297
Ausgegeben und aufgerechnet	k. A.	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.235	2.212
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23.414)	(1.232)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)		20.415	3.277
	k. A.	(1)			

**19. NETTOINVENTARWERTE**

Im Folgenden sind das rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhabern zuzuschreibende Nettovermögen der einzelnen Fonds, die ausgegebenen und umlaufenden Anteile und der Nettoinventarwert je Anteil der vergangenen

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

drei Geschäftsjahre (Angaben in Tausend, ausgenommen Beträge je Anteil) aufgeführt. Der in diesem Abschluss veröffentlichte NIW je Anteil kann gemäß FRS 102 erforderliche Anpassungen beinhalten, wodurch der Nettoinventarwert oder die Gesamtrenditen der Anteilsinhaber von jenen abweichen können, die in diesem Abschluss veröffentlicht werden. Das Nettovermögen geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen und umlaufenden Anteile kann vom NIW aufgrund gerundeter Werte abweichen:

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Nettovermögen</b>	<b>\$ 890.928</b>	<b>\$ 226.380</b>	<b>k. A.</b>
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 265.889	\$ 33.585	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.044	3.061	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,54	\$ 10,97	k. A.
Erträge	\$ 43.289	\$ 9.285	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.163	888	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,40	\$ 10,46	k. A.
<b>Institutional CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 6.108	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	586	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,43	k. A.	k. A.
Erträge	CHF 860	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	83	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,32	k. A.	k. A.
<b>Institutional EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 38.336	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.662	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,47	k. A.	k. A.
Erträge	€ 11.559	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.120	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,32	k. A.	k. A.
<b>Investor:</b>			
Erträge	\$ 66.319	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.506	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,19	k. A.	k. A.
<b>Investor AUD (Hedged):</b>			
Erträge	AUD 366	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	35	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD 10,34	k. A.	k. A.
<b>Investor EUR (Hedged):</b>			
Erträge	€ 226	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	22	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,11	k. A.	k. A.
<b>Investor RMB (Hedged):</b>			
Erträge	CNH 8.387	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	81	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CNH 103,59	k. A.	k. A.
<b>Investor SGD (Hedged):</b>			
Erträge	SGD 1.175	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	115	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,19	k. A.	k. A.
<b>Administrative:</b>			
Erträge	\$ 18.459	\$ 5.984	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.775	572	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,40	\$ 10,46	k. A.
<b>Class E:</b>			
thesaurierend	\$ 6.725	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	624	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,79	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 25.374	\$ 15.353	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.440	1.468	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,40	\$ 10,46	k. A.
<b>Class E CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 89	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	9	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,41	k. A.	k. A.

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
	<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)</b>		
Erträge	CHF 31	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,33	k. A.	k. A.
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 20.246	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.938	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,45	k. A.	k. A.
Erträge	€ 1.020	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	99	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,32	k. A.	k. A.
<b>Class E HKD (Unhedged):</b>			
Erträge	HKD 2.458	HKD 2.041	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	239	197	k. A.
NIW je Anteil	HKD 10,28	HKD 10,38	k. A.
<b>Class E SGD (Hedged):</b>			
Erträge	SGD 12.464	SGD 5.908	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.211	568	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,29	SGD 10,41	k. A.
<b>M Retail:</b>			
ausschüttend II	\$ 12.308	\$ 4.931	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.219	478	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,10	\$ 10,32	k. A.
<b>M Retail HKD (Unhedged):</b>			
ausschüttend II	HKD 1.567	HKD 85	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	157	8	k. A.
NIW je Anteil	HKD 9,98	HKD 10,24	k. A.
<b>M Retail SGD (Hedged):</b>			
ausschüttend II	SGD 7.080	SGD 3.242	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	708	316	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,00	SGD 10,27	k. A.
<b>Class Z:</b>			
thesaurierend	\$ 339.431	\$ 150.164	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.046	13.605	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,69	\$ 11,04	k. A.
<b>Nettovermögen</b>	<b>\$ 167.716</b>	<b>\$ 38.513</b>	<b>\$ 33.569</b>
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 18
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	2
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,84
Erträge	\$ 3.652	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	362	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,10	k. A.	k. A.
<b>Institutional EUR (Unhedged):</b>			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 24
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	2
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 14,27
<b>Institutional SGD (Hedged):</b>			
Erträge	SGD 4.213	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	412	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,22	k. A.	k. A.
<b>Class E:</b>			
thesaurierend	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,19	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 23.579	\$ 19.700	\$ 20.730
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.605	2.240	2.550
NIW je Anteil	\$ 9,05	\$ 8,80	\$ 8,13
<b>Class E EUR (Unhedged):</b>			
thesaurierend	€ 14.254	€ 10.485	€ 4.385
ausgegebene und umlaufende Anteile	976	705	338
NIW je Anteil	€ 14,60	€ 14,87	€ 12,97



# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)</b>			
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 465.125	€ 539.104	€ 567.201
ausgegebene und umlaufende Anteile	34.965	41.792	49.665
NIW je Anteil	€ 13,30	€ 12,90	€ 11,42
Erträge	€ 62.905	€ 93.156	€ 79.820
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.146	9.139	8.593
NIW je Anteil	€ 10,23	€ 10,19	€ 9,29
M Retail:			
ausschüttend II	\$ 218.504	\$ 265.793	\$ 251.307
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.788	25.482	26.804
NIW je Anteil	\$ 10,51	\$ 10,43	\$ 9,38
M Retail HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 23.223	HKD 33.662	HKD 32.309
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.148	3.176	3.433
NIW je Anteil	HKD 10,81	HKD 10,60	HKD 9,41
M Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 67.688	SGD 45.242	SGD 48.913
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.533	4.363	5.214
NIW je Anteil	SGD 10,36	SGD 10,37	SGD 9,38
Class R:			
Erträge	\$ 5.913	\$ 12.788	\$ 6.552
ausgegebene und umlaufende Anteile	514	1.138	660
NIW je Anteil	\$ 11,51	\$ 11,23	\$ 9,93
Class R EUR (Hedged):			
Erträge	€ 9.666	€ 19.311	€ 17.987
ausgegebene und umlaufende Anteile	970	1.945	1.988
NIW je Anteil	€ 9,97	€ 9,93	€ 9,05
Class R GBP (Hedged):			
Erträge	£ 6.265	£ 5.847	£ 6.677
ausgegebene und umlaufende Anteile	603	564	715
NIW je Anteil	£ 10,39	£ 10,37	£ 9,34
Class T:			
Erträge	\$ 10.970	\$ 9.323	\$ 6.944
ausgegebene und umlaufende Anteile	933	813	685
NIW je Anteil	\$ 11,75	\$ 11,47	\$ 10,14
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 68.823	€ 84.433	€ 51.176
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.673	7.148	4.874
NIW je Anteil	€ 12,13	€ 11,81	€ 10,50
Class Z:			
Erträge	\$ 71.902	\$ 108.140	\$ 83.952
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.708	8.798	7.724
NIW je Anteil	\$ 12,60	\$ 12,29	\$ 10,87
Class Z AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 125.272	AUD 119.450	AUD 64.756
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.181	10.683	6.480
NIW je Anteil	AUD 11,20	AUD 11,18	AUD 9,99
<b>PIMCO Climate Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 101.869	k. A.	k. A.
Institutional:			
thesaurierend	\$ 4.565	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	449	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,17	k. A.	k. A.
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 231	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,06	k. A.	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 16.688	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.646	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,14	k. A.	k. A.

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>PIMCO Climate Bond Fund (Fortsetzung)</b>			
Erträge	€ 60.190	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.992	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,05	k. A.	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 1.717	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	169	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,15	k. A.	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 507	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	50	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,11	k. A.	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,18	k. A.	k. A.
<b>Commodity Real Return Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 325.109	\$ 564.401	\$ 521.092
Institutional:			
thesaurierend	\$ 162.906	\$ 433.520	\$ 368.377
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.677	67.027	62.875
NIW je Anteil	\$ 6,60	\$ 6,47	\$ 5,86
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 31.294	€ 1.232	€ 4.766
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.723	185	767
NIW je Anteil	€ 6,63	€ 6,65	€ 6,22
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 14.663	£ 14.684	£ 9.336
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.597	1.589	1.092
NIW je Anteil	£ 9,18	£ 9,24	£ 8,55
Investor:			
thesaurierend	\$ 10.609	\$ 12.224	\$ 20.609
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.851	2.170	4.024
NIW je Anteil	\$ 5,73	\$ 5,63	\$ 5,12
Class E:			
thesaurierend	\$ 66.707	\$ 70.711	\$ 86.485
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.411	13.311	17.811
NIW je Anteil	\$ 5,37	\$ 5,31	\$ 4,86
Erträge	k. A.	\$ 1.785	\$ 1.863
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	483	552
NIW je Anteil	k. A.	\$ 3,69	\$ 3,38
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 21.703	€ 22.498	€ 23.034
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.204	4.302	4.672
NIW je Anteil	€ 5,16	€ 5,23	€ 4,93
G Institutional EUR (Hedged):			
Erträge	k. A.	€ 63	€ 78
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	7	9
NIW je Anteil	k. A.	€ 9,23	€ 8,62
<b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 144.512	\$ 149.347	\$ 141.586
Institutional:			
thesaurierend	\$ 46.003	\$ 47.768	\$ 38.089
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.308	3.546	3.054
NIW je Anteil	\$ 13,91	\$ 13,47	\$ 12,47
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 22.715	CHF 22.653	CHF 22.233
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.084	2.107	2.160
NIW je Anteil	CHF 10,90	CHF 10,75	CHF 10,29

	Zum 31. Dez. 2020		Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2018	
	<b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Fortsetzung)</b>					
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	41.292	€	32.570	€	31.461
ausgegeben und umlaufende Anteile		3.320		2.662		2.698
NIW je Anteil	€	12,44	€	12,23	€	11,66
ausschüttend II		k. A.	€	651	€	373
ausgegeben und umlaufende Anteile		k. A.		78		45
NIW je Anteil		k. A.	€	8,32	€	8,37
Investor:						
thesaurierend		k. A.		k. A.	\$	10
ausgegeben und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		1
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	\$	10,30
Erträge		k. A.		k. A.	\$	10
ausgegeben und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		1
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	\$	9,62
Class E:						
thesaurierend	\$	8.496	\$	14.637	\$	15.542
ausgegeben und umlaufende Anteile		726		1.281		1.456
NIW je Anteil	\$	11,70	\$	11,43	\$	10,67
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	11.273	€	22.358	€	24.225
ausgegeben und umlaufende Anteile		1.075		2.150		2.421
NIW je Anteil	€	10,48	€	10,40	€	10,00
Class T EUR (Hedged):						
thesaurierend		k. A.	€	1.034	€	1.134
ausgegeben und umlaufende Anteile		k. A.		103		117
NIW je Anteil		k. A.	€	10,05	€	9,70
	<b>Diversified Income Fund</b>					
Nettovermögen	\$	18.641.861	\$	12.274.587	\$	6.819.035
Institutional:						
thesaurierend	\$	1.066.263	\$	851.517	\$	336.872
ausgegeben und umlaufende Anteile		37.907		32.654		14.769
NIW je Anteil	\$	28,13	\$	26,08	\$	22,81
Erträge	\$	830.361	\$	427.605	\$	75.080
ausgegeben und umlaufende Anteile		51.315		27.576		5.319
NIW je Anteil	\$	16,18	\$	15,51	\$	14,11
Institutional CAD (Hedged):						
thesaurierend	CAD	423.593	CAD	60.544		k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile		36.151		5.531		k. A.
NIW je Anteil	CAD	11,72	CAD	10,95		k. A.
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	19.775	CHF	18.520	CHF	9.800
ausgegeben und umlaufende Anteile		1.322		1.306		764
NIW je Anteil	CHF	14,96	CHF	14,18	CHF	12,83
Erträge	CHF	19.392	CHF	6.867	CHF	1.912
ausgegeben und umlaufende Anteile		2.014		728		215
NIW je Anteil	CHF	9,63	CHF	9,43	CHF	8,87
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	1.697.782	€	1.036.450	€	728.881
ausgegeben und umlaufende Anteile		89.784		57.956		45.235
NIW je Anteil	€	18,91	€	17,88	€	16,11

	Zum 31. Dez. 2020		Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2018	
	<b>Diversified Income Fund (Fortsetzung)</b>					
Erträge	€	933.208	€	977.714	€	585.915
ausgegeben und umlaufende Anteile		90.802		97.353		62.199
NIW je Anteil	€	10,28	€	10,04	€	9,42
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	1.623.041	£	1.006.549	£	943.787
ausgegeben und umlaufende Anteile		105.382		69.297		72.974
NIW je Anteil	£	15,40	£	14,53	£	12,93
Erträge	£	1.020.119	£	734.099	£	585.651
ausgegeben und umlaufende Anteile		133.743		98.669		84.942
NIW je Anteil	£	7,63	£	7,44	£	6,89
Institutional MXN (Hedged):						
thesaurierend	MXN	5.392		k. A.		k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile		53		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	MXN	101,13		k. A.		k. A.
Institutional SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK	258.455	SEK	244.650	SEK	274.672
ausgegeben und umlaufende Anteile		1.325		1.326		1.657
NIW je Anteil	SEK	195,03	SEK	184,53	SEK	165,79
Institutional SGD (Hedged):						
Erträge	SGD	30.850	SGD	8.671		k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile		2.946		858		k. A.
NIW je Anteil	SGD	10,47	SGD	10,11		k. A.
Investor:						
thesaurierend	\$	63.761	\$	38.078	\$	20.271
ausgegeben und umlaufende Anteile		4.440		2.850		1.729
NIW je Anteil	\$	14,36	\$	13,36	\$	11,73
Erträge	\$	43.507	\$	18.863	\$	6.579
ausgegeben und umlaufende Anteile		3.986		1.803		691
NIW je Anteil	\$	10,92	\$	10,46	\$	9,52
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	29.190	€	19.960	€	10.227
ausgegeben und umlaufende Anteile		1.618		1.166		661
NIW je Anteil	€	18,04	€	17,12	€	15,48
Erträge	€	8.787	€	4.207	€	3.344
ausgegeben und umlaufende Anteile		905		444		376
NIW je Anteil	€	9,70	€	9,48	€	8,90
Administrative:						
Erträge	\$	144.682	\$	69.700	\$	14.506
ausgegeben und umlaufende Anteile		12.123		6.094		1.393
NIW je Anteil	\$	11,94	\$	11,44	\$	10,41
Administrative AUD (Hedged):						
Erträge	AUD	4.404	AUD	25		k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile		413		2		k. A.
NIW je Anteil	AUD	10,65	AUD	10,37		k. A.
Administrative EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	12.496	€	7.653	€	1.576
ausgegeben und umlaufende Anteile		707		456		104
NIW je Anteil	€	17,67	€	16,80	€	15,21
Administrative GBP (Hedged):						
Erträge	£	11.699	£	3.930	£	2.924
ausgegeben und umlaufende Anteile		1.048		361		290
NIW je Anteil	£	11,17	£	10,89	£	10,09

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			Zum 31. Dez. 2018		
<b>Diversified Income Fund (Fortsetzung)</b>									
Administrative SEK (Hedged):									
thesaurierend	SEK	85		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	SEK	100,08		k. A.		k. A.			
Administrative SGD (Hedged):									
Erträge	SGD	136.614	SGD	41.088		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.691		3.956		k. A.			
NIW je Anteil	SGD	10,76	SGD	10,39		k. A.			
Class E:									
thesaurierend	\$	1.457.105	\$	797.573	\$	355.573			
ausgegebene und umlaufende Anteile		59.069		34.563		17.459			
NIW je Anteil	\$	24,67	\$	23,08	\$	20,37			
Erträge	\$	808.596	\$	625.102	\$	437.960			
ausgegebene und umlaufende Anteile		55.978		45.166		34.767			
NIW je Anteil	\$	14,44	\$	13,84	\$	12,60			
Class E CHF (Hedged):									
thesaurierend	CHF	7.607	CHF	1.794		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		721		178		k. A.			
NIW je Anteil	CHF	10,55	CHF	10,09		k. A.			
Class E EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	1.798.793	€	1.261.962	€	734.955			
ausgegebene und umlaufende Anteile		106.656		78.408		50.227			
NIW je Anteil	€	16,87	€	16,09	€	14,63			
Erträge	€	1.638.721	€	1.450.954	€	685.235			
ausgegebene und umlaufende Anteile		139.927		126.777		63.835			
NIW je Anteil	€	11,71	€	11,44	€	10,73			
Class E SGD (Hedged):									
Erträge	SGD	83.189	SGD	10.279		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.977		1.022		k. A.			
NIW je Anteil	SGD	10,43	SGD	10,06		k. A.			
H Institutional:									
thesaurierend	\$	1.307.826	\$	985.251	\$	256.806			
ausgegebene und umlaufende Anteile		61.420		49.824		14.822			
NIW je Anteil	\$	21,29	\$	19,77	\$	17,33			
Erträge	\$	27		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		2		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	\$	11,04		k. A.		k. A.			
M Retail:									
Erträge	\$	348.905	\$	341.328	\$	95.646			
ausgegebene und umlaufende Anteile		28.250		28.851		8.878			
NIW je Anteil	\$	12,35	\$	11,83	\$	10,77			
ausschüttend II	\$	452.614	\$	168.224	\$	18.293			
ausgegebene und umlaufende Anteile		44.209		16.884		1.984			
NIW je Anteil	\$	10,24	\$	9,96	\$	9,22			
M Retail AUD (Hedged):									
Erträge	AUD	148.786	AUD	65.064	AUD	13.063			
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.851		5.776		1.260			
NIW je Anteil	AUD	11,58	AUD	11,27	AUD	10,37			
N Retail:									
ausschüttend II	\$	10		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	\$	10,48		k. A.		k. A.			

  

	Zum 31. Dez. 2020			Zum 31. Dez. 2019			Zum 31. Dez. 2018		
<b>Diversified Income Fund (Fortsetzung)</b>									
Class R:									
Erträge		k. A.		k. A.		\$	1.538		
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.			159		
NIW je Anteil		k. A.		k. A.		\$	9,66		
Class T:									
thesaurierend	\$	31.960	\$	17.487	\$	4.786			
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.382		1.388		429			
NIW je Anteil	\$	13,42	\$	12,60	\$	11,17			
Erträge	\$	9.265	\$	3.687	\$	1.989			
ausgegebene und umlaufende Anteile		817		339		201			
NIW je Anteil	\$	11,34	\$	10,87	\$	9,89			
Class T EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	56.537	€	41.256	€	23.651			
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.752		3.619		2.273			
NIW je Anteil	€	11,90	€	11,40	€	10,40			
Erträge	€	35.099	€	35.250	€	16.283			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.500		3.597		1.771			
NIW je Anteil	€	10,03	€	9,80	€	9,19			
W Class:									
thesaurierend	\$	46.301		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.453		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	\$	10,40		k. A.		k. A.			
Erträge	\$	36.531		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.555		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	\$	10,28		k. A.		k. A.			
W Class CAD (Hedged):									
thesaurierend	CAD	14		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	CAD	10,39		k. A.		k. A.			
W Class CHF (Hedged):									
thesaurierend	CHF	12.711		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.229		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	CHF	10,35		k. A.		k. A.			
Erträge	CHF	10		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	CHF	10,23		k. A.		k. A.			
W Class EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	10.643		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.028		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	€	10,35		k. A.		k. A.			
Erträge	€	7.733		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		756		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	€	10,23		k. A.		k. A.			
W Class GBP (Hedged):									
thesaurierend	£	420		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		40		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	£	10,38		k. A.		k. A.			
Erträge	£	767		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		75		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	£	10,26		k. A.		k. A.			
W Class SGD (Hedged):									
Erträge	SGD	3.397		k. A.		k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile		330		k. A.		k. A.			
NIW je Anteil	SGD	10,28		k. A.		k. A.			
<b>Diversified Income Duration Hedged Fund</b>									
Nettovermögen	\$	1.486.931	\$	1.269.937	\$	1.273.910			
Institutional:									
thesaurierend	\$	30.325	\$	85.231	\$	136.181			
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.073		5.857		10.348			
NIW je Anteil	\$	14,63	\$	14,55	\$	13,16			

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
	<b>Diversified Income Duration Hedged Fund (Fortsetzung)</b>				<b>Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)</b>		
Erträge	\$ 2.258	\$ 3.004	\$ 5.168	Institutional CAD (Hedged):			
ausgegebene und umlaufende Anteile	212	274	501	thesaurierend	CAD 17.931	CAD 19.688	CAD 23.088
NIW je Anteil	\$ 10,65	\$ 10,95	\$ 10,32	ausgegebene und umlaufende Anteile	1.635	1.890	2.307
Institutional EUR (Hedged):				NIW je Anteil	CAD 10,96	CAD 10,42	CAD 10,01
thesaurierend	€ 96.172	€ 90.249	€ 78.320	Institutional CHF (Hedged):			
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.219	6.677	6.219	thesaurierend	CHF 71.980	CHF 70.591	CHF 66.943
NIW je Anteil	€ 13,32	€ 13,52	€ 12,59	ausgegebene und umlaufende Anteile	6.448	6.567	6.312
ausschüttend II	€ 41.836	€ 55.604	€ 87.575	NIW je Anteil	CHF 11,16	CHF 10,75	CHF 10,61
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.045	6.356	10.243	Institutional EUR (Hedged):			
NIW je Anteil	€ 8,29	€ 8,75	€ 8,55	thesaurierend	€ 467.029	€ 714.856	€ 585.054
Institutional GBP (Hedged):				ausgegebene und umlaufende Anteile	35.268	56.192	46.804
thesaurierend	£ 443.936	£ 423.773	£ 353.571	NIW je Anteil	€ 13,24	€ 12,72	€ 12,50
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.048	29.261	26.501	Erträge	€ 10.018	€ 20.627	€ 21.879
NIW je Anteil	£ 14,30	£ 14,48	£ 13,34	ausgegebene und umlaufende Anteile	974	2.038	2.133
Erträge	£ 238.667	£ 52.230	£ 59.864	NIW je Anteil	€ 10,29	€ 10,12	€ 10,26
ausgegebene und umlaufende Anteile	26.610	5.562	6.644	Institutional GBP (Hedged):			
NIW je Anteil	£ 8,97	£ 9,39	£ 9,01	thesaurierend	£ 827.076	£ 815.222	£ 657.755
Investor:				ausgegebene und umlaufende Anteile	62.634	64.656	53.732
thesaurierend	\$ 10.807	\$ 6.972	\$ 15.159	NIW je Anteil	£ 13,20	£ 12,61	£ 12,24
ausgegebene und umlaufende Anteile	880	569	1.363	Erträge	£ 242.182	£ 225.002	£ 5.735
NIW je Anteil	\$ 12,28	\$ 12,25	\$ 11,12	ausgegebene und umlaufende Anteile	24.507	23.216	591
Erträge	k. A.	\$ 247	\$ 1.499	NIW je Anteil	£ 9,88	£ 9,69	£ 9,70
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	25	159	Institutional NOK (Hedged):			
NIW je Anteil	k. A.	\$ 9,98	\$ 9,40	thesaurierend	NOK 137.483	NOK 130.919	NOK 183.987
Class E:				ausgegebene und umlaufende Anteile	10.428	10.391	15.123
thesaurierend	\$ 38.133	\$ 32.527	\$ 40.860	NIW je Anteil	NOK 13,18	NOK 12,60	NOK 12,17
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.145	2.672	3.678	Institutional SEK (Hedged):			
NIW je Anteil	\$ 12,13	\$ 12,17	\$ 11,11	thesaurierend	SEK 502.097	SEK 501.616	SEK 485.358
Erträge	\$ 28.229	\$ 38.998	\$ 41.744	ausgegebene und umlaufende Anteile	4.761	4.963	4.900
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.785	3.744	4.255	NIW je Anteil	SEK 105,47	SEK 101,07	SEK 99,05
NIW je Anteil	\$ 10,13	\$ 10,41	\$ 9,81	Investor:			
Class E EUR (Hedged):				thesaurierend	\$ 52.628	\$ 68.930	\$ 62.980
thesaurierend	€ 185.348	€ 216.296	€ 214.475	ausgegebene und umlaufende Anteile	4.199	5.790	5.527
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.936	17.026	17.957	NIW je Anteil	\$ 12,53	\$ 11,90	\$ 11,40
NIW je Anteil	€ 12,41	€ 12,70	€ 11,94	Erträge	\$ 2.996	\$ 4.308	\$ 3.604
Erträge	€ 39.600	€ 56.500	€ 60.087	ausgegebene und umlaufende Anteile	292	433	368
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.678	6.371	6.980	NIW je Anteil	\$ 10,27	\$ 9,96	\$ 9,80
NIW je Anteil	€ 8,46	€ 8,87	€ 8,61	Investor EUR (Hedged):			
Class R:				thesaurierend	€ 3.373	€ 1.412	€ 4.409
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 1.468	ausgegebene und umlaufende Anteile	298	129	409
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	155	NIW je Anteil	€ 11,34	€ 10,93	€ 10,77
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 9,48	Administrative:			
Class T:				thesaurierend	\$ 31.246	\$ 28.795	\$ 30.079
thesaurierend	k. A.	\$ 2.440	\$ 1.772	ausgegebene und umlaufende Anteile	2.242	2.172	2.367
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	207	164	NIW je Anteil	\$ 13,93	\$ 13,26	\$ 12,71
NIW je Anteil	k. A.	\$ 11,78	\$ 10,80	Administrative EUR (Hedged):			
	<b>Dynamic Bond Fund</b>			thesaurierend	€ 4.758	€ 10.558	€ 9.990
Nettovermögen	\$ 3.204.860	\$ 3.888.271	\$ 3.087.145	ausgegebene und umlaufende Anteile	379	872	836
Institutional:				NIW je Anteil	€ 12,54	€ 12,11	€ 11,95
thesaurierend	\$ 533.694	\$ 965.957	\$ 828.361	Administrative SEK (Hedged):			
ausgegebene und umlaufende Anteile	36.253	69.318	62.320	thesaurierend	SEK 96.229	SEK 108.853	SEK 141.214
NIW je Anteil	\$ 14,72	\$ 13,94	\$ 13,29	ausgegebene und umlaufende Anteile	838	985	1.297
Erträge	\$ 50.835	\$ 66.545	\$ 22.386	NIW je Anteil	SEK 114,77	SEK 110,53	SEK 108,87
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.429	5.978	2.045	Class E:			
NIW je Anteil	\$ 11,48	\$ 11,13	\$ 10,95	thesaurierend	\$ 74.125	\$ 93.374	\$ 77.913
				ausgegebene und umlaufende Anteile	6.092	8.035	6.965
				NIW je Anteil	\$ 12,17	\$ 11,62	\$ 11,19
				Erträge	\$ 19.575	\$ 27.944	\$ 22.625
				ausgegebene und umlaufende Anteile	1.866	2.747	2.261
				NIW je Anteil	\$ 10,49	\$ 10,17	\$ 10,01

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Class E CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 11.815	CHF 14.082	CHF 16.233
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.164	1.427	1.653
NIW je Anteil	CHF 10,15	CHF 9,87	CHF 9,82
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 104.878	€ 142.298	€ 175.105
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.748	12.244	15.197
NIW je Anteil	€ 11,99	€ 11,62	€ 11,52
<b>Class E GBP (Hedged):</b>			
thesaurierend	£ 3.947	£ 3.304	£ 4.328
ausgegebene und umlaufende Anteile	336	292	390
NIW je Anteil	£ 11,76	£ 11,33	£ 11,10
<b>G Retail EUR (Hedged):</b>			
Erträge	€ 10.799	€ 25.618	€ 30.455
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.174	2.834	3.324
NIW je Anteil	€ 9,20	€ 9,04	€ 9,16
<b>H Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 4.868	\$ 1.225	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	440	117	1
NIW je Anteil	\$ 11,07	\$ 10,49	\$ 10,03
Erträge	\$ 11	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,32	k. A.	k. A.
<b>Class R:</b>			
thesaurierend	\$ 8.296	\$ 8.944	\$ 10.062
ausgegebene und umlaufende Anteile	689	784	925
NIW je Anteil	\$ 12,03	\$ 11,40	\$ 10,89
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 404
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	42
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 9,50
<b>Class Z AUD (Hedged):</b>			
Erträge	AUD 34.486	AUD 42.104	AUD 56.432
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.276	4.094	5.522
NIW je Anteil	AUD 10,53	AUD 10,29	AUD 10,22

	Dynamic Multi-Asset Fund		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
Nettovermögen	€ 5.128.926	€ 1.604.773	€ 1.187.964
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	€ 2.129.409	€ 540.866	€ 607.651
ausgegebene und umlaufende Anteile	153.874	46.023	56.248
NIW je Anteil	€ 13,84	€ 11,75	€ 10,80
ausschüttend II	€ 251.480	€ 33.517	€ 27.711
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.963	2.922	2.594
NIW je Anteil	€ 13,26	€ 11,47	€ 10,68
<b>Institutional CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 4.488	CHF 1.538	CHF 1.419
ausgegebene und umlaufende Anteile	373	150	150
NIW je Anteil	CHF 12,04	CHF 10,26	CHF 9,46
<b>Institutional GBP (Hedged):</b>			
thesaurierend	£ 216.239	£ 174.768	£ 1.620
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.034	14.320	146
NIW je Anteil	£ 14,38	£ 12,20	£ 11,09

	Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Erträge</b>			
ausgegebene und umlaufende Anteile	£ 610	£ 8	k. A.
NIW je Anteil	£ 12,68	£ 10,78	k. A.
<b>Institutional USD (Hedged):</b>			
thesaurierend	\$ 175.228	\$ 35.734	\$ 46.619
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.398	2.777	4.058
NIW je Anteil	\$ 15,37	\$ 12,87	\$ 11,49
<b>Investor:</b>			
thesaurierend	€ 6.410	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	589	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,88	k. A.	k. A.
<b>Class E:</b>			
thesaurierend	€ 1.985.483	€ 724.815	€ 497.206
ausgegebene und umlaufende Anteile	150.907	64.231	47.456
NIW je Anteil	€ 13,16	€ 11,28	€ 10,48
Erträge	k. A.	€ 1.372	€ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	137	1
NIW je Anteil	k. A.	€ 10,01	€ 9,29
Erträge	€ 1.063	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	97	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,94	k. A.	k. A.
<b>Class E USD (Hedged):</b>			
thesaurierend	\$ 129.718	\$ 2.457	\$ 823
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.795	219	82
NIW je Anteil	\$ 13,24	\$ 11,20	\$ 10,10
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,10
<b>H Institutional USD (Hedged):</b>			
thesaurierend	\$ 70.265	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.498	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,81	k. A.	k. A.
<b>M Retail SGD (Hedged):</b>			
ausschüttend II	SGD 346	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	34	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,16	k. A.	k. A.
<b>M Retail USD (Hedged):</b>			
ausschüttend II	\$ 84.157	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.457	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,29	k. A.	k. A.
<b>Class T:</b>			
thesaurierend	€ 56.375	€ 9.854	€ 10.813
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.605	935	1.100
NIW je Anteil	€ 12,24	€ 10,54	€ 9,83
<b>Class Z:</b>			
thesaurierend	€ 76.639	€ 52.645	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.254	5.101	k. A.
NIW je Anteil	€ 12,25	€ 10,32	k. A.

	Emerging Local Bond Fund		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
Nettovermögen	\$ 2.849.284	\$ 2.772.000	\$ 2.281.384
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 1.942.594	\$ 1.342.180	\$ 803.263
ausgegebene und umlaufende Anteile	132.226	94.430	65.667
NIW je Anteil	\$ 14,69	\$ 14,21	\$ 12,23
Erträge	\$ 94.610	\$ 89.420	\$ 84.676
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.100	11.198	11.588
NIW je Anteil	\$ 7,82	\$ 7,99	\$ 7,31

	Zum 31. Dez. 2020		Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2018	
Emerging Local Bond Fund (Fortsetzung)						
Institutional CHF (Unhedged):						
thesaurierend	CHF	491	CHF	560	CHF	99.114
ausgegebene und umlaufende Anteile		51		55		11.162
NIW je Anteil	CHF	9,56	CHF	10,14	CHF	8,88
Institutional EUR (Unhedged):						
thesaurierend	€	165.027	€	138.760	€	141.660
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.458		9.934		12.001
NIW je Anteil	€	13,25	€	13,97	€	11,80
Erträge	€	288.525	€	722.464	€	703.795
ausgegebene und umlaufende Anteile		39.179		88.124		95.520
NIW je Anteil	€	7,36	€	8,20	€	7,37
Institutional GBP (Unhedged):						
thesaurierend	£	2.910	£	82.731	£	78.090
ausgegebene und umlaufende Anteile		137		3.904		4.117
NIW je Anteil	£	21,23	£	21,19	£	18,97
Investor:						
thesaurierend	\$	24.099	\$	20.968	\$	13.014
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.159		1.936		1.392
NIW je Anteil	\$	11,16	\$	10,83	\$	9,35
Investor CHF (Unhedged):						
thesaurierend	k. A.	CHF	1.340	CHF	1.481	
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	121		153	
NIW je Anteil	k. A.	CHF	11,04	CHF	9,71	
Investor EUR (Unhedged):						
thesaurierend	k. A.	€	4.266	€	4.005	
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	328		363	
NIW je Anteil	k. A.	€	13,01	€	11,03	
thesaurierend	€	3.074	€	633	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		325		63	k. A.	
NIW je Anteil	€	9,47	€	10,02	k. A.	
Class E:						
thesaurierend	\$	53.089	\$	53.381	\$	45.471
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.070		4.189		4.105
NIW je Anteil	\$	13,04	\$	12,74	\$	11,08
Erträge	\$	22.053	\$	23.295	\$	21.049
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.012		3.116		3.077
NIW je Anteil	\$	7,32	\$	7,48	\$	6,84
Class E EUR (Unhedged):						
thesaurierend	€	102.405	€	120.481	€	98.642
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.974		7.704		7.389
NIW je Anteil	€	14,68	€	15,64	€	13,35
Erträge	€	2.018	€	2.493	€	2.503
ausgegebene und umlaufende Anteile		202		224		250
NIW je Anteil	€	10,00	€	11,12	€	10,02
Class T EUR (Unhedged):						
thesaurierend	k. A.		k. A.		€	267
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		29
NIW je Anteil	k. A.		k. A.		€	9,39
Class Z:						
Erträge	\$	21.833	\$	20.934	\$	25.422
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.331		2.188		2.903
NIW je Anteil	\$	9,37	\$	9,57	\$	8,76

	Zum 31. Dez. 2020		Zum 31. Dez. 2019		Zum 31. Dez. 2018	
Emerging Markets Bond Fund						
Nettovermögen	\$	5.263.015	\$	4.001.722	\$	2.428.290
Institutional:						
thesaurierend	\$	1.855.635	\$	799.018	\$	451.690
ausgegebene und umlaufende Anteile		33.297		15.372		10.050
NIW je Anteil	\$	55,73	\$	51,98	\$	44,94
Erträge	\$	79.496	\$	58.672	\$	61.887
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.984		3.023		3.517
NIW je Anteil	\$	19,95	\$	19,41	\$	17,60
Institutional CHF (Hedged):						
Erträge	CHF	101.703	CHF	81.805	CHF	74.264
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.020		4.052		3.921
NIW je Anteil	CHF	20,26	CHF	20,19	CHF	18,94
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	727.017	€	686.888	€	289.777
ausgegebene und umlaufende Anteile		16.095		15.946		7.549
NIW je Anteil	€	45,17	€	43,07	€	38,38
Erträge	€	768.610	€	1.189.920	€	780.440
ausgegebene und umlaufende Anteile		80.394		125.183		87.843
NIW je Anteil	€	9,56	€	9,51	€	8,88
Institutional EUR (Unhedged):						
thesaurierend	€	156.149	€	159.929	€	42.284
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.896		12.993		4.045
NIW je Anteil	€	12,11	€	12,31	€	10,45
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	13.006	£	23.908	£	16.476
ausgegebene und umlaufende Anteile		442		855		669
NIW je Anteil	£	29,43	£	27,98	£	24,63
Erträge	£	67.185	£	86.646	£	73.667
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.988		18.185		16.748
NIW je Anteil	£	4,80	£	4,76	£	4,40
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	16.392	SGD	5.948	SGD	1.023
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.340		517		102
NIW je Anteil	SGD	12,23	SGD	11,49	SGD	10,01
Investor:						
thesaurierend	\$	7.681	\$	6.869	\$	5.710
ausgegebene und umlaufende Anteile		147		141		135
NIW je Anteil	\$	52,22	\$	48,87	\$	42,41
Erträge	k. A.		k. A.		\$	486
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		42
NIW je Anteil	k. A.		k. A.		\$	11,52
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	k. A.	€	3.750	€	3.317	
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		93		92
NIW je Anteil	k. A.	€	40,35	€	36,09	
thesaurierend	€	4.086	€	459	k. A.	
ausgegebene und umlaufende Anteile		390		46	k. A.	
NIW je Anteil	€	10,48	€	10,03	k. A.	

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Emerging Markets Bond Fund (Fortsetzung)</b>			
Administrative:			
thesaurierend	\$ 34.306	\$ 29.152	\$ 25.139
ausgegebene und umlaufende Anteile	670	607	603
NIW je Anteil	\$ 51,20	\$ 47,99	\$ 41,70
Class E:			
thesaurierend	\$ 185.616	\$ 115.216	\$ 64.370
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.793	2.502	1.602
NIW je Anteil	\$ 48,93	\$ 46,05	\$ 40,18
Erträge	\$ 151.156	\$ 105.165	\$ 122.046
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.574	8.997	11.511
NIW je Anteil	\$ 12,02	\$ 11,69	\$ 10,60
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 195.834	€ 192.285	€ 129.651
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.947	5.048	3.785
NIW je Anteil	€ 39,59	€ 38,09	€ 34,25
Class E SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 12.729	SGD 10.302	SGD 10.254
ausgegebene und umlaufende Anteile	183	156	177
NIW je Anteil	SGD 69,62	SGD 66,03	SGD 58,00
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 401.692	\$ 111.856	\$ 42.097
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.371	2.197	954
NIW je Anteil	\$ 54,50	\$ 50,92	\$ 44,10
Erträge	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,22	k. A.	k. A.
M Retail:			
Erträge	\$ 14.913	\$ 13.690	\$ 18.302
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.379	1.301	1.919
NIW je Anteil	\$ 10,82	\$ 10,52	\$ 9,54
ausschüttend II	\$ 6.538	\$ 2.201	\$ 1.681
ausgegebene und umlaufende Anteile	693	236	195
NIW je Anteil	\$ 9,44	\$ 9,34	\$ 8,61
M Retail AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 9.306	AUD 5.835	AUD 4.171
ausgegebene und umlaufende Anteile	936	592	462
NIW je Anteil	AUD 9,94	AUD 9,85	AUD 9,03
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 583
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	60
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,77
Class Z:			
Erträge	\$ 6.442	\$ 5.961	\$ 9.108
ausgegebene und umlaufende Anteile	486	462	778
NIW je Anteil	\$ 13,26	\$ 12,90	\$ 11,70
Nettovermögen			
Institutional:			
thesaurierend	\$ 482.367	\$ 265.091	\$ 208.823
ausgegebene und umlaufende Anteile	26.644	15.738	14.232
NIW je Anteil	\$ 18,10	\$ 16,84	\$ 14,67

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Emerging Markets Bond ESG Fund (Fortsetzung)</b>			
Erträge	\$ 18.961	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.806	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,50	\$ 10,14	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 566.203	€ 234.194	€ 200.543
ausgegebene und umlaufende Anteile	43.901	19.078	18.201
NIW je Anteil	€ 12,90	€ 12,28	€ 11,02
Erträge	€ 111.597	€ 163.877	€ 94.716
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.631	17.297	10.650
NIW je Anteil	€ 9,59	€ 9,47	€ 8,89
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	£ 3.499	£ 197	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	341	19	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,26	£ 10,13	k. A.
Institutional GBP (Unhedged):			
Erträge	£ 7	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,76	k. A.	k. A.
Investor NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 7.902	NOK 8.594	NOK 6.653
ausgegebene und umlaufende Anteile	58	66	57
NIW je Anteil	NOK 136,26	NOK 130,41	NOK 115,56
Investor SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 12.623	SEK 12.347	SEK 10.777
ausgegebene und umlaufende Anteile	100	103	100
NIW je Anteil	SEK 125,92	SEK 120,27	SEK 108,06
Administrative:			
thesaurierend	\$ 1.121	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	102	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,04	\$ 10,32	k. A.
Erträge	\$ 293	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	28	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,50	\$ 10,14	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 83.479	€ 8.559	€ 44
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.294	779	4
NIW je Anteil	€ 11,45	€ 10,99	€ 9,95
Nettovermögen			
Institutional:			
thesaurierend	\$ 261.236	\$ 224.432	\$ 194.608
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.306	41.584	31.371
NIW je Anteil	\$ 1,28	2,425	2,057
NIW je Anteil	\$ 18,01	\$ 17,15	\$ 15,25
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 126.871	€ 88.091	€ 69.004
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.166	5.854	4.999
NIW je Anteil	€ 15,54	€ 15,05	€ 13,80
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	k. A.	£ 56	£ 5.212
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	6	582
NIW je Anteil	k. A.	£ 9,48	£ 8,96
Administrative:			
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 473
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	52
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 9,04
Class E:			
thesaurierend	\$ 22.272	\$ 20.512	\$ 12.728
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.607	1.540	1.065
NIW je Anteil	\$ 13,86	\$ 13,32	\$ 11,96

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund (Fortsetzung)</b>			
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 16.710	CHF 18.123	CHF 19.988
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.410	1.559	1.852
NIW je Anteil	CHF 11,85	CHF 11,62	CHF 10,79
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 36.387	€ 39.790	€ 35.883
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.622	2.931	2.858
NIW je Anteil	€ 13,88	€ 13,58	€ 12,55
Class Z:			
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 3.220
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	319
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,08
<b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b>			
Nettvermögen	\$ 220.309	\$ 155.506	k. A.
Institutional:			
thesaurierend	\$ 13.910	\$ 5.914	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.214	557	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,47	\$ 10,62	k. A.
Institutional EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 168.688	€ 133.268	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.309	12.634	k. A.
NIW je Anteil	€ 11,02	€ 10,55	k. A.
<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>			
Nettvermögen	\$ 32.571	\$ 74.289	\$ 51.799
Institutional:			
thesaurierend	\$ 139	\$ 12.043	\$ 13.868
ausgegebene und umlaufende Anteile	10	851	1.046
NIW je Anteil	\$ 14,44	\$ 14,14	\$ 13,25
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 7.119	€ 30.518	€ 9.637
ausgegebene und umlaufende Anteile	538	2.163	743
NIW je Anteil	€ 13,21	€ 14,11	€ 12,98
Class E:			
thesaurierend	\$ 6.144	\$ 6.953	\$ 7.719
ausgegebene und umlaufende Anteile	474	543	637
NIW je Anteil	\$ 12,97	\$ 12,81	\$ 12,12
Erträge	k. A.	\$ 2.728	\$ 2.252
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	271	230
NIW je Anteil	k. A.	\$ 10,08	\$ 9,78
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 14.366	€ 16.311	€ 14.822
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.126	1.187	1.161
NIW je Anteil	€ 12,76	€ 13,75	€ 12,76
<b>Euro Bond Fund</b>			
Nettvermögen	€ 3.243.455	€ 3.013.450	€ 1.978.440
Institutional:			
thesaurierend	€ 2.235.581	€ 2.054.158	€ 1.537.428
ausgegebene und umlaufende Anteile	82.583	79.555	63.271
NIW je Anteil	€ 27,07	€ 25,82	€ 24,30
Erträge	€ 378.659	€ 372.497	€ 66.582
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.418	21.977	4.145
NIW je Anteil	€ 17,68	€ 16,95	€ 16,06

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Euro Bond Fund (Fortsetzung)</b>			
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 307.434	CHF 314.038	CHF 284.928
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.243	8.797	8.442
NIW je Anteil	CHF 37,30	CHF 35,70	CHF 33,75
Investor:			
thesaurierend	€ 38.680	€ 30.988	€ 16.661
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.524	1.276	726
NIW je Anteil	€ 25,38	€ 24,29	€ 22,94
Erträge	€ 679	€ 784	€ 670
ausgegebene und umlaufende Anteile	40	48	44
NIW je Anteil	€ 16,97	€ 16,27	€ 15,42
Administrative:			
thesaurierend	€ 5.248	€ 5.004	€ 3.965
ausgegebene und umlaufende Anteile	215	213	179
NIW je Anteil	€ 24,45	€ 23,44	€ 22,17
Class E:			
thesaurierend	€ 241.554	€ 203.722	€ 69.321
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.200	8.938	3.203
NIW je Anteil	€ 23,68	€ 22,79	€ 21,64
Erträge	€ 58.802	€ 57.386	€ 29.848
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.596	4.660	2.552
NIW je Anteil	€ 12,79	€ 12,31	€ 11,70
Class T:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 1.126
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	107
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 10,49
<b>Euro Credit Fund</b>			
Nettvermögen	€ 1.150.058	€ 961.445	€ 742.058
Institutional:			
thesaurierend	€ 854.429	€ 567.529	€ 540.002
ausgegebene und umlaufende Anteile	49.448	33.565	33.984
NIW je Anteil	€ 17,28	€ 16,91	€ 15,89
ausschüttend II	€ 110.981	€ 26.476	€ 107.367
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.831	2.365	10.028
NIW je Anteil	€ 11,29	€ 11,20	€ 10,71
Class E:			
thesaurierend	€ 24.907	€ 102.646	€ 94.689
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.802	7.518	7.308
NIW je Anteil	€ 13,82	€ 13,65	€ 12,96
H Institutional:			
thesaurierend	€ 156.377	€ 182.334	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.036	17.926	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,40	€ 10,17	k. A.
ausschüttend II	€ 3.364	€ 82.460	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	331	8.183	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,16	€ 10,08	k. A.
<b>Euro Income Bond Fund</b>			
Nettvermögen	€ 3.182.867	€ 3.165.112	€ 1.487.943
Institutional:			
thesaurierend	€ 882.179	€ 767.421	€ 137.289
ausgegebene und umlaufende Anteile	55.950	49.782	9.484
NIW je Anteil	€ 15,77	€ 15,42	€ 14,48

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Euro Income Bond Fund (Fortsetzung)</b>					<b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b>		
Erträge	€ 215.485	€ 252.961	€ 136.490	Nettovermögen	€ 350.749	€ 353.235	€ 313.942
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.471	22.900	12.797	Institutional:			
NIW je Anteil	€ 11,07	€ 11,05	€ 10,67	thesaurierend	€ 259.542	€ 332.406	€ 294.611
Institutional USD (Hedged):				ausgegebene und umlaufende Anteile	22.487	29.004	25.986
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 61.102	NIW je Anteil	€ 11,54	€ 11,46	€ 11,34
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	6.029	Class E:			
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,13	thesaurierend	€ 6.217	€ 20.829	€ 19.331
Investor:				ausgegebene und umlaufende Anteile	623	2.089	1.943
thesaurierend	€ 6.268	€ 9	k. A.	NIW je Anteil	€ 9,99	€ 9,97	€ 9,95
ausgegebene und umlaufende Anteile	615	1	k. A.	H Institutional:			
NIW je Anteil	€ 10,20	€ 10,00	k. A.	thesaurierend	€ 84.990	k. A.	k. A.
Erträge	€ 19.825	€ 22.460	€ 7.453	ausgegebene und umlaufende Anteile	8.456	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.826	2.065	707	NIW je Anteil	€ 10,05	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,86	€ 10,88	€ 10,54				
Class E:				<b>Global Advantage Fund</b>			
thesaurierend	€ 1.263.972	€ 1.214.532	€ 497.356	Nettovermögen	\$ 524.284	\$ 467.498	\$ 731.946
ausgegebene und umlaufende Anteile	87.596	85.319	36.875	Institutional:			
NIW je Anteil	€ 14,43	€ 14,24	€ 13,49	thesaurierend	\$ 32.718	\$ 32.601	\$ 22.082
Erträge	€ 731.652	€ 851.868	€ 631.047	ausgegebene und umlaufende Anteile	2.070	2.260	1.655
ausgegebene und umlaufende Anteile	72.655	83.986	63.836	NIW je Anteil	\$ 15,81	\$ 14,43	\$ 13,34
NIW je Anteil	€ 10,07	€ 10,14	€ 9,89	Institutional CHF (Partially Hedged):			
Ausschüttend Q	€ 4.485	€ 10	k. A.	Erträge	CHF 136.133	CHF 132.762	CHF 94.831
ausgegebene und umlaufende Anteile	455	1	k. A.	ausgegebene und umlaufende Anteile	12.809	12.662	9.333
NIW je Anteil	€ 9,86	€ 9,98	k. A.	NIW je Anteil	CHF 10,63	CHF 10,49	CHF 10,16
Class T:				Institutional DKK (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 41.015	€ 39.540	€ 15.624	thesaurierend	k. A.	k. A.	DKK 584.772
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.663	3.565	1.481	ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	54.268
NIW je Anteil	€ 11,20	€ 11,09	€ 10,55	NIW je Anteil	k. A.	k. A.	DKK 10,78
Erträge	€ 17.986	€ 16.311	€ 9.234	Institutional EUR (Partially Hedged):			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.998	1.792	1.036	thesaurierend	€ 215.680	€ 203.177	€ 369.398
NIW je Anteil	€ 9,00	€ 9,10	€ 8,91	ausgegebene und umlaufende Anteile	15.249	14.910	29.035
				NIW je Anteil	€ 14,14	€ 13,63	€ 12,72
Nettovermögen	<b>Euro Long Average Duration Fund</b>			Institutional GBP (Partially Hedged):			
	€ 182.461	€ 162.478	€ 253.994	thesaurierend	£ 162	£ 159	£ 27.380
Institutional:				ausgegebene und umlaufende Anteile	12	12	2.299
thesaurierend	€ 182.461	€ 162.478	€ 253.994	NIW je Anteil	£ 13,45	£ 12,74	£ 11,91
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.656	5.636	10.071	Institutional NOK (Partially Hedged):			
NIW je Anteil	€ 32,26	€ 28,83	€ 25,22	thesaurierend	NOK 526.754	NOK 477.185	NOK 438.760
				ausgegebene und umlaufende Anteile	3.462	3.318	3.313
Nettovermögen	<b>Euro Short-Term Fund</b>			NIW je Anteil	NOK 152,16	NOK 143,81	NOK 132,42
	€ 807.538	€ 710.026	€ 775.039	Class E:			
Institutional:				thesaurierend	k. A.	\$ 3.009	\$ 4.179
thesaurierend	€ 789.499	€ 401.800	€ 425.920	ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	264	393
ausgegebene und umlaufende Anteile	65.792	33.324	35.354	NIW je Anteil	k. A.	\$ 11,39	\$ 10,64
NIW je Anteil	€ 12,00	€ 12,06	€ 12,05	Erträge	k. A.	k. A.	\$ 118
ausschüttend II	k. A.	k. A.	€ 100	ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	12
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	10	NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 9,86
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,73	Class E EUR (Partially Hedged):			
Class E:				thesaurierend	€ 9.744	€ 10.874	€ 10.473
thesaurierend	€ 18.039	€ 308.226	€ 349.019	ausgegebene und umlaufende Anteile	764	876	895
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.679	28.342	31.881	NIW je Anteil	€ 12,75	€ 12,41	€ 11,70
NIW je Anteil	€ 10,74	€ 10,88	€ 10,95				
				Nettovermögen	<b>Global Advantage Real Return Fund</b>		
Nettovermögen	<b>PIMCO European High Yield Bond Fund</b>				k. A.	\$ 36.235	\$ 87.854
	€ 162.061	k. A.	k. A.	Institutional:			
Institutional:				thesaurierend	k. A.	\$ 5.335	\$ 11.257
thesaurierend	€ 9.610	k. A.	k. A.	ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	538	1.237
ausgegebene und umlaufende Anteile	918	k. A.	k. A.	NIW je Anteil	k. A.	\$ 9,92	\$ 9,10
NIW je Anteil	€ 10,46	k. A.	k. A.	Institutional CHF (Partially Hedged):			
Class Z:				thesaurierend	k. A.	CHF 7.922	CHF 9.152
thesaurierend	€ 152.451	k. A.	k. A.	ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	755	932
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.501	k. A.	k. A.	NIW je Anteil	k. A.	CHF 10,50	CHF 9,82
NIW je Anteil	€ 10,51	k. A.	k. A.				

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Global Advantage Real Return Fund (Fortsetzung)</b>				<b>Global Bond Fund (Fortsetzung)</b>			
Institutional EUR (Partially Hedged):				Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 1.124	€ 22.069	thesaurierend	CHF 464.413	CHF 474.485	CHF 377.748
ausgegebene und umlaufende				ausgegebene und umlaufende			
Anteile	k. A.	96	2.062	Anteile	13.054	14.098	11.768
NIW je Anteil	k. A.	€ 11,67	€ 10,71	NIW je Anteil	CHF 35,58	CHF 33,66	CHF 32,10
Erträge	k. A.	€ 203	€ 8.477	Erträge	CHF 213.078	CHF 208.245	CHF 162.310
ausgegebene und umlaufende				ausgegebene und umlaufende			
Anteile	k. A.	24	1.054	Anteile	9.953	10.113	7.589
NIW je Anteil	k. A.	€ 8,57	€ 8,05	NIW je Anteil	CHF 21,41	CHF 20,59	CHF 20,07
Institutional GBP (Partially Hedged):				Institutional EUR (Currency Exposure):			
Erträge	k. A.	£ 4.276	£ 4.509	thesaurierend	€ 163.042	€ 157.567	€ 84.430
ausgegebene und umlaufende				ausgegebene und umlaufende			
Anteile	k. A.	444	490	Anteile	11.624	11.466	6.700
NIW je Anteil	k. A.	£ 9,64	£ 9,20	NIW je Anteil	€ 14,03	€ 13,74	€ 12,60
Class E:				Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	\$ 2.145	\$ 2.520	thesaurierend	€ 2.491.097	€ 2.747.931	€ 1.907.996
ausgegebene und umlaufende				ausgegebene und umlaufende			
Anteile	k. A.	245	311	Anteile	83.802	97.996	71.668
NIW je Anteil	k. A.	\$ 8,75	\$ 8,10	NIW je Anteil	€ 29,73	€ 28,04	€ 26,62
Class E EUR (Partially Hedged):				Erträge	€ 766.678	€ 678.567	€ 403.248
thesaurierend	k. A.	€ 11.895	€ 11.357	ausgegebene und umlaufende			
ausgegebene und umlaufende				Anteile	39.612	36.554	22.384
Anteile	k. A.	1.222	1.260	NIW je Anteil	€ 19,35	€ 18,56	€ 18,01
NIW je Anteil	k. A.	€ 9,73	€ 9,02	ausschüttend II	k. A.	€ 466	€ 2.057
G Institutional EUR (Partially Hedged):				ausgegebene und umlaufende			
Erträge	k. A.	€ 52	€ 95	Anteile	k. A.	48	215
ausgegebene und umlaufende				NIW je Anteil	k. A.	€ 9,80	€ 9,56
Anteile	k. A.	5	10	Institutional GBP (Currency Exposure):			
NIW je Anteil	k. A.	€ 9,66	€ 9,07	thesaurierend	£ 4.429	£ 4.807	£ 5.726
Class Z:				ausgegebene und umlaufende			
Erträge	k. A.	\$ 10	\$ 11.041	Anteile	377	441	541
ausgegebene und umlaufende				NIW je Anteil	£ 11,75	£ 10,90	£ 10,59
Anteile	k. A.	1	1.491	Institutional GBP (Hedged):			
NIW je Anteil	k. A.	\$ 7,90	\$ 7,40	thesaurierend	£ 160.075	£ 163.030	£ 109.958
Nettvermögen				ausgegebene und umlaufende			
				Anteile	6.703	7.285	5.240
				NIW je Anteil	£ 23,88	£ 22,38	£ 20,98
				Erträge	£ 254.507	£ 517.631	£ 432.593
				ausgegebene und umlaufende			
				Anteile	17.444	37.228	32.466
				NIW je Anteil	£ 14,59	£ 13,90	£ 13,32
				Institutional ILS (Hedged):			
				thesaurierend	ILS 331	ILS 474	ILS 1.076
				ausgegebene und umlaufende			
				Anteile	19	30	71
				NIW je Anteil	ILS 17,09	ILS 15,99	ILS 15,07
				Institutional NOK (Hedged):			
				thesaurierend	NOK 3.542.383	NOK 4.375.870	NOK 3.950.254
				ausgegebene und umlaufende			
				Anteile	14.946	19.729	19.094
				NIW je Anteil	NOK 237,01	NOK 221,80	NOK 206,87
				Institutional NZD (Hedged):			
				Erträge	NZD 250.817	NZD 220.766	NZD 117.083
				ausgegebene und umlaufende			
				Anteile	5.230	4.853	2.710
				NIW je Anteil	NZD 47,96	NZD 45,49	NZD 43,20
				Institutional SEK (Hedged):			
				thesaurierend	SEK 1.176.107	SEK 1.604.480	SEK 966.811
				ausgegebene und umlaufende			
				Anteile	5.129	7.441	4.735
				NIW je Anteil	SEK 229,29	SEK 215,61	SEK 204,16

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum		
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2018
	Global Bond Fund (Fortsetzung)		
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend	SGD 176.007	SGD 98.535	SGD 73.983
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.960	5.382	4.357
NIW je Anteil	SGD 19,64	SGD 18,31	SGD 16,98
Investor: thesaurierend	\$ 195.058	\$ 181.048	\$ 383.013
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.801	5.776	13.208
NIW je Anteil	\$ 33,62	\$ 31,34	\$ 29,00
Erträge	\$ 9.885	\$ 17.154	\$ 17.335
ausgegebene und umlaufende Anteile	570	1.046	1.122
NIW je Anteil	\$ 17,35	\$ 16,39	\$ 15,45
Investor (Currency Exposure): thesaurierend	\$ 5.415	\$ 6.008	\$ 6.159
ausgegebene und umlaufende Anteile	158	194	212
NIW je Anteil	\$ 34,32	\$ 30,96	\$ 29,01
Investor CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 283.165	CHF 295.384	CHF 291.127
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.545	22.576	23.247
NIW je Anteil	CHF 13,78	CHF 13,08	CHF 12,52
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 83.112	€ 51.144	€ 40.383
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.958	1.923	1.594
NIW je Anteil	€ 28,10	€ 26,60	€ 25,34
Investor GBP (Hedged): thesaurierend	£ 6.089	£ 4.964	£ 5.305
ausgegebene und umlaufende Anteile	269	233	265
NIW je Anteil	£ 22,62	£ 21,27	£ 20,02
Investor NOK (Hedged): thesaurierend	NOK 32.011	NOK 47.640	NOK 49.198
ausgegebene und umlaufende Anteile	142	225	249
NIW je Anteil	NOK 225,22	NOK 211,51	NOK 197,96
Administrative: thesaurierend	\$ 23.302	\$ 10.597	\$ 14.587
ausgegebene und umlaufende Anteile	710	346	514
NIW je Anteil	\$ 32,80	\$ 30,62	\$ 28,37
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend	k. A. €	93 €	99
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	9	10
NIW je Anteil	k. A. €	10,57 €	10,08
Administrative GBP (Hedged): Erträge	k. A.	k. A. £	243
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	16
NIW je Anteil	k. A.	k. A. £	14,85
Class E: thesaurierend	\$ 550.753	\$ 456.775	\$ 260.347
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.372	15.371	9.417
NIW je Anteil	\$ 31,70	\$ 29,72	\$ 27,65
Erträge	\$ 201.589	\$ 226.763	\$ 373.228
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.511	16.087	28.096
NIW je Anteil	\$ 14,92	\$ 14,10	\$ 13,28
Class E (Currency Exposure): thesaurierend	\$ 84.089	\$ 63.626	\$ 22.488
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.699	4.754	1.783
NIW je Anteil	\$ 14,76	\$ 13,38	\$ 12,61
Erträge	\$ 19.720	\$ 13.687	\$ 9.476
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.545	1.173	851
NIW je Anteil	\$ 12,76	\$ 11,67	\$ 11,13
Class E CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 2.635	CHF 1.695	CHF 260
ausgegebene und umlaufende Anteile	244	165	26
NIW je Anteil	CHF 10,78	CHF 10,29	CHF 9,90

	Zum		
	31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2018
	Global Bond Fund (Fortsetzung)		
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 1.168.524	€ 988.122	€ 653.622
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.954	39.935	27.574
NIW je Anteil	€ 25,99	€ 24,74	€ 23,70
Erträge	€ 61.268	€ 46.925	€ 24.105
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.769	4.606	2.439
NIW je Anteil	€ 10,62	€ 10,19	€ 9,88
Class E GBP (Hedged): Erträge	k. A. £	2.435 £	2.353
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	173	174
NIW je Anteil	k. A. £	14,08 £	13,49
G Retail EUR (Hedged): Erträge	€ 140.905	€ 145.941	€ 169.990
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.167	14.226	17.073
NIW je Anteil	€ 10,70	€ 10,26	€ 9,96
H Institutional: thesaurierend	\$ 954.525	\$ 970.919	\$ 257.460
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.130	29.656	8.514
NIW je Anteil	\$ 35,18	\$ 32,74	\$ 30,24
Erträge	k. A.	k. A. \$	11
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A. \$	10,48
Erträge	\$ 3.905	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	375	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,42	k. A.	k. A.
M Retail: ausschüttend II	\$ 2.809	\$ 12.445	\$ 1.668
ausgegebene und umlaufende Anteile	260	1.203	169
NIW je Anteil	\$ 10,80	\$ 10,35	\$ 9,88
M Retail HKD (Unhedged): ausschüttend II	HKD 11.626	HKD 25.429	HKD 16.480
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.081	2.456	1.658
NIW je Anteil	HKD 10,76	HKD 10,36	HKD 9,94
Class R: thesaurierend	k. A. \$	1.257 \$	1.111
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	96	92
NIW je Anteil	k. A. \$	13,05 \$	12,06
Class R (Currency Exposure): thesaurierend	k. A.	k. A. \$	222
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	21
NIW je Anteil	k. A.	k. A. \$	10,43
Class R EUR (Hedged): thesaurierend	€ 5.196	€ 9.532	€ 6.712
ausgegebene und umlaufende Anteile	415	806	596
NIW je Anteil	€ 12,51	€ 11,83	€ 11,26
Class R GBP (Hedged): Erträge	k. A. £	4.654 £	1.669
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	426	159
NIW je Anteil	k. A. £	10,93 £	10,48
Class R SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 100	SEK 94	SEK 90
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	SEK 111,31	SEK 104,96	SEK 99,65
Class T: thesaurierend	\$ 42.315	\$ 33.211	\$ 11.305
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.396	2.835	1.034
NIW je Anteil	\$ 12,46	\$ 11,72	\$ 10,93
Erträge	\$ 5.274	\$ 5.202	\$ 2.876
ausgegebene und umlaufende Anteile	443	463	272
NIW je Anteil	\$ 11,89	\$ 11,23	\$ 10,59

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Global Bond Fund (Fortsetzung)</b>			
<b>Class T EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 25.635	€ 15.650	€ 12.296
ausgegeben und umlaufende Anteile	2.285	1.461	1.195
<b>NIW je Anteil</b>	€ 11,22	€ 10,71	€ 10,29
<b>W Class:</b>			
thesaurierend	\$ 21.207	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	2.070	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	\$ 10,25	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 13.683	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.345	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	\$ 10,17	k. A.	k. A.
<b>Class W (Currency Exposure):</b>			
thesaurierend	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	\$ 10,48	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	\$ 10,41	k. A.	k. A.
<b>W Class CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 35.760	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	3.508	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	CHF 10,20	k. A.	k. A.
Erträge	CHF 9	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	CHF 10,12	k. A.	k. A.
<b>W Class EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 14.731	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.444	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	€ 10,20	k. A.	k. A.
Erträge	€ 1.740	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	172	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	€ 10,14	k. A.	k. A.
<b>W Class GBP (Hedged):</b>			
thesaurierend	£ 139	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	14	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	£ 10,23	k. A.	k. A.
Erträge	£ 8.773	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	863	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	£ 10,16	k. A.	k. A.
<b>W Class SEK (Hedged):</b>			
thesaurierend	SEK 91	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	SEK 102,20	k. A.	k. A.
<b>Global Bond ESG Fund</b>			
<b>Nettövermögen</b>	\$ 1.509.594	\$ 762.434	\$ 506.382
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 153.820	\$ 63.955	\$ 13.011
ausgegeben und umlaufende Anteile	12.640	5.649	1.249
<b>NIW je Anteil</b>	\$ 12,17	\$ 11,32	\$ 10,42
Erträge	\$ 19.510	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.826	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	\$ 10,68	k. A.	k. A.
<b>Institutional CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 16.793	CHF 4.460	CHF 2.202
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.534	430	223
<b>NIW je Anteil</b>	CHF 10,94	CHF 10,37	CHF 9,87
<b>Institutional EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 276.328	€ 144.191	€ 113.672
ausgegeben und umlaufende Anteile	24.851	13.727	11.425
<b>NIW je Anteil</b>	€ 11,12	€ 10,50	€ 9,95
Erträge	€ 165.370	€ 147.875	€ 67.993
ausgegeben und umlaufende Anteile	15.815	14.759	7.020
<b>NIW je Anteil</b>	€ 10,46	€ 10,02	€ 9,69

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Global Bond ESG Fund (Fortsetzung)</b>			
<b>Institutional GBP (Hedged):</b>			
thesaurierend	£ 13.241	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.264	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	£ 10,48	k. A.	k. A.
Erträge	£ 43.778	£ 26.518	£ 2.413
ausgegeben und umlaufende Anteile	4.037	2.564	244
<b>NIW je Anteil</b>	£ 10,84	£ 10,34	£ 9,88
<b>Institutional GBP (Unhedged):</b>			
Erträge	£ 7	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	£ 9,70	k. A.	k. A.
<b>Institutional NOK (Hedged):</b>			
thesaurierend	NOK 4.228.645	NOK 2.170.649	NOK 1.929.247
ausgegeben und umlaufende Anteile	360.891	197.730	188.867
<b>NIW je Anteil</b>	NOK 11,72	NOK 10,98	NOK 10,21
<b>Institutional NZD (Hedged):</b>			
Erträge	NZD 68.677	NZD 50.068	NZD 46.409
ausgegeben und umlaufende Anteile	6.078	4.676	4.582
<b>NIW je Anteil</b>	NZD 11,30	NZD 10,71	NZD 10,13
<b>Investor:</b>			
thesaurierend	\$ 18.700	\$ 859	\$ 10
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.600	79	1
<b>NIW je Anteil</b>	\$ 11,69	\$ 10,91	\$ 10,07
<b>Administrative:</b>			
thesaurierend	\$ 11	\$ 11	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	\$ 11,34	\$ 10,60	k. A.
Erträge	\$ 11	\$ 11	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
<b>NIW je Anteil</b>	\$ 11,09	\$ 10,46	k. A.
<b>Class E:</b>			
Erträge	\$ 6.261	\$ 405	\$ 115
ausgegeben und umlaufende Anteile	565	39	11
<b>NIW je Anteil</b>	\$ 11,08	\$ 10,46	\$ 10,15
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 44.524	€ 18.930	€ 15.004
ausgegeben und umlaufende Anteile	4.140	1.846	1.531
<b>NIW je Anteil</b>	€ 10,76	€ 10,25	€ 9,80
<b>Class Z AUD (Hedged):</b>			
Erträge	AUD 98.588	AUD 39.214	AUD 13.067
ausgegeben und umlaufende Anteile	8.716	3.651	1.283
<b>NIW je Anteil</b>	AUD 11,31	AUD 10,74	AUD 10,19

	<b>Global Bond Ex-US Fund</b>		
	\$	\$	\$
<b>Nettövermögen</b>	929.980	1.092.298	963.225
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 493.644	\$ 509.983	\$ 606.020
ausgegeben und umlaufende Anteile	19.620	21.424	27.372
<b>NIW je Anteil</b>	\$ 25,16	\$ 23,80	\$ 22,14
Erträge	\$ 46.004	\$ 47.694	\$ 46.002
ausgegeben und umlaufende Anteile	2.652	2.856	2.901
<b>NIW je Anteil</b>	\$ 17,35	\$ 16,70	\$ 15,86

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
	<b>Global Bond Ex-US Fund (Fortsetzung)</b>		
Institutional EUR (Hedged):	€	€	€
thesaurierend	35.120	119.058	42.179
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.898	6.706	2.481
NIW je Anteil	€ 18,50	€ 17,76	€ 17,00
Institutional GBP (Hedged):	£	£	k. A.
Erträge	210	200	
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	20	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,54	£ 10,23	k. A.
Investor:	\$	\$	\$
thesaurierend	21.037	16.917	10.009
ausgegebene und umlaufende Anteile	881	746	473
NIW je Anteil	\$ 23,88	\$ 22,67	\$ 21,16
Administrative:	\$	\$	\$
thesaurierend	10.624	10.066	9.153
ausgegebene und umlaufende Anteile	458	456	444
NIW je Anteil	\$ 23,19	\$ 22,05	\$ 20,61
Class E:	\$	\$	\$
Erträge	46.592	149.150	177.505
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.766	9.199	11.525
NIW je Anteil	\$ 16,84	\$ 16,21	\$ 15,40
Class E (Currency Exposure):	\$	\$	\$
Erträge	56.847	57.203	66.309
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.213	5.768	6.879
NIW je Anteil	\$ 10,91	\$ 9,92	\$ 9,64
H Institutional:	\$	\$	\$
thesaurierend	73.013	16.973	10
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.428	1.577	1
NIW je Anteil	\$ 11,36	\$ 10,76	\$ 10,03
Class Z:	\$	\$	k. A.
thesaurierend	138.962	150.405	
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.049	15.001	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,65	\$ 10,03	k. A.
	<b>PIMCO Global Core Asset Allocation Fund</b>		
Nettovermögen	\$ 702.430	\$ 814.354	\$ 850.423
Institutional:	\$	\$	\$
thesaurierend	45.298	223.748	269.419
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.116	11.959	16.640
NIW je Anteil	\$ 21,41	\$ 18,71	\$ 16,19
Institutional EUR (Hedged):	€	€	€
thesaurierend	123.732	88.022	134.103
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.469	5.109	8.745
NIW je Anteil	€ 19,13	€ 17,23	€ 15,33
Erträge	k. A.	€ 941	€ 787
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	92	83
NIW je Anteil	k. A.	€ 10,20	€ 9,45
Institutional GBP (Hedged):	£	£	£
thesaurierend	k. A.	k. A.	870
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	77
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 11,28
Erträge	£ 4.026	£ 3.936	£ 4.902
ausgegebene und umlaufende Anteile	349	363	493
NIW je Anteil	£ 11,55	£ 10,84	£ 9,94
Investor:	\$	\$	\$
thesaurierend	9.158	8.276	8.927
ausgegebene und umlaufende Anteile	573	591	734
NIW je Anteil	\$ 15,98	\$ 14,01	\$ 12,17
Class E:	\$	\$	\$
thesaurierend	33.696	36.200	35.311
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.806	2.193	2.442
NIW je Anteil	\$ 18,66	\$ 16,50	\$ 14,46
Erträge	\$ 8.100	\$ 7.630	\$ 6.336
ausgegebene und umlaufende Anteile	749	767	698
NIW je Anteil	\$ 10,81	\$ 9,95	\$ 9,07
	<b>PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Fortsetzung)</b>		
Class E EUR (Hedged):	€	€	€
thesaurierend	205.357	210.021	180.748
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.325	13.825	13.209
NIW je Anteil	€ 16,66	€ 15,19	€ 13,68
Erträge	€ 42.548	€ 44.096	€ 30.794
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.342	4.744	3.531
NIW je Anteil	€ 9,80	€ 9,30	€ 8,72
Class Z:	\$	\$	\$
thesaurierend	145.959	148.177	127.050
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.320	10.928	10.928
NIW je Anteil	\$ 15,66	\$ 13,56	\$ 11,62
	<b>Global High Yield Bond Fund</b>		
Nettovermögen	\$ 5.403.543	\$ 4.341.308	\$ 3.153.872
Institutional:	\$	\$	\$
thesaurierend	1.065.384	785.615	580.306
ausgegebene und umlaufende Anteile	38.174	29.474	25.089
NIW je Anteil	\$ 27,91	\$ 26,66	\$ 23,13
Erträge	\$ 349.849	\$ 305.771	\$ 131.874
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.507	26.737	12.675
NIW je Anteil	\$ 11,47	\$ 11,44	\$ 10,40
Institutional CHF (Hedged):	CHF	CHF	CHF
thesaurierend	40.299	39.337	27.363
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.265	2.263	1.755
NIW je Anteil	CHF 17,79	CHF 17,38	CHF 15,59
Erträge	CHF 18.324	CHF 18.347	CHF 15.902
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.019	1.982	1.828
NIW je Anteil	CHF 9,08	CHF 9,26	CHF 8,70
Institutional EUR (Hedged):	€	€	€
thesaurierend	1.149.182	815.073	587.517
ausgegebene und umlaufende Anteile	46.572	33.883	27.328
NIW je Anteil	€ 24,68	€ 24,06	€ 21,50
Erträge	€ 109.781	€ 206.563	€ 196.406
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.253	17.111	17.360
NIW je Anteil	€ 11,86	€ 12,07	€ 11,31
Institutional GBP (Hedged):	£	£	£
thesaurierend	96.397	11.655	11.240
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.007	746	814
NIW je Anteil	£ 16,05	£ 15,63	£ 13,81
Erträge	£ 642.574	£ 562.546	£ 458.504
ausgegebene und umlaufende Anteile	109.465	94.145	82.796
NIW je Anteil	£ 5,87	£ 5,98	£ 5,54
Investor:	\$	\$	\$
thesaurierend	12.417	13.535	14.632
ausgegebene und umlaufende Anteile	940	1.069	1.327
NIW je Anteil	\$ 13,21	\$ 12,66	\$ 11,03
Investor EUR (Hedged):	€	€	€
thesaurierend	3.311	1.899	1.943
ausgegebene und umlaufende Anteile	139	81	93
NIW je Anteil	€ 23,83	€ 23,31	€ 20,91
Administrative:	\$	\$	\$
thesaurierend	47.282	56.290	51.492
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.802	2.234	2.344
NIW je Anteil	\$ 26,24	\$ 25,19	\$ 21,97
Erträge	\$ 29.675	\$ 18.547	\$ 16.519
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.644	1.658	1.623
NIW je Anteil	\$ 11,22	\$ 11,19	\$ 10,18
Administrative EUR (Hedged):	€	€	€
Erträge	2.201	2.110	1.619
ausgegebene und umlaufende Anteile	223	210	172
NIW je Anteil	€ 9,85	€ 10,03	€ 9,40

	Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
Administrative GBP (Hedged):			
Erträge	£ 1.475	£ 1.582	£ 1.625
ausgegeben und umlaufende Anteile	140	148	163
NIW je Anteil	£ 10,53	£ 10,72	£ 9,93
Class E:			
thesaurierend	\$ 210.078	\$ 207.395	\$ 170.496
ausgegeben und umlaufende Anteile	8.558	8.767	8.232
NIW je Anteil	\$ 24,55	\$ 23,66	\$ 20,71
Erträge	\$ 224.794	\$ 213.262	\$ 207.640
ausgegeben und umlaufende Anteile	19.913	18.948	20.284
NIW je Anteil	\$ 11,29	\$ 11,26	\$ 10,24
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 288.006	€ 285.099	€ 220.315
ausgegeben und umlaufende Anteile	11.814	11.888	10.187
NIW je Anteil	€ 24,38	€ 23,98	€ 21,63
Erträge	€ 43.265	€ 53.008	€ 42.446
ausgegeben und umlaufende Anteile	4.460	5.371	4.589
NIW je Anteil	€ 9,70	€ 9,87	€ 9,25
Class E GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 7.198	£ 10.588	£ 10.150
ausgegeben und umlaufende Anteile	583	842	871
NIW je Anteil	£ 12,36	£ 12,57	£ 11,65
Class E SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 9.093	SGD 6.227	SGD 2.520
ausgegeben und umlaufende Anteile	860	586	259
NIW je Anteil	SGD 10,57	SGD 10,62	SGD 9,72
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 240.370	\$ 223.606	\$ 16.371
ausgegeben und umlaufende Anteile	8.934	8.686	732
NIW je Anteil	\$ 26,91	\$ 25,74	\$ 22,37
Erträge	\$ 9.847	\$ 24.582	\$ 10.308
ausgegeben und umlaufende Anteile	968	2.423	1.117
NIW je Anteil	\$ 10,17	\$ 10,14	\$ 9,23
M Retail:			
thesaurierend	\$ 30.491	\$ 35.412	\$ 33.718
ausgegeben und umlaufende Anteile	2.736	3.190	3.338
NIW je Anteil	\$ 11,14	\$ 11,10	\$ 10,10
ausschüttend II	\$ 49.638	\$ 60.748	\$ 37.741
ausgegeben und umlaufende Anteile	5.358	6.487	4.363
NIW je Anteil	\$ 9,26	\$ 9,36	\$ 8,65
Class R:			
thesaurierend	\$ 73.682	\$ 10.517	\$ 8.367
ausgegeben und umlaufende Anteile	4.779	713	652
NIW je Anteil	\$ 15,42	\$ 14,76	\$ 12,84
Class R GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ k. A.	£ 1.335	£ 2.816
ausgegeben und umlaufende Anteile	£ k. A.	£ 135	£ 308
NIW je Anteil	£ k. A.	£ 9,87	£ 9,15
Class T:			
thesaurierend	\$ 7.892	\$ 8.392	\$ 6.304
ausgegeben und umlaufende Anteile	599	658	563
NIW je Anteil	\$ 13,18	\$ 12,75	\$ 11,21
Erträge	\$ 2.703	\$ 3.277	\$ 3.081
ausgegeben und umlaufende Anteile	257	312	323
NIW je Anteil	\$ 10,52	\$ 10,49	\$ 9,54
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.448	€ 698	€ 1.617
ausgegeben und umlaufende Anteile	132	64	164
NIW je Anteil	€ 11,00	€ 10,86	€ 9,83

  

	Global Investment Grade Credit Fund		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
Nettövermögen	\$ 28.178.170	\$ 21.938.396	\$ 17.244.136
Institutional:			
thesaurierend	\$ 5.463.978	\$ 5.013.005	\$ 3.498.624
ausgegeben und umlaufende Anteile	244.589	237.707	186.697
NIW je Anteil	\$ 22,34	\$ 21,09	\$ 18,74
Erträge	\$ 1.176.158	\$ 805.411	\$ 627.610
ausgegeben und umlaufende Anteile	86.159	60.729	51.481
NIW je Anteil	\$ 13,65	\$ 13,26	\$ 12,19
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 135.818	\$ 110.232	\$ 92.224
ausgegeben und umlaufende Anteile	7.905	6.934	6.472
NIW je Anteil	\$ 17,18	\$ 15,90	\$ 14,25
Erträge	\$ 46.397	\$ 21.223	\$ 26.401
ausgegeben und umlaufende Anteile	4.359	2.094	2.809
NIW je Anteil	\$ 10,64	\$ 10,13	\$ 9,40
Institutional AUD (Hedged):			
thesaurierend	AUD 193.406	k. A.	k. A.
ausgegeben und umlaufende Anteile	17.513	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD 11,04	k. A.	k. A.
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 1.033.114	CHF 928.941	CHF 887.827
ausgegeben und umlaufende Anteile	56.019	52.257	54.331
NIW je Anteil	CHF 18,44	CHF 17,78	CHF 16,34
Erträge	CHF 64.939	CHF 54.079	CHF 41.489
ausgegeben und umlaufende Anteile	6.862	5.763	4.650
NIW je Anteil	CHF 9,46	CHF 9,38	CHF 8,92
Institutional CZK (Hedged):			
thesaurierend	CZK 2.321.368	CZK 2.153.609	CZK 1.898.569
ausgegeben und umlaufende Anteile	232.003	218.737	207.933
NIW je Anteil	CZK 10,01	CZK 9,85	CZK 9,13
Institutional EUR (Currency Exposure):			
thesaurierend	€ 19.426	€ 16.347	€ 5.360
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.383	1.155	430
NIW je Anteil	€ 14,04	€ 14,16	€ 12,46
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 3.901.877	€ 2.881.106	€ 2.477.747
ausgegeben und umlaufende Anteile	187.485	144.023	135.361
NIW je Anteil	€ 20,81	€ 20,00	€ 18,30
Erträge	€ 740.139	€ 797.263	€ 730.673
ausgegeben und umlaufende Anteile	59.770	65.110	63.025
NIW je Anteil	€ 12,38	€ 12,24	€ 11,59
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 443.999	£ 592.954	£ 747.232
ausgegeben und umlaufende Anteile	19.545	27.284	38.040
NIW je Anteil	£ 22,72	£ 21,73	£ 19,64
Erträge	£ 3.908.795	£ 2.759.051	£ 2.298.995
ausgegeben und umlaufende Anteile	274.389	196.632	175.211
NIW je Anteil	£ 14,25	£ 14,03	£ 13,12

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
Institutional HUF (Hedged):			
Erträge	HUF 9.940.031	HUF 9.489.650	HUF 8.618.175
ausgegebene und umlaufende Anteile	995.298	964.706	930.585
NIW je Anteil	HUF 9,99	HUF 9,84	HUF 9,26
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	ILS 231.711	ILS 256.506	ILS 240.122
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.394	15.563	16.034
NIW je Anteil	ILS 17,30	ILS 16,48	ILS 14,97
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 452.970	NOK 404.151	NOK 808.899
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.793	2.602	5.795
NIW je Anteil	NOK 162,17	NOK 155,30	NOK 139,58
Institutional PLN (Hedged):			
Erträge	PLN 24.867	PLN 30.068	PLN 9.489
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.257	2.779	946
NIW je Anteil	PLN 11,02	PLN 10,82	PLN 10,03
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 4.033.636	SEK 3.319.651	SEK 3.011.711
ausgegebene und umlaufende Anteile	228.950	196.270	195.169
NIW je Anteil	SEK 17,62	SEK 16,91	SEK 15,43
Institutional SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 53.885	SGD 28.812	SGD 1.196
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.827	2.642	119
NIW je Anteil	SGD 11,16	SGD 10,91	SGD 10,08
Investor:			
thesaurierend	\$ 1.715.463	\$ 1.568.296	\$ 1.019.291
ausgegebene und umlaufende Anteile	69.981	67.538	49.228
NIW je Anteil	\$ 24,51	\$ 23,22	\$ 20,70
Erträge	\$ 272.490	\$ 164.568	\$ 80.242
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.766	11.666	6.188
NIW je Anteil	\$ 14,52	\$ 14,11	\$ 12,97
Investor AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 8.681	AUD 6.026	AUD 332
ausgegebene und umlaufende Anteile	802	566	34
NIW je Anteil	AUD 10,83	AUD 10,64	AUD 9,89
Investor CAD (Hedged):			
Erträge	CAD 3.272	CAD 760	CAD 331
ausgegebene und umlaufende Anteile	300	71	34
NIW je Anteil	CAD 10,89	CAD 10,64	CAD 9,86
Investor CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 8.313	CHF 31.452	CHF 15.948
ausgegebene und umlaufende Anteile	611	2.390	1.314
NIW je Anteil	CHF 13,60	CHF 13,16	CHF 12,14
Erträge	CHF 10.171	CHF 15.578	CHF 12.971
ausgegebene und umlaufende Anteile	834	1.289	1.129
NIW je Anteil	CHF 12,19	CHF 12,09	CHF 11,49
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 71.993	€ 62.076	€ 24.596
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.643	3.256	1.405
NIW je Anteil	€ 19,76	€ 19,06	€ 17,51

  

	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
Erträge	€ 16.947	€ 22.383	€ 15.012
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.306	1.743	1.235
NIW je Anteil	€ 12,98	€ 12,84	€ 12,15
Investor GBP (Hedged):			
Erträge	£ 8.458	£ 5.761	£ 6.572
ausgegebene und umlaufende Anteile	612	423	516
NIW je Anteil	£ 13,82	£ 13,61	£ 12,73
Investor RMB (Hedged):			
Erträge	CNH 7.674	CNH 2.832	CNH 1.623
ausgegebene und umlaufende Anteile	67	26	16
NIW je Anteil	CNH 113,76	CNH 108,96	CNH 99,76
Investor SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 20.558	SGD 12.164	SGD 14
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.889	1.144	1
NIW je Anteil	SGD 10,89	SGD 10,63	SGD 9,84
Administrative:			
thesaurierend	\$ 241.443	\$ 115.951	\$ 100.378
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.468	5.805	5.627
NIW je Anteil	\$ 21,05	\$ 19,98	\$ 17,84
Erträge	\$ 290.320	\$ 174.183	\$ 58.722
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.679	12.771	4.684
NIW je Anteil	\$ 14,04	\$ 13,64	\$ 12,54
Administrative CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 1.583	CHF 1.406	CHF 1.501
ausgegebene und umlaufende Anteile	132	121	140
NIW je Anteil	CHF 12,01	CHF 11,63	CHF 10,74
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 21.800	€ 18.194	€ 12.598
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.165	1.006	758
NIW je Anteil	€ 18,72	€ 18,08	€ 16,63
Erträge	€ 13.726	€ 20.359	€ 8.422
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.095	1.643	718
NIW je Anteil	€ 12,53	€ 12,39	€ 11,73
Administrative GBP (Hedged):			
Erträge	£ 9.572	£ 14.539	£ 16.099
ausgegebene und umlaufende Anteile	696	1.073	1.271
NIW je Anteil	£ 13,75	£ 13,54	£ 12,66
Administrative HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 40.974	HKD 55.036	HKD 9.459
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.837	5.278	982
NIW je Anteil	HKD 10,68	HKD 10,43	HKD 9,63
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 1.214.895	SEK 811.148	SEK 542.860
ausgegebene und umlaufende Anteile	96.543	66.805	48.765
NIW je Anteil	SEK 12,58	SEK 12,14	SEK 11,13
Administrative SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 48.256	SGD 26.014	SGD 13.220
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.597	2.537	1.394
NIW je Anteil	SGD 10,50	SGD 10,25	SGD 9,48

	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Class E:</b>			
thesaurierend	\$ 1.314.292	\$ 941.578	\$ 552.948
ausgegebene und umlaufende Anteile	65.526	49.282	32.278
NIW je Anteil	\$ 20,06	\$ 19,11	\$ 17,13
Erträge	\$ 615.957	\$ 637.033	\$ 491.748
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.586	44.274	37.174
NIW je Anteil	\$ 14,81	\$ 14,39	\$ 13,23
<b>Class E CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 87.585	CHF 80.411	CHF 147.861
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.007	6.614	13.114
NIW je Anteil	CHF 12,50	CHF 12,16	CHF 11,27
<b>Class E EUR (Currency Exposure)</b>			
Erträge	€ 4.671	€ 3.274	€ 2.985
ausgegebene und umlaufende Anteile	441	298	298
NIW je Anteil	€ 10,58	€ 10,98	€ 10,01
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 767.585	€ 557.675	€ 450.702
ausgegebene und umlaufende Anteile	42.129	31.558	27.623
NIW je Anteil	€ 18,22	€ 17,67	€ 16,31
Erträge	€ 354.267	€ 338.331	€ 284.893
ausgegebene und umlaufende Anteile	33.181	32.043	28.497
NIW je Anteil	€ 10,68	€ 10,56	€ 10,00
<b>Class E GBP (Hedged):</b>			
Erträge	£ 44.366	£ 35.812	£ 32.762
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.090	2.533	2.478
NIW je Anteil	£ 14,36	£ 14,14	£ 13,22
<b>Class E SGD (Hedged):</b>			
Erträge	SGD 84.734	SGD 60.535	SGD 34.380
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.583	5.546	3.406
NIW je Anteil	SGD 11,17	SGD 10,91	SGD 10,09
<b>H Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 358.146	\$ 250.517	\$ 113.366
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.358	11.360	5.775
NIW je Anteil	\$ 23,32	\$ 22,05	\$ 19,63
Erträge	\$ 12.263	\$ 13.253	\$ 74
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.113	1.237	7
NIW je Anteil	\$ 11,02	\$ 10,72	\$ 9,85
<b>M Retail:</b>			
Erträge	\$ 120.020	\$ 47.465	\$ 27.931
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.705	4.359	2.789
NIW je Anteil	\$ 11,21	\$ 10,89	\$ 10,01
ausschüttend II	\$ 189.177	\$ 179.652	\$ 86.386
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.129	17.488	9.019
NIW je Anteil	\$ 10,43	\$ 10,27	\$ 9,58
<b>M Retail HKD (Unhedged):</b>			
Erträge	HKD 56.230	HKD 39.119	HKD 22.513
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.264	3.752	2.337
NIW je Anteil	HKD 10,68	HKD 10,43	HKD 9,63
<b>Class R:</b>			
thesaurierend	\$ 38.196	\$ 21.767	\$ 15.564
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.679	1.613	1.294
NIW je Anteil	\$ 14,26	\$ 13,49	\$ 12,02
Erträge	\$ 8.289	\$ 6.147	\$ 4.375
ausgegebene und umlaufende Anteile	746	569	441
NIW je Anteil	\$ 11,11	\$ 10,80	\$ 9,92
<b>Class R EUR (Hedged):</b>			
Erträge	€ 9.645	€ 14.283	€ 20.288
ausgegebene und umlaufende Anteile	968	1.449	2.174
NIW je Anteil	€ 9,97	€ 9,86	€ 9,33
<b>Class R GBP (Hedged):</b>			
Erträge	£ 26.041	£ 26.341	£ 16.553
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.485	2.552	1.715
NIW je Anteil	£ 10,48	£ 10,32	£ 9,65

	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Class T:</b>			
thesaurierend	\$ 61.567	\$ 42.758	\$ 18.571
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.870	3.536	1.706
NIW je Anteil	\$ 12,64	\$ 12,09	\$ 10,88
<b>Class T EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 7.585	€ 6.704	€ 6.440
ausgegebene und umlaufende Anteile	669	607	629
NIW je Anteil	€ 11,34	€ 11,04	€ 10,23
<b>W Class:</b>			
thesaurierend	\$ 70.586	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.843	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,32	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 30.591	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.996	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,21	k. A.	k. A.
<b>W Class CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 36.879	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.592	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,27	k. A.	k. A.
<b>W Class EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 14.050	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.367	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,28	k. A.	k. A.
Erträge	€ 4.089	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	402	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,17	k. A.	k. A.
<b>W Class GBP (Hedged):</b>			
thesaurierend	£ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,30	k. A.	k. A.
Erträge	£ 15.521	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.521	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,20	k. A.	k. A.
<b>W Class SGD (Hedged):</b>			
Erträge	SGD 14	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,20	k. A.	k. A.

	Global Investment Grade Credit ESG Fund		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Nettovermögen</b>	\$ 332.010	\$ 83.800	\$ 42.731
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 42.254	\$ 13.910	\$ 11.151
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.426	1.229	1.113
NIW je Anteil	\$ 12,33	\$ 11,32	\$ 10,02
Erträge	\$ 29.531	\$ 15.584	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.706	1.527	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,91	\$ 10,21	k. A.
<b>Institutional CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 54.442	CHF 38.205	CHF 30.654
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.707	3.526	3.089
NIW je Anteil	CHF 11,57	CHF 10,84	CHF 9,92
Erträge	CHF 200	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	19	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,24	k. A.	k. A.
<b>Institutional EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 49.683	€ 2.069	€ 213
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.257	190	21
NIW je Anteil	€ 11,67	€ 10,90	€ 9,94
Erträge	€ 23.021	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.243	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,26	k. A.	k. A.

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)</b>			
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 15,049	£ 4,681	£ 190
ausgegebene und umlaufende Anteile	1,264	423	19
NIW je Anteil	£ 11,90	£ 11,06	£ 9,97
Erträge	£ 10,023	8	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	915	1	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,96	10,37	k. A.
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 349,070	2,498	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3,274	25	k. A.
NIW je Anteil	SEK 106,61	99,92	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 10,591	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1,011	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,47	k. A.	k. A.
Erträge	\$ 3,531	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	339	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,40	k. A.	k. A.
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 1,953	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	189	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,31	k. A.	k. A.
Erträge	CHF 31	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 10,23	k. A.	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 6,631	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	642	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,33	k. A.	k. A.
Erträge	€ 561	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	55	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,25	k. A.	k. A.
Class E GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 532	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	51	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,37	k. A.	k. A.
Erträge	£ 114	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	11	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,29	k. A.	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	\$ 6,627	\$ 6,050	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	580	580	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,43	10,43	k. A.
<b>Global Libor Plus Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 2.644.601	\$ 2.011.215	\$ 1.039.498
Institutional:			
thesaurierend	\$ 96,148	\$ 128,959	\$ 33,976
ausgegebene und umlaufende Anteile	8,110	11,272	3,133
NIW je Anteil	\$ 11,86	\$ 11,44	\$ 10,84
Erträge	\$ 8,606	\$ 19,181	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	830	1,887	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,37	\$ 10,16	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 54,549	€ 60,186	€ 19,022
ausgegebene und umlaufende Anteile	5,108	5,756	1,864
NIW je Anteil	€ 10,68	€ 10,46	€ 10,21
Erträge	€ 27,239	€ 34,069	€ 22,916
ausgegebene und umlaufende Anteile	2,796	3,519	2,363
NIW je Anteil	€ 9,74	€ 9,68	€ 9,70

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Global Libor Plus Bond Fund (Fortsetzung)</b>			
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 1,417,923	£ 1,017,469	£ 743,817
ausgegebene und umlaufende Anteile	126,639	93,369	70,782
NIW je Anteil	£ 11,20	£ 10,90	£ 10,51
Erträge	£ 352,374	£ 292,330	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	34,734	29,090	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,14	£ 10,05	k. A.
Investor:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,07
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 10,572	€ 13,093	€ 457
ausgegebene und umlaufende Anteile	1,036	1,306	46
NIW je Anteil	€ 10,20	€ 10,02	€ 9,82
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 5,666	€ 6,610	€ 8,507
ausgegebene und umlaufende Anteile	566	669	877
NIW je Anteil	€ 10,01	€ 9,87	€ 9,70
<b>Global Low Duration Real Return Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 787,871	\$ 997,469	\$ 1,154,274
Institutional:			
thesaurierend	\$ 121,782	\$ 116,913	\$ 147,957
ausgegebene und umlaufende Anteile	10,630	10,727	14,279
NIW je Anteil	\$ 11,46	\$ 10,90	\$ 10,36
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 9,85
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 10,894	CHF 8,710	CHF 6,259
ausgegebene und umlaufende Anteile	1,097	905	661
NIW je Anteil	CHF 9,93	CHF 9,62	CHF 9,47
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 360,889	€ 448,568	€ 517,285
ausgegebene und umlaufende Anteile	35,221	45,314	53,363
NIW je Anteil	€ 10,25	€ 9,90	€ 9,69
Erträge	€ 39,196	€ 36,978	€ 34,463
ausgegebene und umlaufende Anteile	4,002	3,887	3,663
NIW je Anteil	€ 9,79	€ 9,51	€ 9,41
ausschüttend II	k. A.	€ 2,476	€ 2,685
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	270	294
NIW je Anteil	k. A.	€ 9,19	€ 9,13
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 32,234	£ 26,840	£ 24,857
ausgegebene und umlaufende Anteile	3,025	2,623	2,511
NIW je Anteil	£ 10,66	£ 10,23	£ 9,90
Erträge	£ 31,115	£ 139,626	£ 133,866
ausgegebene und umlaufende Anteile	3,085	14,245	13,982
NIW je Anteil	£ 10,09	£ 9,80	£ 9,57
Investor:			
thesaurierend	\$ 3,787	\$ 4,758	\$ 8,343
ausgegebene und umlaufende Anteile	339	446	820
NIW je Anteil	\$ 11,17	\$ 10,66	\$ 10,17

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Global Low Duration Real Return Fund (Fortsetzung)</b>			
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 9
ausgegeben und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,66
Class E:			
thesaurierend	\$ 15.858	\$ 20.685	\$ 37.397
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.472	2.001	3.771
NIW je Anteil	\$ 10,77	\$ 10,34	\$ 9,92
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 47.404	€ 69.298	€ 103.449
ausgegeben und umlaufende Anteile	4.923	7.383	11.154
NIW je Anteil	€ 9,63	€ 9,39	€ 9,28
<b>Global Real Return Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 2.578.062	\$ 1.831.308	\$ 1.947.570
Institutional:			
thesaurierend	\$ 220.950	\$ 331.343	\$ 415.135
ausgegeben und umlaufende Anteile	9.004	15.014	20.454
NIW je Anteil	\$ 24,54	\$ 22,07	\$ 20,30
Erträge	\$ 26.256	\$ 19.087	\$ 26.351
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.349	1.090	1.624
NIW je Anteil	\$ 19,47	\$ 17,51	\$ 16,23
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 84.232	\$ 95.348	\$ 107.225
ausgegeben und umlaufende Anteile	7.004	9.013	11.007
NIW je Anteil	\$ 12,03	\$ 10,58	\$ 9,74
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 52.289	CHF 42.699	CHF 45.431
ausgegeben und umlaufende Anteile	3.366	2.992	3.346
NIW je Anteil	CHF 15,53	CHF 14,27	CHF 13,58
Erträge	CHF 36.335	CHF 33.787	CHF 44.636
ausgegeben und umlaufende Anteile	3.228	3.267	4.501
NIW je Anteil	CHF 11,26	CHF 10,34	CHF 9,92
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 796.538	€ 383.637	€ 325.520
ausgegeben und umlaufende Anteile	37.555	19.745	17.703
NIW je Anteil	€ 21,21	€ 19,43	€ 18,39
Erträge	€ 152.140	€ 104.389	€ 95.361
ausgegeben und umlaufende Anteile	9.195	6.885	6.593
NIW je Anteil	€ 16,55	€ 15,16	€ 14,46
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 33.719	£ 5.031	£ 4.853
ausgegeben und umlaufende Anteile	2.484	406	420
NIW je Anteil	£ 13,57	£ 12,38	£ 11,56
Erträge	£ 83.894	£ 82.056	£ 98.893
ausgegeben und umlaufende Anteile	8.128	8.716	11.162
NIW je Anteil	£ 10,32	£ 9,41	£ 8,86
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	SEK 2.084
ausgegeben und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	21
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SEK 99,26

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Global Real Return Fund (Fortsetzung)</b>			
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 157.065	SGD 142.723	SGD 125.345
ausgegeben und umlaufende Anteile	8.732	8.778	8.335
NIW je Anteil	SGD 17,99	SGD 16,26	SGD 15,04
Investor:			
thesaurierend	\$ 70.699	\$ 40.511	\$ 62.833
ausgegeben und umlaufende Anteile	3.062	1.944	3.267
NIW je Anteil	\$ 23,09	\$ 20,84	\$ 19,23
Erträge	\$ 21.532	\$ 4.727	\$ 4.765
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.269	309	336
NIW je Anteil	\$ 16,97	\$ 15,32	\$ 14,20
Investor CHF (Hedged):			
Erträge	CHF 4.219	CHF 3.529	CHF 3.779
ausgegeben und umlaufende Anteile	298	270	302
NIW je Anteil	CHF 14,17	CHF 13,06	CHF 12,53
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 15.265	€ 7.172	€ 6.254
ausgegeben und umlaufende Anteile	763	390	358
NIW je Anteil	€ 20,02	€ 18,40	€ 17,47
Erträge	k. A.	€ 3.662	€ 4.360
ausgegeben und umlaufende Anteile	k. A.	264	329
NIW je Anteil	k. A.	€ 13,89	€ 13,25
Administrative:			
thesaurierend	\$ 61.037	\$ 61.985	\$ 67.251
ausgegeben und umlaufende Anteile	2.694	3.028	3.554
NIW je Anteil	\$ 22,65	\$ 20,47	\$ 18,92
Class E:			
thesaurierend	\$ 157.612	\$ 114.663	\$ 133.498
ausgegeben und umlaufende Anteile	7.352	5.894	7.396
NIW je Anteil	\$ 21,44	\$ 19,45	\$ 18,05
Erträge	\$ 31.022	\$ 22.565	\$ 30.273
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.898	1.521	2.198
NIW je Anteil	\$ 16,35	\$ 14,83	\$ 13,77
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 217.762	€ 180.930	€ 199.930
ausgegeben und umlaufende Anteile	11.740	10.552	12.211
NIW je Anteil	€ 18,55	€ 17,15	€ 16,37
Class E GBP (Hedged):			
Erträge	£ 2.597	£ 2.708	£ 3.197
ausgegeben und umlaufende Anteile	171	194	243
NIW je Anteil	£ 15,19	£ 13,98	£ 13,17
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 49.942	\$ 47.466	\$ 20.650
ausgegeben und umlaufende Anteile	2.092	2.207	1.042
NIW je Anteil	\$ 23,87	\$ 21,50	\$ 19,81
Class R:			
thesaurierend	\$ 1.921	\$ 3.385	\$ 2.230
ausgegeben und umlaufende Anteile	142	277	198
NIW je Anteil	\$ 13,54	\$ 12,22	\$ 11,27
Class R EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 439	€ 831
ausgegeben und umlaufende Anteile	k. A.	40	79
NIW je Anteil	k. A.	€ 11,04	€ 10,48
Class R GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 13.745	£ 14.298	£ 18.011
ausgegeben und umlaufende Anteile	1.069	1.216	1.637
NIW je Anteil	£ 12,86	£ 11,75	£ 11,00
Erträge	k. A.	k. A.	£ 257
ausgegeben und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	25
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 10,30
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 166
ausgegeben und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	17
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,64

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Global Real Return Fund (Fortsetzung)			Income Fund (Fortsetzung)		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
Class Z AUD (Hedged):						
Erträge	k. A.	k. A.	AUD 10,714			
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	918			
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	AUD 11,67			
Institutional AUD (Hedged):						
thesaurierend	\$ 10,051.322	\$ 10,274.248	\$ 6,882.590			
ausgegebene und umlaufende Anteile	603.562	657.349	480.518			
NIW je Anteil	\$ 16,65	\$ 15,63	\$ 14,32			
Erträge	\$ 4,407.646	\$ 4,154.310	\$ 2,554.060			
ausgegebene und umlaufende Anteile	362.996	350.902	226.674			
NIW je Anteil	\$ 12,14	\$ 11,84	\$ 11,27			
Institutional BRL (Hedged):						
thesaurierend	\$ 601.491	\$ 650.135	\$ 704.958			
ausgegebene und umlaufende Anteile	46.272	41.616	48.602			
NIW je Anteil	\$ 13,00	\$ 15,62	\$ 14,50			
Institutional CAD (Hedged):						
thesaurierend	CAD 111.995	CAD 202.736	CAD 191.007			
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.629	16.527	16.851			
NIW je Anteil	CAD 12,98	CAD 12,27	CAD 11,33			
Erträge	CAD 127.606	CAD 27.082	CAD 20.780			
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.097	2.611	2.085			
NIW je Anteil	CAD 10,55	CAD 10,37	CAD 9,97			
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF 273.775	CHF 247.807	CHF 194.167			
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.558	21.298	17.609			
NIW je Anteil	CHF 12,14	CHF 11,64	CHF 11,03			
Erträge	CHF 183.521	CHF 186.768	CHF 126.715			
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.319	19.631	13.477			
NIW je Anteil	CHF 9,50	CHF 9,51	CHF 9,40			
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 6.723.610	€ 11.208.799	€ 7.263.923			
ausgegebene und umlaufende Anteile	453.932	791.100	543.109			
NIW je Anteil	€ 14,81	€ 14,17	€ 13,37			
Erträge	€ 963.725	€ 1.328.901	€ 1.028.287			
ausgegebene und umlaufende Anteile	90.563	125.057	98.355			
NIW je Anteil	€ 10,64	€ 10,63	€ 10,45			
ausschüttend II	€ 58.118	€ 50.579	€ 59.153			
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.750	5.128	6.231			
NIW je Anteil	€ 10,11	€ 9,86	€ 9,49			
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£ 13.809	£ 14.412	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.252	1.371	k. A.			
NIW je Anteil	£ 11,03	£ 10,51	k. A.			
Erträge	£ 426.938	£ 450.893	£ 360.188			
ausgegebene und umlaufende Anteile	40.380	42.958	35.350			
NIW je Anteil	£ 10,57	£ 10,50	£ 10,19			
Institutional HKD (Unhedged):						
Erträge	HKD 796.572	HKD 2.433.757	HKD 1.656.016			
ausgegebene und umlaufende Anteile	72.285	225.353	160.389			
NIW je Anteil	HKD 11,02	HKD 10,80	HKD 10,32			
Institutional JPY (Hedged):						
thesaurierend	¥ 198.303	¥ 2.345.707	¥ 981.451			
ausgegebene und umlaufende Anteile	181	2.251	1.000			
NIW je Anteil	¥ 1.093,00	¥ 1.042,00	¥ 981,00			
Institutional NOK (Hedged):						
thesaurierend	NOK 2.157.697	NOK 1.414.575	NOK 1.168.389			
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.680	12.812	11.404			
NIW je Anteil	NOK 115,51	NOK 110,41	NOK 102,44			
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD 2.335	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	218	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	SGD 10,73	k. A.	k. A.			
Erträge	SGD 271.784	SGD 272.041	SGD 104.040			
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.806	25.298	10.102			
NIW je Anteil	SGD 10,96	SGD 10,75	SGD 10,30			
Investor:						
thesaurierend	\$ 2.037.337	\$ 2.178.061	\$ 1.089.760			
ausgegebene und umlaufende Anteile	149.476	169.670	92.312			
NIW je Anteil	\$ 13,63	\$ 12,84	\$ 11,80			
Erträge	\$ 1.314.008	\$ 1.361.908	\$ 780.200			
ausgegebene und umlaufende Anteile	121.625	128.692	77.122			
NIW je Anteil	\$ 10,80	\$ 10,58	\$ 10,12			
Investor AUD (Hedged):						
Erträge	AUD 52.351	AUD 34.618	AUD 7.837			
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.112	3.394	795			
NIW je Anteil	AUD 10,24	AUD 10,20	AUD 9,86			
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€ 1.450.102	€ 2.476.697	€ 510.140			
ausgegebene und umlaufende Anteile	122.489	217.946	47.393			
NIW je Anteil	€ 11,84	€ 11,36	€ 10,76			
Erträge	€ 60.870	€ 56.952	€ 44.263			
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.496	6.055	4.760			
NIW je Anteil	€ 9,37	€ 9,41	€ 9,30			
ausschüttend A	€ 40.130	€ 43.870	€ 45.525			
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.156	4.534	4.759			
NIW je Anteil	€ 9,66	€ 9,68	€ 9,57			
Investor GBP (Hedged):						
Erträge	£ 3.920	k. A.	k. A.			
ausgegebene und umlaufende Anteile	390	k. A.	k. A.			
NIW je Anteil	£ 10,04	k. A.	k. A.			

		Zum		Zum		Zum	
		31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2019	31. Dez. 2018	31. Dez. 2018	31. Dez. 2018
<b>Income Fund (Fortsetzung)</b>							
Investor RMB (Hedged):							
thesaurierend	CNH	252.069	CNH	172.423	CNH		67
ausgebene und umlaufende Anteile		2.117		1.558			1
NIW je Anteil	CNH	119,09	CNH	110,67	CNH		101,42
Investor SGD (Hedged):							
thesaurierend	SGD	127		k. A.			k. A.
ausgebene und umlaufende Anteile		12		k. A.			k. A.
NIW je Anteil	SGD	10,47		k. A.			k. A.
Erträge	SGD	37.559	SGD	44.534	SGD		9.468
ausgebene und umlaufende Anteile		3.630		4.362			963
NIW je Anteil	SGD	10,35	SGD	10,21	SGD		9,83
Administrative:							
thesaurierend	\$	631.493	\$	604.794	\$		285.813
ausgebene und umlaufende Anteile		52.139		52.938			27.164
NIW je Anteil	\$	12,11	\$	11,42	\$		10,52
Erträge	\$	3.418.694	\$	3.727.673	\$		2.556.571
ausgebene und umlaufende Anteile		295.096		327.828			234.747
NIW je Anteil	\$	11,59	\$	11,37	\$		10,89
Administrative AUD (Hedged):							
Erträge	AUD	355.413	AUD	422.890	AUD		193.442
ausgebene und umlaufende Anteile		33.782		40.349			19.093
NIW je Anteil	AUD	10,52	AUD	10,48	AUD		10,13
Administrative EUR (Hedged):							
thesaurierend	€	242.607	€	264.971	€		86.218
ausgebene und umlaufende Anteile		20.554		23.357			8.011
NIW je Anteil	€	11,80	€	11,34	€		10,76
Erträge	€	331.791	€	648.757	€		463.737
ausgebene und umlaufende Anteile		34.844		67.857			49.048
NIW je Anteil	€	9,52	€	9,56	€		9,45
Administrative GBP (Hedged):							
Erträge	£	139.212	£	184.255	£		107.848
ausgebene und umlaufende Anteile		14.220		18.829			11.278
NIW je Anteil	£	9,79	£	9,79	£		9,56
Administrative HKD (Unhedged):							
Erträge	HKD	3.245.289	HKD	9.032.134	HKD		6.083.489
ausgebene und umlaufende Anteile		316.993		893.555			624.932
NIW je Anteil	HKD	10,24	HKD	10,11	HKD		9,73
Administrative SGD (Hedged):							
Erträge	SGD	1.038.592	SGD	1.241.938	SGD		1.030.567
ausgebene und umlaufende Anteile		90.748		109.801			94.517
NIW je Anteil	SGD	11,44	SGD	11,31	SGD		10,90
Class E:							
thesaurierend	\$	5.774.107	\$	6.190.628	\$		4.162.104
ausgebene und umlaufende Anteile		372.607		421.830			306.707
NIW je Anteil	\$	15,50	\$	14,68	\$		13,57
Erträge	\$	7.968.268	\$	8.505.996	\$		6.592.278
ausgebene und umlaufende Anteile		714.149		772.583			621.990
NIW je Anteil	\$	11,16	\$	11,01	\$		10,60
Ausschüttend Q	\$	1.841	\$	10			k. A.
ausgebene und umlaufende Anteile		180		1			k. A.
NIW je Anteil	\$	10,24	\$	10,11			k. A.

		Zum		Zum		Zum	
		31. Dez. 2020	31. Dez. 2019	31. Dez. 2019	31. Dez. 2018	31. Dez. 2018	31. Dez. 2018
<b>Income Fund (Fortsetzung)</b>							
Class E AUD (Hedged):							
Erträge	AUD	688.828	AUD	758.955	AUD		355.748
ausgebene und umlaufende Anteile		68.955		75.801			36.543
NIW je Anteil	AUD	9,99	AUD	10,01	AUD		9,73
Class E CHF (Hedged):							
thesaurierend	CHF	98.799	CHF	98.300	CHF		88.897
ausgebene und umlaufende Anteile		8.323		8.564			8.098
NIW je Anteil	CHF	11,87	CHF	11,48	CHF		10,98
Erträge	CHF	141.703	CHF	141.403	CHF		107.978
ausgebene und umlaufende Anteile		15.949		15.701			11.994
NIW je Anteil	CHF	8,88	CHF	9,01	CHF		9,00
Class E EUR (Hedged):							
thesaurierend	€	4.783.315	€	5.255.899	€		4.421.299
ausgebene und umlaufende Anteile		347.362		395.456			349.261
NIW je Anteil	€	13,77	€	13,29	€		12,66
Erträge	€	4.900.988	€	6.301.943	€		5.476.150
ausgebene und umlaufende Anteile		500.834		637.026			556.122
NIW je Anteil	€	9,79	€	9,89	€		9,85
ausschüttend II	€	128.995	€	123.289	€		36.332
ausgebene und umlaufende Anteile		12.476		12.107			3.673
NIW je Anteil	€	10,34	€	10,18	€		9,89
Ausschüttend II Q	€	35.195	€	10			k. A.
ausgebene und umlaufende Anteile		3.436		1			k. A.
NIW je Anteil	€	10,24	€	10,09			k. A.
Class E GBP (Hedged):							
Erträge	£	254.166	£	286.589	£		167.065
ausgebene und umlaufende Anteile		26.639		29.988			17.751
NIW je Anteil	£	9,54	£	9,59	£		9,41
Class E HKD (Unhedged):							
Erträge	HKD	5.569.457	HKD	10.267.660	HKD		8.248.912
ausgebene und umlaufende Anteile		534.050		992.891			824.940
NIW je Anteil	HKD	10,43	HKD	10,34	HKD		10,00
Class E JPY (Hedged):							
thesaurierend	¥	2.647.085	¥	1.145.115	¥		969.834
ausgebene und umlaufende Anteile		2.495		1.123			1.000
NIW je Anteil	¥	1.061,00	¥	1.020,00	¥		970,00
Class E RMB (Hedged):							
Erträge	CNH	593.183	CNH	481.871	CNH		237.470
ausgebene und umlaufende Anteile		4.815		4.045			2.091
NIW je Anteil	CNH	123,20	CNH	119,14	CNH		113,58
Class E SGD (Hedged):							
Erträge	SGD	2.701.956	SGD	3.073.114	SGD		1.951.313
ausgebene und umlaufende Anteile		263.912		302.107			197.979
NIW je Anteil	SGD	10,24	SGD	10,17	SGD		9,86
G Retail EUR (Hedged):							
Erträge	€	35.845	€	38.008	€		24.779
ausgebene und umlaufende Anteile		3.801		4.009			2.635
NIW je Anteil	€	9,43	€	9,48	€		9,40
G Retail EUR (Unhedged):							
Erträge	€	275	€	214			k. A.
ausgebene und umlaufende Anteile		29		21			k. A.
NIW je Anteil	€	9,55	€	10,19			k. A.

# Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
				<b>Inflation Strategy Fund (Fortsetzung)</b>			
H Institutional:							
thesaurierend	\$ 562.857	\$ 365.987	\$ 2.314				
ausgegebene und umlaufende Anteile	48.123	33.279	229				
NIW je Anteil	\$ 11,70	\$ 11,00	\$ 10,09				
Erträge	\$ 299.508	\$ 102.256	\$ 22.509				
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.375	9.904	2.283				
NIW je Anteil	\$ 10,56	\$ 10,33	\$ 9,86				
H Institutional EUR (Hedged):							
thesaurierend	€ 2.672	€ 6.121	€ 3.745				
ausgegebene und umlaufende Anteile	245	587	380				
NIW je Anteil	€ 10,89	€ 10,43	€ 9,86				
Class R:							
thesaurierend	\$ 31.223	\$ 460	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.892	45	k. A.				
NIW je Anteil	\$ 10,80	\$ 10,16	k. A.				
Erträge	\$ 70.869	\$ 79.288	\$ 36.653				
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.645	7.596	3.676				
NIW je Anteil	\$ 10,66	\$ 10,44	\$ 9,97				
Class R EUR (Hedged):							
Erträge	€ 14.929	€ 12.104	€ 6.848				
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.514	1.228	705				
NIW je Anteil	€ 9,86	€ 9,86	€ 9,71				
Class R GBP (Hedged):							
Erträge	£ 31.954	£ 47.760	£ 44.583				
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.878	4.319	4.140				
NIW je Anteil	£ 11,10	£ 11,06	£ 10,77				
Class T:							
thesaurierend	\$ 359.667	\$ 320.094	\$ 171.658				
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.049	26.253	15.165				
NIW je Anteil	\$ 12,82	\$ 12,19	\$ 11,32				
Erträge	\$ 131.492	\$ 123.053	\$ 83.726				
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.244	12.498	8.791				
NIW je Anteil	\$ 9,93	\$ 9,85	\$ 9,52				
Class T EUR (Hedged):							
thesaurierend	€ 280.339	€ 337.746	€ 316.914				
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.457	30.407	29.836				
NIW je Anteil	€ 11,46	€ 11,11	€ 10,62				
Erträge	€ 252.475	€ 288.304	€ 273.475				
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.837	32.410	30.740				
NIW je Anteil	€ 8,76	€ 8,90	€ 8,90				
Class Z:							
thesaurierend	\$ 110.891	\$ 191.604	\$ 276.566				
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.376	11.803	18.691				
NIW je Anteil	\$ 17,39	\$ 16,23	\$ 14,80				
Class Z AUD (Hedged):							
ausschüttend II	AUD 1.115.008	AUD 1.007.912	AUD 439.621				
ausgegebene und umlaufende Anteile	98.412	90.457	41.320				
NIW je Anteil	AUD 11,33	AUD 11,14	AUD 10,64				
				<b>Inflation Strategy Fund</b>			
Nettvermögen	\$ 70.032	\$ 70.015	\$ 76.181				
Institutional:							
thesaurierend	\$ 55.509	\$ 53.654	\$ 29.343				
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.263	5.290	3.238				
NIW je Anteil	\$ 10,55	\$ 10,14	\$ 9,06				
				<b>Low Average Duration Fund</b>			
Nettvermögen	\$ 1.183.413	\$ 1.189.920	\$ 1.221.290				
Institutional:							
thesaurierend	\$ 806.772	\$ 739.870	\$ 683.804				
ausgegebene und umlaufende Anteile	48.799	46.151	44.610				
NIW je Anteil	\$ 16,53	\$ 16,03	\$ 15,33				
Erträge	\$ 37.437	\$ 36.323	\$ 115.451				
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.500	3.449	11.128				
NIW je Anteil	\$ 10,70	\$ 10,53	\$ 10,38				
Institutional EUR (Hedged):							
thesaurierend	€ 35.471	€ 120.782	€ 162.018				
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.347	11.595	15.800				
NIW je Anteil	€ 10,60	€ 10,42	€ 10,25				
Erträge	€ 8.988	€ 3.122	€ 6.761				
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.141	397	848				
NIW je Anteil	€ 7,88	€ 7,86	€ 7,97				
Institutional GBP (Hedged):							
thesaurierend	£ 6.460	£ 50.240	£ 5.705				
ausgegebene und umlaufende Anteile	621	4.943	577				
NIW je Anteil	£ 10,40	£ 10,16	£ 9,89				
Erträge	£ 11.174	£ 21.383	£ 15.193				
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.141	2.200	1.560				
NIW je Anteil	£ 9,79	£ 9,72	£ 9,74				
Institutional ILS (Hedged):							
thesaurierend	k. A.	ILS 91	ILS 467				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	8	41				
NIW je Anteil	k. A.	ILS 11,64	ILS 11,38				
Investor:							
thesaurierend	\$ 30.355	\$ 35.844	\$ 71.843				
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.945	2.360	4.930				
NIW je Anteil	\$ 15,61	\$ 15,19	\$ 14,57				
Erträge	\$ 9.569	\$ 7.369	\$ 6.700				
ausgegebene und umlaufende Anteile	902	705	651				
NIW je Anteil	\$ 10,61	\$ 10,45	\$ 10,29				
Administrative:							
thesaurierend	\$ 15.464	\$ 15.593	\$ 16.957				
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.014	1.050	1.188				
NIW je Anteil	\$ 15,24	\$ 14,86	\$ 14,28				

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Low Average Duration Fund (Fortsetzung)</b>			
<b>Class E:</b>			
thesaurierend	\$ 81.937	\$ 61.547	\$ 68.456
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.297	4.834	5.573
NIW je Anteil	\$ 13,01	\$ 12,73	\$ 12,28
Erträge	\$ 13.842	\$ 8.195	\$ 9.521
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.251	752	887
NIW je Anteil	\$ 11,06	\$ 10,89	\$ 10,73
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 19.638	€ 19.167	€ 21.740
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.247	2.212	2.525
NIW je Anteil	€ 8,74	€ 8,67	€ 8,61
<b>H Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 72.717	\$ 23.377	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.837	1.931	1
NIW je Anteil	\$ 12,46	\$ 12,11	\$ 11,60
Erträge	\$ 6.978	\$ 682	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	677	67	1
NIW je Anteil	\$ 10,31	\$ 10,15	\$ 10,02
<b>Class R:</b>			
thesaurierend	\$ 5.812	\$ 5.614	\$ 2.735
ausgegebene und umlaufende Anteile	522	518	263
NIW je Anteil	\$ 11,14	\$ 10,84	\$ 10,39
<b>Class R EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 1.112
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	115
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,70
<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>			
<b>Nettovermögen</b>	\$ 632.519	\$ 510.334	\$ 526.200
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 92.260	\$ 39.499	\$ 59.049
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.572	3.348	5.320
NIW je Anteil	\$ 12,18	\$ 11,80	\$ 11,10
<b>Institutional CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	k. A.	CHF 265	CHF 287
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	26	29
NIW je Anteil	k. A.	CHF 10,14	CHF 9,87
<b>Institutional EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 358.476	€ 336.379	€ 335.782
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.815	31.355	32.302
NIW je Anteil	€ 10,92	€ 10,73	€ 10,39
<b>Institutional GBP (Hedged):</b>			
thesaurierend	£ 20.287	£ 11.603	£ 725
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.754	1.030	67
NIW je Anteil	£ 11,57	£ 11,27	£ 10,79
<b>Institutional NOK (Hedged):</b>			
thesaurierend	NOK 416.606	NOK 534.600	NOK 551.608
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.864	5.092	5.518
NIW je Anteil	NOK 107,82	NOK 105,00	NOK 99,96
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 20.641	€ 14.939	€ 16.083
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.011	1.469	1.617
NIW je Anteil	€ 10,26	€ 10,17	€ 9,94
<b>Low Duration Income Fund</b>			
<b>Nettovermögen</b>	\$ 960.639	\$ 478.805	\$ 377.768
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 6.730	\$ 12.220	\$ 32.860
ausgegebene und umlaufende Anteile	607	1.137	3.271
NIW je Anteil	\$ 11,08	\$ 10,74	\$ 10,04
Erträge	\$ 2.025	\$ 2.474	\$ 3.688
ausgegebene und umlaufende Anteile	196	242	373
NIW je Anteil	\$ 10,31	\$ 10,24	\$ 9,89

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Low Duration Income Fund (Fortsetzung)</b>			
<b>Institutional CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 401	CHF 222	CHF 215
ausgegebene und umlaufende Anteile	39	22	25
NIW je Anteil	CHF 10,32	CHF 10,19	CHF 9,85
Erträge	CHF 10	CHF 10	CHF 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	CHF 9,58	CHF 9,71	CHF 9,70
<b>Institutional EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 605.043	€ 316.084	€ 296.875
ausgegebene und umlaufende Anteile	58.084	30.811	30.046
NIW je Anteil	€ 10,42	€ 10,26	€ 9,88
<b>Institutional GBP (Hedged):</b>			
thesaurierend	£ 150.468	£ 78.399	£ 179
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.121	7.507	18
NIW je Anteil	£ 10,66	£ 10,44	£ 9,95
Erträge	£ 8	£ 8	£ 7
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	£ 9,86	£ 9,95	£ 9,79
<b>Institutional SGD (Hedged):</b>			
thesaurierend	SGD 589	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	57	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,30	k. A.	k. A.
<b>Investor EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 9	€ 9	€ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	€ 10,32	€ 10,20	€ 9,86
Erträge	€ 9	€ 9	€ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	€ 9,62	€ 9,76	€ 9,72
<b>Class E:</b>			
thesaurierend	\$ 1.386	\$ 2.778	\$ 1.061
ausgegebene und umlaufende Anteile	128	262	106
NIW je Anteil	\$ 10,85	\$ 10,61	\$ 10,00
Erträge	\$ 1.034	\$ 11	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	102	1	1
NIW je Anteil	\$ 10,17	\$ 10,20	\$ 9,88
<b>Class E CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 10	CHF 10	CHF 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	CHF 10,10	CHF 10,06	CHF 9,81
Erträge	CHF 10	CHF 39	CHF 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	4	1
NIW je Anteil	CHF 9,46	CHF 9,68	CHF 9,70
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 1.334	€ 1.029	€ 17
ausgegebene und umlaufende Anteile	131	102	1
NIW je Anteil	€ 10,18	€ 10,12	€ 9,83
Erträge	€ 265	€ 651	€ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	28	67	1
NIW je Anteil	€ 9,55	€ 9,74	€ 9,72
<b>Class E SGD (Hedged):</b>			
Erträge	SGD 712	SGD 609	SGD 333
ausgegebene und umlaufende Anteile	71	60	34
NIW je Anteil	SGD 10,02	SGD 10,10	SGD 9,84
<b>H Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,33	k. A.	k. A.
<b>Class Z EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,59	k. A.	k. A.

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
Nettovermögen	\$ 77.631	\$ 238.171	\$ 246.190
Institutional:			
thesaurierend	\$ 22.753	\$ 59.992	\$ 28.979
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.069	7.854	4.096
NIW je Anteil	\$ 5,59	\$ 7,64	\$ 7,07
Erträge	\$ 30.040	\$ 98.963	\$ 75.317
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.885	17.085	13.227
NIW je Anteil	\$ 3,81	\$ 5,79	\$ 5,69
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 7.987	€ 12.933	€ 96.080
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.623	1.862	14.501
NIW je Anteil	€ 4,92	€ 6,95	€ 6,63
Erträge	€ 1.546	€ 4.362	€ 6.712
ausgegebene und umlaufende Anteile	461	828	1.258
NIW je Anteil	€ 3,36	€ 5,27	€ 5,34
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 961	£ 18.221	£ 64
ausgegebene und umlaufende Anteile	195	2.549	10
NIW je Anteil	£ 4,93	£ 7,15	£ 6,73
Erträge	£ 101	£ 11.428	£ 8.325
ausgegebene und umlaufende Anteile	30	2.113	1.540
NIW je Anteil	£ 3,34	£ 5,41	£ 5,41
Investor:			
thesaurierend	\$ 1.179	\$ 6.882	\$ 6.396
ausgegebene und umlaufende Anteile	168	717	717
NIW je Anteil	\$ 7,00	\$ 9,60	\$ 8,92
Erträge	\$ 7	\$ 10	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 5,76	\$ 8,79	\$ 8,68
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 24	€ 8	€ 7
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	1	1
NIW je Anteil	€ 6,55	€ 9,26	€ 8,87
Class E:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 369
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	55
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 6,73
Erträge	\$ 4.830	\$ 6.631	\$ 4.120
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.368	1.219	761
NIW je Anteil	\$ 3,53	\$ 5,44	\$ 5,41
ausschüttend II	k. A.	\$ 19	\$ 1.043
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	4	193
NIW je Anteil	k. A.	\$ 5,43	\$ 5,41
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 793
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	126
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 6,29
Erträge	k. A.	k. A.	€ 734
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	145
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 5,05
Class R GBP (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	£ 5
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 6,66
Erträge	k. A.	k. A.	£ 4
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 5,33
Class Z:			
thesaurierend	\$ 5.677	\$ 6.975	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	818	743	k. A.
NIW je Anteil	\$ 6,94	\$ 9,39	k. A.

  

	Mortgage Opportunities Fund		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
Nettovermögen	\$ 1.977.007	\$ 1.675.111	\$ 2.183.029
Institutional:			
thesaurierend	\$ 491.609	\$ 549.333	\$ 420.894
ausgegebene und umlaufende Anteile	42.776	49.738	39.936
NIW je Anteil	\$ 11,49	\$ 11,04	\$ 10,53
Erträge	\$ 285.533	\$ 151.724	\$ 390.633
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.386	15.217	39.498
NIW je Anteil	\$ 10,06	\$ 9,97	\$ 9,89
ausschüttend II	k. A.	\$ 58	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	6	1
NIW je Anteil	k. A.	\$ 9,71	\$ 9,70
Institutional BRL (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	\$ 4.452	\$ 4.325
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	475	478
NIW je Anteil	k. A.	\$ 9,39	\$ 9,06
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 6.951	CHF 71.448	CHF 57.726
ausgegebene und umlaufende Anteile	670	7.056	5.778
NIW je Anteil	CHF 10,37	CHF 10,13	CHF 9,99
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 330.507	€ 233.809	€ 500.784
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.397	22.781	49.681
NIW je Anteil	€ 10,53	€ 10,26	€ 10,08
Erträge	€ 9.571	€ 9.443	€ 13.823
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.041	1.021	1.463
NIW je Anteil	€ 9,20	€ 9,25	€ 9,45
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 7.971	£ 9.428	£ 5.985
ausgegebene und umlaufende Anteile	730	892	583
NIW je Anteil	£ 10,92	£ 10,58	£ 10,26
Erträge	£ 11.380	£ 7.570	£ 12.562
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.192	793	1.304
NIW je Anteil	£ 9,55	£ 9,54	£ 9,63
Investor:			
thesaurierend	\$ 49.987	\$ 20.774	\$ 19.889
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.499	1.939	1.940
NIW je Anteil	\$ 11,11	\$ 10,71	\$ 10,25
Erträge	\$ 12.072	\$ 7.931	\$ 4.234
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.200	796	428
NIW je Anteil	\$ 10,06	\$ 9,97	\$ 9,88
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 99
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	10
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,85
Administrative:			
Erträge	\$ 544	\$ 832	\$ 776
ausgegebene und umlaufende Anteile	54	83	78
NIW je Anteil	\$ 10,06	\$ 9,97	\$ 9,89
Administrative SGD (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	SGD 404
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	41
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SGD 9,78

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018		Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
				<b>Mortgage Opportunities Fund (Fortsetzung)</b>			
Class E:							
thesaurierend	\$ 65.293	\$ 79.775	\$ 169.343				
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.878	7.409	16.344				
NIW je Anteil	\$ 11,11	\$ 10,77	\$ 10,36				
Erträge	\$ 10.765	\$ 13.300	\$ 24.104				
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.070	1.333	2.435				
NIW je Anteil	\$ 10,06	\$ 9,98	\$ 9,90				
Class E CHF (Hedged):							
Erträge	CHF 338	CHF 400	CHF 555				
ausgegebene und umlaufende Anteile	38	44	60				
NIW je Anteil	CHF 8,98	CHF 9,05	CHF 9,29				
Class E EUR (Hedged):							
thesaurierend	€ 18.176	€ 45.673	€ 76.899				
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.788	4.571	7.764				
NIW je Anteil	€ 10,16	€ 9,99	€ 9,90				
Erträge	€ 131	€ 417	€ 10.348				
ausgegebene und umlaufende Anteile	14	45	1.104				
NIW je Anteil	€ 9,13	€ 9,18	€ 9,38				
Class E HKD (Unhedged):							
thesaurierend	k. A.	k. A.	HKD 78				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	8				
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	HKD 9,99				
Class E SGD (Hedged):							
thesaurierend	SGD 15	SGD 91	SGD 2.168				
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	9	217				
NIW je Anteil	SGD 10,63	SGD 10,34	SGD 10,01				
Erträge	SGD 2.135	SGD 6.455	SGD 8.557				
ausgegebene und umlaufende Anteile	217	659	875				
NIW je Anteil	SGD 9,85	SGD 9,80	SGD 9,77				
H Institutional:							
thesaurierend	\$ 11	k. A.	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.				
NIW je Anteil	\$ 10,62	k. A.	k. A.				
M Retail HKD (Unhedged):							
Erträge	k. A.	k. A.	HKD 78				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	8				
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	HKD 9,66				
Class T EUR (Hedged):							
thesaurierend	k. A. €	239 €	354				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	25	37				
NIW je Anteil	k. A. €	9,64 €	9,59				
Class Z:							
thesaurierend	\$ 74.635	107.101	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.012	10.548	k. A.				
NIW je Anteil	\$ 10,64	10,15	k. A.				
Class Z EUR (Hedged):							
thesaurierend	k. A.	k. A. €	69.276				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	6.905				
NIW je Anteil	k. A.	k. A. €	10,03				
Class Z GBP (Hedged):							
thesaurierend	£ 374.361	£ 236.415	£ 227.839				
ausgegebene und umlaufende Anteile	34.658	22.764	22.764				
NIW je Anteil	£ 10,80	£ 10,39	£ 10,01				
				<b>PIMCO RAE Emerging Markets Fund</b>			
Nettovermögen	k. A. \$	115.230 \$	94.740				
Institutional:							
thesaurierend	k. A. \$	5.412 \$	7.558				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	416	666				
NIW je Anteil	k. A. \$	13,00 \$	11,35				
Institutional EUR (Unhedged):							
thesaurierend	k. A. €	10.904 €	22.574				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	846	2.042				
NIW je Anteil	k. A. €	12,89 €	11,06				
				<b>PIMCO RAE Europe Fund</b>			
Nettovermögen	k. A. €	23.470 €	8.125				
Institutional:							
thesaurierend	k. A. €	16.315 €	1.268				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1.396	131				
NIW je Anteil	k. A. €	11,69 €	9,69				
Institutional GBP (Unhedged):							
thesaurierend	k. A. £	5 £	12				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	0*	1				
NIW je Anteil	k. A. £	13,98 £	12,27				
Institutional USD (Unhedged):							
thesaurierend	k. A. \$	3.916 \$	4.476				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	333	450				
NIW je Anteil	k. A. \$	11,78 \$	9,94				
Class E:							
thesaurierend	k. A. €	3.612 €	2.751				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	321	293				
NIW je Anteil	k. A. €	11,25 €	9,40				
Class E USD (Unhedged):							
thesaurierend	k. A. \$	56 \$	10				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	5	1				
NIW je Anteil	k. A. \$	11,34 \$	9,65				
Class R GBP (Unhedged):							
thesaurierend	k. A. £	k. A. £	8				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1				
NIW je Anteil	k. A. £	k. A. £	12,16				
Class T:							
thesaurierend	k. A.	k. A. €	151				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	16				
NIW je Anteil	k. A.	k. A. €	9,27				
Class T USD (Unhedged):							
thesaurierend	k. A.	k. A. \$	10				
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1				
NIW je Anteil	k. A.	k. A. \$	9,51				

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>PIMCO RAE Global Developed Fund</b>			
Nettovermögen	k. A.	\$ 55.769	\$ 31.939
Institutional:			
thesaurierend	k. A.	\$ 5.382	\$ 3.373
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	403	303
NIW je Anteil	k. A.	\$ 13,35	\$ 11,12
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 8.912	€ 11.546
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	672	1.064
NIW je Anteil	k. A.	€ 13,26	€ 10,85
Institutional GBP (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	£ 457	£ 372
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	29	27
NIW je Anteil	k. A.	£ 15,85	£ 13,73
Class E:			
thesaurierend	k. A.	\$ 116	\$ 113
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	9	10
NIW je Anteil	k. A.	\$ 12,85	\$ 10,80
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 35.334	€ 12.677
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	2.771	1.205
NIW je Anteil	k. A.	€ 12,75	€ 10,52
Class R GBP (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	£ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 13,62
Class T:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 40
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	4
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,65
Class T EUR (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 208
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	20
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 10,38
<b>PIMCO RAE US Fund</b>			
Nettovermögen	k. A.	\$ 14.183	\$ 11.525
Institutional:			
thesaurierend	k. A.	\$ 12.297	\$ 9.908
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	843	843
NIW je Anteil	k. A.	\$ 14,58	\$ 11,75
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 11,50
Institutional GBP (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	£ 3	£ 12
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	0*	1
NIW je Anteil	k. A.	£ 17,31	£ 14,51
Class E:			
thesaurierend	k. A.	\$ 410	\$ 162
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	29	14
NIW je Anteil	k. A.	\$ 14,04	\$ 11,41
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 1.311	€ 904
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	95	81
NIW je Anteil	k. A.	€ 13,92	€ 11,11
Class R GBP (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	£ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 14,37
Class T:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 349
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	31
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 11,25

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>PIMCO RAE US Fund (Fortsetzung)</b>			
Class T EUR (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 29
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	3
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 10,96
<b>PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund</b>			
Nettovermögen	k. A.	\$ 11.347	\$ 9.889
Institutional:			
thesaurierend	k. A.	\$ 11.325	\$ 9.870
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	998	998
NIW je Anteil	k. A.	\$ 11,35	\$ 9,89
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 10	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	1
NIW je Anteil	k. A.	€ 11,52	€ 9,86
Institutional GBP (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	£ 8	£ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	1
NIW je Anteil	k. A.	£ 11,00	£ 9,97
<b>PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund</b>			
Nettovermögen	k. A.	€ 5.125	€ 4.104
Institutional:			
thesaurierend	k. A.	€ 5.115	€ 4.096
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	434	434
NIW je Anteil	k. A.	€ 11,79	€ 9,44
Institutional USD (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	\$ 12	\$ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	1
NIW je Anteil	k. A.	\$ 11,61	\$ 9,47
<b>PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund</b>			
Nettovermögen	k. A.	\$ 5.666	\$ 4.623
Institutional:			
thesaurierend	k. A.	\$ 5.643	\$ 4.605
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	498	498
NIW je Anteil	k. A.	\$ 11,33	\$ 9,25
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 10	€ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	1
NIW je Anteil	k. A.	€ 11,50	€ 9,22
Institutional GBP (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	£ 8	£ 7
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	1
NIW je Anteil	k. A.	£ 10,98	£ 9,32
<b>PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund</b>			
Nettovermögen	k. A.	\$ 3.424	\$ 2.727
Institutional:			
thesaurierend	k. A.	\$ 3.402	\$ 2.709
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	298	298
NIW je Anteil	k. A.	\$ 11,41	\$ 9,09
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 10	€ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	1
NIW je Anteil	k. A.	€ 11,59	€ 9,06
Institutional GBP (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	£ 9	£ 7
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	1
NIW je Anteil	k. A.	£ 11,06	£ 9,17

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Nettovermögen</b>	<b>\$ 3.538.833</b>	<b>\$ 3.009.851</b>	<b>\$ 2.299.203</b>
<b>StocksPLUS™ Fund</b>			
Institutional:			
thesaurierend	\$ 2.530.233	\$ 2.383.353	\$ 1.913.160
ausgegebene und umlaufende Anteile	53.956	60.249	64.141
NIW je Anteil	\$ 46,89	\$ 39,56	\$ 29,83
Erträge	\$ 45.032	\$ 40.271	\$ 30.930
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.319	1.398	1.420
NIW je Anteil	\$ 34,14	\$ 28,80	\$ 21,78
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 530.048	€ 173.309	€ 141.088
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.143	7.233	7.580
NIW je Anteil	€ 27,69	€ 23,96	€ 18,61
Erträge	€ 1.636	€ 2.782	€ 4.255
ausgegebene und umlaufende Anteile	68	133	261
NIW je Anteil	€ 24,18	€ 20,92	€ 16,30
Investor:			
thesaurierend	\$ 18.615	\$ 7.398	\$ 15.639
ausgegebene und umlaufende Anteile	428	201	561
NIW je Anteil	\$ 43,53	\$ 36,85	\$ 27,88
Class E:			
thesaurierend	\$ 91.242	\$ 107.429	\$ 64.510
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.210	3.057	2.413
NIW je Anteil	\$ 41,29	\$ 35,14	\$ 26,74
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9.527	€ 242.896	€ 94.492
ausgegebene und umlaufende Anteile	668	19.514	9.685
NIW je Anteil	€ 14,25	€ 12,45	€ 9,76
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 189.133	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.101	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,75	k. A.	k. A.
Class T:			
thesaurierend	\$ 2.380	\$ 1.087	\$ 754
ausgegebene und umlaufende Anteile	140	75	68
NIW je Anteil	\$ 17,03	\$ 14,55	\$ 11,12
Class Z:			
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 43
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 28,89
<b>Nettovermögen</b>	<b>\$ 8.417</b>	<b>\$ 5.977</b>	<b>k. A.</b>
<b>PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>			
Institutional:			
thesaurierend	\$ 8.021	\$ 5.965	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	570	505	k. A.
NIW je Anteil	\$ 14,09	\$ 11,82	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 312	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 13,52	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 14	12	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 13,87	11,74	k. A.
<b>Nettovermögen</b>	<b>\$ 974.664</b>	<b>\$ 1.169.920</b>	<b>\$ 899.132</b>
<b>Strategic Income Fund</b>			
Institutional:			
thesaurierend	\$ 35.112	\$ 37.366	\$ 27.584
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.118	3.465	2.834
NIW je Anteil	\$ 11,26	\$ 10,78	\$ 9,73
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 453.622	€ 582.709	€ 453.817
ausgegebene und umlaufende Anteile	34.652	45.284	37.991
NIW je Anteil	€ 13,09	€ 12,87	€ 11,95

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Nettovermögen</b>	<b>\$ 6.424.053</b>	<b>\$ 5.139.388</b>	<b>\$ 4.899.730</b>
<b>Total Return Bond Fund</b>			
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.930.542	\$ 1.630.580	\$ 1.180.325
ausgegebene und umlaufende Anteile	55.944	51.581	40.684
NIW je Anteil	\$ 34,51	\$ 31,61	\$ 29,01
Erträge	\$ 187.163	\$ 158.594	\$ 180.665
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.216	9.247	11.145
NIW je Anteil	\$ 18,32	\$ 17,15	\$ 16,21
Institutional CAD (Hedged):			
Erträge	CAD 26.735	CAD 25.530	CAD 21.898
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.497	2.540	2.288
NIW je Anteil	CAD 10,70	CAD 10,05	CAD 9,57
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 16.880	CHF 11.585	CHF 10.779
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.388	1.020	1.000
NIW je Anteil	CHF 12,16	CHF 11,35	CHF 10,78
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 495.828	€ 333.231	€ 445.069
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.771	15.002	21.199
NIW je Anteil	€ 23,87	€ 22,21	€ 20,99
Erträge	€ 216.306	€ 183.599	€ 157.064
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.322	12.786	11.235
NIW je Anteil	€ 15,10	€ 14,36	€ 13,98
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 33.888	€ 17.973	€ 26.611
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.202	638	1.049
NIW je Anteil	€ 28,20	€ 28,15	€ 25,37

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Total Return Bond Fund (Fortsetzung)		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Institutional GBP (Hedged):</b>			
thesaurierend	£ 9.730	£ 14.352	£ 12.816
ausgegebene und umlaufende Anteile	658	1.049	1.004
NIW je Anteil	£ 14,80	£ 13,68	£ 12,77
Erträge	£ 39.302	£ 36.454	£ 43.164
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.783	3.713	4.572
NIW je Anteil	£ 10,39	£ 9,82	£ 9,44
<b>Institutional ILS (Hedged):</b>			
thesaurierend	ILS 578	ILS 2.518	ILS 2.835
ausgegebene und umlaufende Anteile	39	186	223
NIW je Anteil	ILS 14,67	ILS 13,57	ILS 12,73
<b>Institutional JPY (Hedged):</b>			
thesaurierend	k. A. ¥	310 ¥	188.233
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	0*	185
NIW je Anteil	k. A. ¥	1.079,00 ¥	1.019,00
<b>Institutional SGD (Hedged):</b>			
thesaurierend	SGD 19.222	SGD 16.668	SGD 30.149
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.320	1.245	2.438
NIW je Anteil	SGD 14,57	SGD 13,39	SGD 12,36
<b>Investor:</b>			
thesaurierend	\$ 573.009	\$ 469.771	\$ 444.421
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.957	16.014	16.450
NIW je Anteil	\$ 31,91	\$ 29,33	\$ 27,02
Erträge	\$ 129.625	\$ 57.950	\$ 59.016
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.977	3.332	3.590
NIW je Anteil	\$ 18,58	\$ 17,39	\$ 16,44
<b>Investor CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 6.265	CHF 6.274	CHF 7.269
ausgegebene und umlaufende Anteile	532	569	692
NIW je Anteil	CHF 11,77	CHF 11,02	CHF 10,50
<b>Investor EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 27.120	€ 28.221	€ 31.619
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.201	1.339	1.581
NIW je Anteil	€ 22,58	€ 21,08	€ 19,99
<b>Investor GBP (Hedged):</b>			
thesaurierend	k. A. £	1.430 £	2.555
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	117	222
NIW je Anteil	k. A. £	12,26 £	11,49
<b>Administrative:</b>			
thesaurierend	\$ 188.750	\$ 196.846	\$ 213.762
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.973	6.766	7.965
NIW je Anteil	\$ 31,60	\$ 29,09	\$ 26,83
<b>Administrative EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 3.742	€ 2.224	€ 2.738
ausgegebene und umlaufende Anteile	277	177	228
NIW je Anteil	€ 13,51	€ 12,63	€ 12,00
<b>Class E:</b>			
thesaurierend	\$ 676.175	\$ 568.315	\$ 507.254
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.380	20.350	19.613
NIW je Anteil	\$ 30,21	\$ 27,93	\$ 25,86
Erträge	\$ 243.049	\$ 211.320	\$ 220.186
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.436	16.192	17.850
NIW je Anteil	\$ 13,94	\$ 13,05	\$ 12,33
<b>Class E CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 6.592	CHF 4.734	CHF 5.032
ausgegebene und umlaufende Anteile	625	477	529
NIW je Anteil	CHF 10,55	CHF 9,93	CHF 9,52
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 833.038	€ 784.034	€ 878.029
ausgegebene und umlaufende Anteile	39.827	39.922	46.877
NIW je Anteil	€ 20,92	€ 19,64	€ 18,73
Erträge	€ 74.430	€ 77.397	€ 86.215
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.393	8.085	9.250
NIW je Anteil	€ 10,07	€ 9,57	€ 9,32

  

	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund			
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018	Zum 31. Dez. 2017
<b>Class E HKD (Unhedged):</b>				
thesaurierend	HKD 2.773	HKD 3.078	HKD	5.848
ausgegebene und umlaufende Anteile	226	270		552
NIW je Anteil	HKD 12,26	HKD 11,39	HKD	10,59
<b>Class E SGD (Hedged):</b>				
thesaurierend	SGD 42.772	SGD 37.932	SGD	37.144
ausgegebene und umlaufende Anteile	968	925		972
NIW je Anteil	SGD 44,20	SGD 41,00	SGD	38,19
Erträge	k. A.	SGD 1.169	SGD	1.312
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	114		135
NIW je Anteil	k. A.	SGD 10,24	SGD	9,74
<b>H Institutional:</b>				
thesaurierend	\$ 205.400	\$ 43.706	\$	36.571
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.124	1.420		1.292
NIW je Anteil	\$ 33,54	\$ 30,78	\$	28,30
Erträge	\$ 15.468	\$ 3.942	\$	599
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.377	375		60
NIW je Anteil	\$ 11,23	\$ 10,51	\$	9,94
<b>M Retail HKD (Unhedged):</b>				
Erträge	HKD 96.768	HKD 98.502	HKD	10.780
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.838	9.562		1.102
NIW je Anteil	HKD 10,95	HKD 10,30	HKD	9,78
<b>Class R:</b>				
thesaurierend	k. A.	\$ 3.043	\$	2.452
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	258		226
NIW je Anteil	k. A.	\$ 11,78	\$	10,84
Erträge	k. A.	\$ 2.922	\$	2.759
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	286		286
NIW je Anteil	k. A.	\$ 10,21	\$	9,65
<b>Class R EUR (Hedged):</b>				
thesaurierend	€ 5.521	€ 13.359	€	13.002
ausgegebene und umlaufende Anteile	483	1.253		1.286
NIW je Anteil	€ 11,43	€ 10,66	€	10,11
<b>Class R GBP (Hedged):</b>				
Erträge	k. A.	k. A.	£	33
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.		4
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£	9,40
<b>Class T:</b>				
thesaurierend	\$ 18.261	\$ 5.837	\$	5.056
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.525	526		490
NIW je Anteil	\$ 11,97	\$ 11,10	\$	10,31
<b>Class T EUR (Hedged):</b>				
thesaurierend	€ 6.041	€ 2.369	€	2.214
ausgegebene und umlaufende Anteile	560	233		228
NIW je Anteil	€ 10,79	€ 10,16	€	9,72

  

	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>Nettovermögen</b>	\$ 47.221	\$ 25.717	\$ 51.842
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 24.193	\$ 3.392	\$ 3.629
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.142	316	346
NIW je Anteil	\$ 11,30	\$ 10,75	\$ 10,49
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,21
<b>Institutional CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	k. A.	CHF 90	CHF 4.629
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	9	479
NIW je Anteil	k. A.	CHF 9,58	CHF 9,66
<b>Institutional EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 12.591	€ 6.134	€ 21.858
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.236	625	2.217
NIW je Anteil	€ 10,19	€ 9,82	€ 9,86

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Fortsetzung)</b>			
Erträge	k. A.	€ 1	€ 145
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	0*	15
NIW je Anteil	k. A.	€ 9,29	€ 9,56
<b>Institutional GBP (Hedged):</b>			
Erträge	k. A.	£ 281	£ 671
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	29	67
NIW je Anteil	k. A.	£ 9,78	£ 9,95
<b>Investor:</b>			
thesaurierend	k. A.	\$ 222	\$ 356
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	21	34
NIW je Anteil	k. A.	\$ 10,58	\$ 10,36
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 182
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	18
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,19
<b>Investor EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 37
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	4
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,73
<b>Class E:</b>			
thesaurierend	\$ 6.232	\$ 4.907	\$ 5.688
ausgegebene und umlaufende Anteile	586	479	563
NIW je Anteil	\$ 10,63	\$ 10,23	\$ 10,10
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 119
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	12
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,06
<b>Class E CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	k. A.	k. A.	CHF 110
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	12
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CHF 9,30
<b>Class E EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 1.136	€ 8.769	€ 9.287
ausgegebene und umlaufende Anteile	118	938	979
NIW je Anteil	€ 9,60	€ 9,35	€ 9,49
Erträge	k. A.	k. A.	€ 157
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	17
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,45
<b>Class E GBP (Hedged):</b>			
Erträge	k. A.	k. A.	£ 53
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	5
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 9,84
<b>Class R:</b>			
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,47
<b>Class R EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 38
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	4
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,83
<b>Class R GBP (Hedged):</b>			
Erträge	k. A.	k. A.	£ 55
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	6
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 9,95
<b>Class Z:</b>			
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 11
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 10,72
<b>UK Corporate Bond Fund</b>			
Nettovermögen	£ 764.359	£ 557.068	£ 386.886
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	£ 139.232	£ 130.226	£ 195.864
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.000	5.948	9.942
NIW je Anteil	£ 23,20	£ 21,89	£ 19,70

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>UK Corporate Bond Fund (Fortsetzung)</b>			
Erträge	£ 542.403	£ 337.842	£ 189.355
ausgegebene und umlaufende Anteile	49.002	31.617	19.184
NIW je Anteil	£ 11,07	£ 10,69	£ 9,87
<b>H Institutional:</b>			
Erträge	£ 9	£ 8	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,28	£ 9,90	k. A.
<b>Class R:</b>			
thesaurierend	k. A.	£ 1.224	£ 1.659
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	103	154
NIW je Anteil	k. A.	£ 11,94	£ 10,78
Erträge	k. A.	k. A.	£ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 10,25
<b>Class Z:</b>			
thesaurierend	£ 82.715	£ 87.768	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.715	8.715	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,72	£ 10,07	k. A.
<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>			
Nettovermögen	£ 364.631	£ 406.944	£ 372.630
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	£ 300.422	£ 284.640	£ 242.229
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.335	10.799	10.679
NIW je Anteil	£ 29,07	£ 26,36	£ 22,68
Erträge	£ 64.209	£ 122.304	£ 130.401
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.656	7.472	8.951
NIW je Anteil	£ 17,56	£ 16,37	£ 14,57
<b>US High Yield Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 4.054.927	\$ 2.798.116	\$ 2.496.388
<b>Institutional:</b>			
thesaurierend	\$ 2.254.396	\$ 1.370.126	\$ 1.169.729
ausgegebene und umlaufende Anteile	57.680	36.947	36.233
NIW je Anteil	\$ 39,09	\$ 37,08	\$ 32,28
Erträge	\$ 319.414	\$ 230.319	\$ 151.035
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.532	22.787	16.235
NIW je Anteil	\$ 10,13	\$ 10,11	\$ 9,30
<b>Institutional CHF (Hedged):</b>			
thesaurierend	CHF 2.604	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	218	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	CHF 11,94	k. A.	k. A.
<b>Institutional EUR (Hedged):</b>			
thesaurierend	€ 297.614	€ 158.249	€ 125.836
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.695	5.321	4.718
NIW je Anteil	€ 30,70	€ 29,74	€ 26,67
Erträge	€ 126.166	€ 223.796	€ 272.909
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.575	18.418	23.681
NIW je Anteil	€ 11,93	€ 12,15	€ 11,52
<b>Institutional GBP (Hedged):</b>			
thesaurierend	£ 41.967	£ 31.609	£ 56.623
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.809	1.407	2.841
NIW je Anteil	£ 23,20	£ 22,46	£ 19,93
Erträge	£ 7.216	£ 39.227	£ 37.593
ausgegebene und umlaufende Anteile	731	3.903	3.988
NIW je Anteil	£ 9,86	£ 10,05	£ 9,43
<b>Investor:</b>			
thesaurierend	\$ 307.813	\$ 201.992	\$ 217.767
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.760	6.038	7.451
NIW je Anteil	\$ 35,14	\$ 33,45	\$ 29,23
Erträge	\$ 31.926	\$ 32.462	\$ 20.600
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.897	3.972	2.739
NIW je Anteil	\$ 8,19	\$ 8,17	\$ 7,52

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>US High Yield Bond Fund (Fortsetzung)</b>			
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 3.819	€ 3.902	€ 2.394
ausgegebene und umlaufende Anteile	137	144	98
NIW je Anteil	€ 27,89	€ 27,12	€ 24,41
Class E:			
thesaurierend	\$ 203.678	\$ 172.590	\$ 122.146
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.947	5.264	4.241
NIW je Anteil	\$ 34,25	\$ 32,79	\$ 28,80
Erträge	\$ 103.491	\$ 82.307	\$ 82.015
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.577	7.636	8.267
NIW je Anteil	\$ 10,81	\$ 10,78	\$ 9,92
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 84.948	€ 93.411	€ 71.026
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.162	3.557	2.988
NIW je Anteil	€ 26,86	€ 26,26	€ 23,77
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 112.228	\$ 58.696	\$ 29.868
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.958	1.628	950
NIW je Anteil	\$ 37,94	\$ 36,05	\$ 31,44
Erträge	\$ 2.484	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	248	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,01	k. A.	k. A.
M Retail:			
Erträge	\$ 8.103	\$ 4.945	\$ 8.762
ausgegebene und umlaufende Anteile	740	453	872
NIW je Anteil	\$ 10,95	\$ 10,91	\$ 10,05
Class R:			
thesaurierend	\$ 4.885	\$ 4.074	\$ 9.278
ausgegebene und umlaufende Anteile	314	276	719
NIW je Anteil	\$ 15,54	\$ 14,78	\$ 12,90
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 895
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	95
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 9,40
Class R GBP (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	£ 1.066
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	117
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 9,08
Class Z:			
thesaurierend	\$ 9.208	\$ 8.688	\$ 23.183
ausgegebene und umlaufende Anteile	661	661	2.036
NIW je Anteil	\$ 13,93	\$ 13,15	\$ 11,39
<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 1.180.148	\$ 796.420	\$ 178.732
Institutional:			
thesaurierend	\$ 247.764	\$ 175.590	\$ 55.471
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.215	14.658	5.348
NIW je Anteil	\$ 12,89	\$ 11,98	\$ 10,37
Erträge	\$ 93.048	\$ 70.304	\$ 26.529
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.352	6.597	2.772
NIW je Anteil	\$ 11,14	\$ 10,66	\$ 9,57
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	CHF 238
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	24
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CHF 9,70
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 276.920	€ 173.359	€ 62.493
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.784	15.722	6.355
NIW je Anteil	€ 11,64	€ 11,03	€ 9,83
Erträge	k. A.	k. A.	€ 443
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	49
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,07

	Zum 31. Dez. 2020	Zum 31. Dez. 2019	Zum 31. Dez. 2018
<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund (Fortsetzung)</b>			
Institutional GBP (Hedged):			
ausschüttend II	£ 336.589	£ 268.019	£ 18.228
ausgegebene und umlaufende Anteile	33.002	26.906	1.993
NIW je Anteil	£ 10,20	£ 9,96	£ 9,15
Class E:			
thesaurierend	\$ 27.163	10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.503	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,85	10,17	k. A.
Erträge	\$ 13.248	\$ 862	\$ 986
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.170	80	103
NIW je Anteil	\$ 11,32	\$ 10,82	\$ 9,57
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 186
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	19
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,51
Erträge	k. A.	k. A.	€ 99
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	11
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,08
H Institutional:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 9,88
Erträge	k. A.	k. A.	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 9,39
<b>US Short-Term Fund</b>			
Nettovermögen	\$ 3.654.185	\$ 2.361.042	\$ 2.650.419
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.571.393	\$ 878.940	\$ 813.362
ausgegebene und umlaufende Anteile	138.207	79.029	75.227
NIW je Anteil	\$ 11,37	\$ 11,12	\$ 10,81
Erträge	\$ 197.384	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.443	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,15	k. A.	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 255.291	€ 170.508	€ 664.894
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.034	16.877	65.772
NIW je Anteil	€ 10,20	€ 10,10	€ 10,11
Investor:			
thesaurierend	\$ 21.612	\$ 43.210	\$ 34.304
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.945	3.961	3.223
NIW je Anteil	\$ 11,11	\$ 10,91	\$ 10,64
Class E:			
thesaurierend	\$ 558.194	\$ 490.262	\$ 313.853
ausgegebene und umlaufende Anteile	50.327	45.012	29.525
NIW je Anteil	\$ 11,09	\$ 10,89	\$ 10,63
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 11.970	€ 5.963	€ 13.552
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.208	605	1.369
NIW je Anteil	€ 9,91	€ 9,85	€ 9,90
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 14.591	\$ 2.772	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.394	270	1
NIW je Anteil	\$ 10,47	\$ 10,26	\$ 9,99
Class Z:			
Erträge	\$ 964.005	\$ 747.770	\$ 713.324
ausgegebene und umlaufende Anteile	94.476	74.061	70.784
NIW je Anteil	\$ 10,20	\$ 10,10	\$ 10,08

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter fünfhundert liegt.

## 20. RECHTSSTREITIGKEITEN UND AUFSICHTSRECHTLICHE ANGELEGENHEITEN

Die Gesellschaft ist nicht als Beklagte an wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schiedsverfahren 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.

## 21. KREDITFAZILITÄT

Der Global High Yield Bond Fund und der US High Yield Bond Fund (die „Fonds“ bzw. jeweils ein „Fonds“) 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 Fonds, 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 Fonds zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung auf USD 345.000.000. Die Fonds 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 Fonds 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 Fonds 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 Fonds ist auf die Vermögenswerte des betreffenden Fonds beschränkt.

Zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 hatte keiner der Fonds im Rahmen der Kreditvereinbarung Kredite in Anspruch genommen.

## 22. 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 31. Dezember 2020 hielten die Fonds 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 31. Dezember 2020 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	31. Dez. 2020	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
DBL	\$ 103	0,01
Pensionsgeschäfte		
SSB	1.302	0,15
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(1.523)	(0,17)
<b>Asia Strategic Interest Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
DBL	\$ 36	0,02
Pensionsgeschäfte		
SSB	1.299	0,78
<b>PIMCO Capital Securities Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (1.954)	(0,03)
Pensionsgeschäfte		
BOS	100.000	1,26
BPS	27.200	0,34
FICC	12.244	0,15
<b>Summe</b>	<b>139.444</b>	<b>1,75</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(184.841)	(2,32)
BPS	(1.525.666)	(19,18)
BRC	(196.717)	(2,47)
CFR	(1.538)	(0,02)
IND	(215.807)	(2,71)
SOG	(5.903)	(0,07)
<b>Summe</b>	<b>(2.130.472)</b>	<b>(26,77)</b>
<b>PIMCO Climate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 12.100	11,88
<b>Commodity Real Return Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 760	0,23
CBK	2.707	0,83
CIB	772	0,24
FBF	418	0,13
GST	2.294	0,70
JPM	2.294	0,70
MEI	715	0,22
SOG	19	0,01
<b>Summe</b>	<b>9.979</b>	<b>3,06</b>
Pensionsgeschäfte		
FICC	2.372	0,73
TDM	7.700	2,37
<b>Summe</b>	<b>10.072</b>	<b>3,10</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(126.586)	(38,94)
IND	(15.777)	(4,85)
SCX	(11.187)	(3,44)
<b>Summe</b>	<b>(153.550)</b>	<b>(47,23)</b>
<b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 495	0,34

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fonds	31. Dez. 2020	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
<b>Diversified Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 46.261	0,25
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(8.779)	(0,05)
BRC	(16.651)	(0,10)
CFR	(18.098)	(0,09)
JML	(25.308)	(0,13)
<b>Summe</b>	<b>(68.836)</b>	<b>(0,37)</b>
<b>Diversified Income Duration Hedged Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 11.970	0,81
NOM	27.200	1,83
<b>Summe</b>	<b>39.170</b>	<b>2,64</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(989)	(0,07)
<b>Dynamic Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 20.613	0,64
NOM	29.200	0,91
<b>Summe</b>	<b>49.813</b>	<b>1,55</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
RCY	(205.836)	(6,42)
<b>Dynamic Multi-Asset Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	€ (16)	0,00
BRC	0	0,00
<b>Summe</b>	<b>(16)</b>	<b>0,00</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	264.100	5,15
FICC	7.299	0,14
<b>Summe</b>	<b>271.399</b>	<b>5,29</b>
<b>Emerging Local Bond Fund</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (236.452)	(8,30)
JML	(197.657)	(6,93)
SCX	(36.358)	(1,28)
<b>Summe</b>	<b>(470.467)</b>	<b>(16,51)</b>
<b>Emerging Markets Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 3.386	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(57.446)	(1,09)
BRC	(11.990)	(0,22)
CFR	(4.536)	(0,09)
JML	(40.238)	(0,76)
MEI	(3.578)	(0,07)
SCX	(20.304)	(0,39)
<b>Summe</b>	<b>(138.092)</b>	<b>(2,62)</b>
<b>Emerging Markets Bond ESG Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 66.100	4,59
FICC	4.321	0,30
NOM	67.900	4,71
<b>Summe</b>	<b>138.321</b>	<b>9,60</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(36.538)	(2,54)
CFR	(358)	(0,02)
JML	(2.699)	(0,19)
SCX	(68.053)	(4,72)
TDM	(15.147)	(1,05)
<b>Summe</b>	<b>(122.795)</b>	<b>(8,52)</b>

Fonds	31. Dez. 2020	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 921	0,35
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(760)	(0,29)
GRE	(3.767)	(1,44)
<b>Summe</b>	<b>(4.527)</b>	<b>(1,73)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(2.338)	(0,89)
<b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 1.565	0,71
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(3.770)	(1,71)
<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 6.600	20,26
SSB	536	1,65
<b>Summe</b>	<b>7.136</b>	<b>21,91</b>
<b>Euro Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 143.300	4,42
FICC	4.355	0,13
<b>Summe</b>	<b>147.655</b>	<b>4,55</b>
<b>Euro Credit Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	€ 913	0,08
RYL	15.500	1,35
<b>Summe</b>	<b>16.413</b>	<b>1,43</b>
<b>Euro Income Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	€ 2.872	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CFR	(2.600)	(0,08)
<b>Euro Long Average Duration Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	€ 168	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(2.169)	(1,19)
<b>Euro Short-Term Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 7.600	0,94
RYL	55.300	6,85
<b>Summe</b>	<b>62.900</b>	<b>7,79</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(1.583)	(0,20)
<b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	€ 267	0,08
RYL	6.500	1,85
<b>Summe</b>	<b>6.767</b>	<b>1,93</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CFR	(1.020)	(0,29)
<b>Global Advantage Fund</b>		
Total Return Swaps		
IND	\$ (69)	(0,01)
Pensionsgeschäfte		
FICC	1.298	0,25
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(5.341)	(1,02)
CEW	(1.833)	(0,35)
GRE	(23.827)	(4,54)
IND	(7.776)	(1,48)
JML	(8.692)	(1,66)
<b>Summe</b>	<b>(47.469)</b>	<b>(9,05)</b>

Fonds	31. Dez. 2020		Fonds	31. Dez. 2020	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens		Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Global Advantage Fund (Fortsetzung)</b>			<b>PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Fortsetzung)</b>		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (8.792)	(1,68)	FICC	\$ 981	0,14
TDM	(3.703)	(0,70)			
<b>Summe</b>	<b>(12.495)</b>	<b>(2,38)</b>	<b>Global High Yield Bond Fund</b>		
<b>Global Bond Fund</b>			Total Return Swaps		
Total Return Swaps			BRC	\$ 1.238	0,02
CIB	\$ 8.147	0,05	GST	21.014	0,39
IND	(635)	0,00	<b>Summe</b>	<b>22.252</b>	<b>0,41</b>
<b>Summe</b>	<b>7.512</b>	<b>0,05</b>	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Pensionsgeschäfte			BRC	(6.699)	(0,12)
FICC	19.238	0,12	JPS	(779)	(0,02)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			<b>Summe</b>	<b>(7.478)</b>	<b>(0,14)</b>
BOM	(178.095)	(1,09)	<b>Global Investment Grade Credit Fund</b>		
BOS	(75.279)	(0,46)	Pensionsgeschäfte		
BPS	(57.978)	(0,35)	FICC	\$ 802	0,00
BSN	(114.030)	(0,70)	SAL	30.000	0,11
CIB	(264.492)	(1,62)	<b>Summe</b>	<b>30.802</b>	<b>0,11</b>
GRE	(29.317)	(0,18)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JML	(313.856)	(1,93)	BPS	(9.171)	(0,03)
RCY	(56.618)	(0,35)	BRC	(8.697)	(0,04)
SCX	(57.441)	(0,35)	CFR	(18.133)	(0,06)
SGY	(429.309)	(2,64)	JPS	(32.246)	(0,12)
<b>Summe</b>	<b>(1.576.415)</b>	<b>(9,67)</b>	TDM	(1.162)	0,00
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			<b>Summe</b>	<b>(69.409)</b>	<b>(0,25)</b>
BCY	(65.327)	(0,40)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(16.900)	(0,10)	BPG	(66.740)	(0,24)
MSC	(5.884)	(0,04)	<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund</b>		
<b>Summe</b>	<b>(88.111)</b>	<b>(0,54)</b>	Pensionsgeschäfte		
<b>Global Bond ESG Fund</b>			SSB	\$ 111	0,03
Pensionsgeschäfte			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 45.700	3,03	BOS	(1.276)	(0,38)
FICC	5.041	0,33	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
<b>Summe</b>	<b>50.741</b>	<b>3,36</b>	BOS	(505)	(0,15)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BPG	(2.568)	(0,78)
SCX	(25.562)	(1,69)	MSC	(15.585)	(4,69)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			<b>Summe</b>	<b>(18.658)</b>	<b>(5,62)</b>
TDM	(5.461)	(0,36)	<b>Global Libor Plus Bond Fund</b>		
Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
TDM	5.468	0,36	FICC	\$ 20.967	0,79
<b>Global Bond Ex-US Fund</b>			<b>Global Low Duration Real Return Fund</b>		
Total Return Swaps			Pensionsgeschäfte		
BOA	\$ (109)	(0,01)	FICC	\$ 1.551	0,20
CIB	365	0,04	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
GST	(56)	(0,01)	BPG	(66.936)	(8,49)
JPM	(14)	0,00	TDM	(212.825)	(27,02)
<b>Summe</b>	<b>186</b>	<b>0,02</b>	<b>Summe</b>	<b>(279.761)</b>	<b>(35,51)</b>
Pensionsgeschäfte			<b>Global Real Return Fund</b>		
FICC	1.069	0,11	Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			FICC	\$ 906	0,04
BPS	(66.331)	(7,13)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(5.073)	(0,55)	BOM	(235.237)	(9,12)
CEW	(9.124)	(0,98)	CIB	(96.470)	(3,74)
GRE	(30.025)	(3,23)	GRE	(334.648)	(12,98)
IND	(8.455)	(0,91)	IND	(48.308)	(1,88)
JML	(19.487)	(2,10)	SCX	(54.705)	(2,12)
RYL	(6.832)	(0,73)	<b>Summe</b>	<b>(769.368)</b>	<b>(29,84)</b>
<b>Summe</b>	<b>(145.327)</b>	<b>(15,63)</b>	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			BPG	(1.770)	(0,07)
BPG	(3.643)	(0,39)	<b>Income Fund</b>		
NOM	(3.867)	(0,42)	Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	<b>(7.510)</b>	<b>(0,81)</b>	FICC	\$ 14.587	0,02
<b>PIMCO Global Core Asset Allocation Fund</b>					
Total Return Swaps					
BRC	\$ 1	0,00			
FBF	3	0,00			
JPM	199	0,03			
<b>Summe</b>	<b>203</b>	<b>0,03</b>			

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fonds	31. Dez. 2020		Fonds	31. Dez. 2020	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens		Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
<b>Income Fund (Fortsetzung)</b>			<b>StocksPLUS™ Fund (Fortsetzung)</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BOM	\$ (522.479)	(0,74)	FICC	\$ 9.369	0,26
BPS	(128.797)	(0,18)	GSC	23.800	0,67
BRC	(135.115)	(0,18)	MFK	447.000	12,64
BSN	(627.356)	(0,88)	RVM	448.000	12,66
CIB	(1.090.836)	(1,53)	<b>Summe</b>	<b>928.169</b>	<b>26,23</b>
IND	(1.056.138)	(1,48)	<b>PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>		
NXN	(2.153.542)	(3,02)	Total Return Swaps		
RCY	(643.611)	(0,90)	BRC	\$ 68	0,81
SGY	(1.107.819)	(1,56)	FAR	15	0,18
TDM	(715.908)	(1,01)	GST	6	0,07
<b>Summe</b>	<b>(8.181.601)</b>	<b>(11,48)</b>	<b>Summe</b>	<b>89</b>	<b>1,06</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BPG	(44.153)	(0,06)	BPS	2.900	34,46
			SSB	139	1,65
			<b>Summe</b>	<b>3.039</b>	<b>36,11</b>
<b>Inflation Strategy Fund</b>			<b>Strategic Income Fund</b>		
Total Return Swaps			Pensionsgeschäfte		
BOA	\$ (257)	(0,36)	FICC	\$ 528	0,05
BPS	60	0,08	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CBK	19	0,03	GRE	(52.542)	(5,39)
FAR	(13)	(0,02)	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
FBF	0	0,00	BPG	(745)	(0,07)
GST	28	0,04	MSC	(1.729)	(0,18)
JPM	102	0,14	TDM	(392)	(0,04)
MYI	(180)	(0,26)	<b>Summe</b>	<b>(2.866)</b>	<b>(0,29)</b>
SOG	219	0,31	<b>Total Return Bond Fund</b>		
UBS	47	0,07	Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	<b>25</b>	<b>0,03</b>	BOS	\$ 114.400	1,78
Pensionsgeschäfte			FICC	5.063	0,08
SSB	571	0,82	RDR	8.200	0,13
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			SAL	8.500	0,13
GRE	(15.360)	(21,93)	<b>Summe</b>	<b>136.163</b>	<b>2,12</b>
<b>Low Average Duration Fund</b>			<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b>		
Pensionsgeschäfte			Total Return Swaps		
FICC	\$ 2.675	0,23	GST	\$ 56	0,12
RDR	5.600	0,47	Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	<b>8.275</b>	<b>0,70</b>	BOS	6.900	14,61
<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>			BPS	6.200	13,14
Pensionsgeschäfte			SSB	545	1,15
FICC	\$ 2.680	0,42	<b>Summe</b>	<b>13.645</b>	<b>28,90</b>
<b>Low Duration Income Fund</b>			<b>UK Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 7.000	0,73	FICC	£ 650	0,09
FICC	769	0,08	SCX	45.500	5,95
MBC	19.800	2,06	<b>Summe</b>	<b>46.150</b>	<b>6,04</b>
<b>Summe</b>	<b>27.569</b>	<b>2,87</b>	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>			BPS	(8.684)	(1,14)
Total Return Swaps			CEW	(15.853)	(2,07)
BOA	\$ (1.876)	(2,42)	JML	(4.287)	(0,56)
CBK	(431)	(0,55)	SCX	(21.644)	(2,83)
GST	(25)	(0,03)	<b>Summe</b>	<b>(50.468)</b>	<b>(6,60)</b>
MYI	(987)	(1,27)	<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>		
<b>Summe</b>	<b>(3.319)</b>	<b>(4,27)</b>	Pensionsgeschäfte		
<b>Mortgage Opportunities Fund</b>			FICC	£ 660	0,18
Pensionsgeschäfte			RYL	4.600	1,26
FICC	\$ 1.590	0,08	<b>Summe</b>	<b>5.260</b>	<b>1,44</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
TDM	(2.224)	(0,11)	BPS	(7.010)	(1,93)
<b>StocksPLUS™ Fund</b>			BRC	(302)	(0,08)
Total Return Swaps			CEW	(14.729)	(4,04)
BOA	\$ 20.694	0,58	IND	(10.548)	(2,89)
BPS	6.298	0,18	SCX	(37.855)	(10,38)
BRC	(36)	0,00	<b>Summe</b>	<b>(70.444)</b>	<b>(19,32)</b>
CBK	46.705	1,32			
FAR	18.938	0,53			
GST	(10)	0,00			
HUS	24.537	0,70			
<b>Summe</b>	<b>117.126</b>	<b>3,31</b>			

Fonds	31. Dez. 2020	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>US High Yield Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
BRC	\$ 2.649	0,07
GST	3.240	0,08
MYC	816	0,02
<b>Summe</b>	<b>6.705</b>	<b>0,17</b>
Pensionsgeschäfte		
BOS	12.700	0,31
FICC	2.200	0,05
GSC	12.400	0,31
TDM	3.500	0,09
<b>Summe</b>	<b>30.800</b>	<b>0,76</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(12.906)	(0,32)
JPS	(779)	(0,02)
RDR	(1.577)	(0,04)
<b>Summe</b>	<b>(15.262)</b>	<b>(0,38)</b>
<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>		
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)
<b>Summe</b>	<b>(42.596)</b>	<b>(3,61)</b>
<b>US Short-Term Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 208.500	5,71
FICC	4.734	0,13
<b>Summe</b>	<b>213.234</b>	<b>5,84</b>

Zum 31. Dezember 2019 hielten die Fonds 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 31. Dezember 2019 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	31. Dez. 2019	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 448	0,20
<b>Asia Strategic Interest Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 284	0,74
<b>PIMCO Capital Securities Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (339)	0,00
Pensionsgeschäfte		
BOS	150.000	1,89
BPS	332.700	4,18
FICC	6.400	0,08
SCX	500.000	6,30
<b>Summe</b>	<b>989.100</b>	<b>12,45</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(359.548)	(4,53)
BPS	(398.611)	(5,02)
CIW	(14.756)	(0,18)
FOB	(170.860)	(2,15)
IND	(91.519)	(1,15)
RDR	(14.957)	(0,19)
SCX	(107.959)	(1,36)
<b>Summe</b>	<b>(1.158.210)</b>	<b>(14,58)</b>

Fonds	31. Dez. 2019	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Commodity Real Return Fund</b>		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 598	0,11
CBK	1.655	0,29
CIB	227	0,04
FBF	114	0,02
GST	871	0,16
JPM	1.344	0,23
MEI	210	0,04
SOG	26	0,00
<b>Summe</b>	<b>5.045</b>	<b>0,89</b>
Pensionsgeschäfte		
FICC	988	0,18
SAL	28.100	4,97
<b>Summe</b>	<b>29.088</b>	<b>5,15</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SCX	(163.961)	(29,05)
<b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
JPM	\$ (412)	(0,28)
Pensionsgeschäfte		
FICC	848	0,57
<b>Diversified Income Fund</b>		
Total Return Swaps		
BRC	\$ 71	0,00
JPM	12	0,00
<b>Summe</b>	<b>83</b>	<b>0,00</b>
Pensionsgeschäfte		
BCY	34.700	0,28
BOS	615.300	5,01
BRC	75.000	0,61
FICC	8.135	0,07
JPS	600.000	4,88
NOM	71.800	0,58
RDR	26.700	0,22
RVM	1.300.000	10,60
<b>Summe</b>	<b>2.731.635</b>	<b>22,25</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(3.192)	(0,03)
BRC	(5.164)	(0,04)
JML	(20.861)	(0,17)
MEI	(1.801)	(0,01)
<b>Summe</b>	<b>(31.018)</b>	<b>(0,25)</b>
<b>Diversified Income Duration Hedged Fund</b>		
Total Return Swaps		
FBF	\$ 10	0,00
Pensionsgeschäfte		
BOS	76.600	6,03
FICC	8.508	0,67
NOM	50.800	4,00
<b>Summe</b>	<b>135.908</b>	<b>10,70</b>
<b>Dynamic Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 90.100	2,32
DEU	59.900	1,54
FICC	489	0,01
NOM	57.100	1,47
RDR	13.700	0,35
<b>Summe</b>	<b>221.289</b>	<b>5,69</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CFR	(3.043)	(0,08)
JML	(1.764)	(0,04)
<b>Summe</b>	<b>(4.807)</b>	<b>(0,12)</b>
<b>Dynamic Multi-Asset Fund</b>		
Total Return Swaps		
GST	€ (34)	0,00

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fonds	31. Dez. 2019		31. Dez. 2019	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Fonds</b>				
<b>Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)</b>				
Pensionsgeschäfte				
BPS	€ 7.600	0,47		
FICC	3.970	0,25		
<b>Summe</b>	<b>11.570</b>	<b>0,72</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				
BPS	(8.645)	(0,54)		
<b>Emerging Local Bond Fund</b>				
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				
BPS	\$ (343.360)	(12,39)		
BRC	(26.419)	(0,95)		
CFR	(61.461)	(2,22)		
FOB	(2.503)	(0,09)		
JML	(204.183)	(7,36)		
MBC	(90.621)	(3,27)		
NOM	(8.557)	(0,31)		
ULO	(3.664)	(0,13)		
<b>Summe</b>	<b>(740.768)</b>	<b>(26,72)</b>		
<b>Emerging Markets Bond Fund</b>				
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				
BOS	\$ (15.187)	(0,38)		
BPS	(73.254)	(1,83)		
CFR	(4.137)	(0,10)		
JML	(2.275)	(0,06)		
<b>Summe</b>	<b>(94.853)</b>	<b>(2,37)</b>		
<b>Emerging Markets Bond ESG Fund</b>				
Pensionsgeschäfte				
FICC	\$ 1.653	0,23		
NOM	54.500	7,52		
<b>Summe</b>	<b>56.153</b>	<b>7,75</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				
BPS	(32.654)	(4,51)		
MEI	(917)	(0,13)		
<b>Summe</b>	<b>(33.571)</b>	<b>(4,64)</b>		
<b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>				
Pensionsgeschäfte				
FICC	\$ 1.022	0,46		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				
BPS	(419)	(0,19)		
BRC	(743)	(0,33)		
<b>Summe</b>	<b>(1.162)</b>	<b>(0,52)</b>		
<b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b>				
Pensionsgeschäfte				
SSB	\$ 902	0,58		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				
BPS	(18.916)	(12,16)		
CFR	(574)	(0,37)		
<b>Summe</b>	<b>(19.490)</b>	<b>(12,53)</b>		
<b>Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund</b>				
Pensionsgeschäfte				
SSB	\$ 178	0,24		
<b>Euro Bond Fund</b>				
Pensionsgeschäfte				
BPS	€ 16.800	0,55		
FICC	1.400	0,05		
<b>Summe</b>	<b>18.200</b>	<b>0,60</b>		
<b>Euro Credit Fund</b>				
Pensionsgeschäfte				
FICC	€ 2.166	0,23		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				
JML	(2.129)	(0,22)		
<b>Euro Income Bond Fund</b>				
Pensionsgeschäfte				
FICC	€ 4.241	0,13		
<b>Fonds</b>				
<b>Euro Income Bond Fund (Fortsetzung)</b>				
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				
BRC	€ (397)	(0,01)		
CFR	(10.291)	(0,32)		
JML	(4.598)	(0,15)		
<b>Summe</b>	<b>(15.286)</b>	<b>(0,48)</b>		
<b>Euro Long Average Duration Fund</b>				
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				
GST	€ (2.328)	(1,43)		
<b>Euro Short-Term Fund</b>				
Pensionsgeschäfte				
FICC	€ 287	0,04		
<b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b>				
Pensionsgeschäfte				
FICC	€ 219	0,06		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				
BPS	(514)	(0,15)		
BRC	(462)	(0,13)		
CDC	(822)	(0,23)		
IND	(3.587)	(1,01)		
JML	(9.150)	(2,60)		
RYL	(1.527)	(0,43)		
<b>Summe</b>	<b>(16.062)</b>	<b>(4,55)</b>		
<b>Global Advantage Fund</b>				
Total Return Swaps				
BRC	\$ (287)	(0,06)		
GST	(76)	(0,02)		
IND	13	0,00		
MYI	17	0,01		
SOG	9	0,00		
<b>Summe</b>	<b>(324)</b>	<b>(0,07)</b>		
Pensionsgeschäfte				
FICC	2.818	0,60		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				
BPS	(5.193)	(1,11)		
GRE	(34.312)	(7,34)		
IND	(42.069)	(9,00)		
<b>Summe</b>	<b>(81.574)</b>	<b>(17,45)</b>		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte				
BPG	(8.380)	(1,79)		
BPS	(6.998)	(1,50)		
TDM	(2.233)	(0,48)		
<b>Summe</b>	<b>(17.611)</b>	<b>(3,77)</b>		
<b>Global Advantage Real Return Fund</b>				
Pensionsgeschäfte				
SSB	\$ 383	1,06		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte				
BPS	(1.266)	(3,49)		
IND	(9.037)	(24,95)		
JML	(1.129)	(3,12)		
SCX	(4.761)	(13,13)		
UBS	(1.175)	(3,24)		
<b>Summe</b>	<b>(17.368)</b>	<b>(47,93)</b>		
<b>Global Bond Fund</b>				
Total Return Swaps				
BRC	\$ (5.652)	(0,04)		
CIB	2.628	0,02		
GST	(1.897)	(0,01)		
IND	203	0,00		
MYI	572	0,00		
<b>Summe</b>	<b>(4.146)</b>	<b>(0,03)</b>		
Pensionsgeschäfte				
FICC	119.307	0,80		
RDR	28.600	0,19		
<b>Summe</b>	<b>147.907</b>	<b>0,99</b>		

Fonds	31. Dez. 2019		Fonds	31. Dez. 2019	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens		Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
<b>Global Bond Fund (Fortsetzung)</b>			<b>Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)</b>		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (7.966)	(0,06)	BCY	\$ 13.900	0,32
BRC	(529)	0,00	BOS	50.000	1,15
GRE	(147.188)	(0,97)	BPS	7.300	0,17
IND	(217.817)	(1,45)	JPS	50.000	1,15
MEI	(8.496)	(0,06)	SAL	12.100	0,28
RCY	(127.622)	(0,85)	RVM	100.000	2,30
SCX	(257.618)	(1,72)	<b>Summe</b>	<b>233.300</b>	<b>5,37</b>
SGY	(1.138)	(0,01)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	<b>(768.374)</b>	<b>(5,12)</b>	BCY	(6.301)	(0,14)
<b>Global Bond ESG Fund</b>			BRC	(4.423)	(0,11)
Total Return Swaps			CFR	(2.979)	(0,07)
MYI	\$ 45	0,01	<b>Summe</b>	<b>(13.703)</b>	<b>(0,32)</b>
Pensionsgeschäfte			Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
FICC	1.980	0,26	BCY	(13.909)	(0,32)
RDR	23.900	3,13	<b>Global Investment Grade Credit Fund</b>		
<b>Summe</b>	<b>25.880</b>	<b>3,39</b>	Pensionsgeschäfte		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BCY	\$ 437.600	1,99
BPS	(26.945)	(3,53)	BPS	8.900	0,04
MYI	(7.136)	(0,94)	FICC	1.725	0,01
<b>Summe</b>	<b>(34.081)</b>	<b>(4,47)</b>	<b>Summe</b>	<b>448.225</b>	<b>2,04</b>
<b>Global Bond Ex-US Fund</b>			Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
Total Return Swaps			BPS	(10.170)	(0,04)
BRC	\$ (207)	(0,02)	BRC	(14.169)	(0,06)
FBF	(131)	(0,01)	CIB	(223.830)	(1,02)
GST	(159)	(0,02)	JML	(2.647)	(0,01)
MYC	(117)	(0,01)	NXN	(720.362)	(3,29)
<b>Summe</b>	<b>(614)</b>	<b>(0,06)</b>	RCY	(252.179)	(1,15)
Pensionsgeschäfte			SCX	(82.718)	(0,38)
BPS	4.900	0,45	<b>Summe</b>	<b>(1.306.075)</b>	<b>(5,95)</b>
FICC	706	0,06	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
<b>Summe</b>	<b>5.606</b>	<b>0,51</b>	BCY	(500.520)	(2,28)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			BPG	(8.902)	(0,04)
GRE	(27.903)	(2,56)	<b>Summe</b>	<b>(509.422)</b>	<b>(2,32)</b>
IND	(72.971)	(6,68)	<b>Global Investment Grade Credit ESG Fund</b>		
MYI	(2.127)	(0,19)	Pensionsgeschäfte		
RYL	(19.789)	(1,81)	SSB	\$ 1.600	1,91
<b>Summe</b>	<b>(122.790)</b>	<b>(11,24)</b>	Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			MSC	(1.277)	(1,52)
BPG	(4.946)	(0,45)	<b>Global Libor Plus Bond Fund</b>		
TDM	(1.164)	(0,11)	Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	<b>(6.110)</b>	<b>(0,56)</b>	FICC	\$ 7.217	0,36
<b>PIMCO Global Core Asset Allocation Fund</b>			NOM	6.900	0,34
Total Return Swaps			<b>Summe</b>	<b>14.117</b>	<b>0,70</b>
BPS	\$ (449)	(0,06)	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
FBF	4	0,00	SCX	(31.167)	(1,55)
GST	(531)	(0,06)	<b>Global Low Duration Real Return Fund</b>		
JPM	(994)	(0,12)	Pensionsgeschäfte		
MEI	9.264	1,13	FICC	\$ 1.884	0,19
MYI	29	0,00	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
<b>Summe</b>	<b>7.323</b>	<b>0,89</b>	BPS	(92.921)	(9,32)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			CIB	(111.292)	(11,15)
IND	(33.077)	(4,06)	RDR	(26.946)	(2,70)
<b>Global High Yield Bond Fund</b>			<b>Summe</b>	<b>(231.159)</b>	<b>(23,17)</b>
Total Return Swaps			<b>Global Real Return Fund</b>		
BRC	\$ 1.918	0,04	Pensionsgeschäfte		
FBF	283	0,01	FICC	\$ 1.277	0,07
GST	339	0,01	Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JPM	299	0,01	BPS	(98.586)	(5,38)
<b>Summe</b>	<b>2.839</b>	<b>0,07</b>	IND	(175.977)	(9,61)
			GRE	(60.912)	(3,33)
			RYL	(13.832)	(0,76)
			SCX	(317.718)	(17,34)
			<b>Summe</b>	<b>(667.025)</b>	<b>(36,42)</b>

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fonds	31. Dez. 2019	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
<b>Income Fund</b>		
Total Return Swaps		
BRC	\$ 852	0,00
FBF	534	0,00
JPM	1.950	0,01
MYC	692	0,00
SOG	(84)	0,00
<b>Summe</b>	<b>3.944</b>	<b>0,01</b>
Pensionsgeschäfte		
BCY	172.200	0,21
FICC	31.848	0,04
<b>Summe</b>	<b>204.048</b>	<b>0,25</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(13.077)	(0,02)
CDC	(485.914)	(0,60)
CFR	(13.405)	(0,02)
FOB	(2.786)	0,00
RCY	(1.818.207)	(2,24)
SGY	(48.884)	(0,06)
<b>Summe</b>	<b>(2.382.273)</b>	<b>(2,94)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BCY	(172.189)	(0,21)
<b>Inflation Strategy Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 106	0,15
BPS	(26)	(0,04)
CBK	1	0,01
FAR	0	0,00
GST	(146)	(0,21)
JPM	44	0,06
MYI	28	0,04
UBS	141	0,20
<b>Summe</b>	<b>148</b>	<b>0,21</b>
Pensionsgeschäfte		
SSB	584	0,83
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(17.058)	(24,36)
<b>Low Average Duration Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 3.156	0,27
NOM	49.400	4,15
<b>Summe</b>	<b>52.556</b>	<b>4,42</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(18.002)	(1,51)
IND	(78.837)	(6,63)
GRE	(6.758)	(0,57)
SCX	(52.464)	(4,41)
<b>Summe</b>	<b>(156.061)</b>	<b>(13,12)</b>
<b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BCY	\$ 11.900	2,33
FICC	700	0,14
<b>Summe</b>	<b>12.600</b>	<b>2,47</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(39.385)	(7,72)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BCY	(11.922)	(2,34)
<b>Low Duration Income Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 5.229	1,09
MBC	50.600	10,57
<b>Summe</b>	<b>55.829</b>	<b>11,66</b>

Fonds	31. Dez. 2019	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 2.122	0,90
CBK	(67)	(0,03)
FAR	76	0,03
GST	(40)	(0,02)
MYI	84	0,04
<b>Summe</b>	<b>2.175</b>	<b>0,92</b>
<b>Mortgage Opportunities Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.040	0,12
NOM	48.400	2,89
<b>Summe</b>	<b>50.440</b>	<b>3,01</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(411.291)	(24,56)
CIB	(4.058)	(0,24)
CSN	(25.176)	(1,50)
SCX	(9.824)	(0,59)
WFS	(18.974)	(1,13)
<b>Summe</b>	<b>(469.323)</b>	<b>(28,02)</b>
<b>StocksPLUS™ Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 17.158	0,57
BPS	3.261	0,11
BRC	5.136	0,17
CBK	2.772	0,09
FAR	6.702	0,22
GST	14.501	0,48
HUS	12.820	0,43
<b>Summe</b>	<b>62.350</b>	<b>2,07</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	106.100	3,53
FICC	4.826	0,16
MPK	800.000	26,58
RVM	200.000	6,64
<b>Summe</b>	<b>1.110.926</b>	<b>36,91</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JML	(3.313)	(0,11)
<b>PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 0	0,00
GST	353	5,91
<b>Summe</b>	<b>353</b>	<b>5,91</b>
Pensionsgeschäfte		
BPS	800	13,38
SSB	169	2,83
<b>Summe</b>	<b>969</b>	<b>16,21</b>
<b>Strategic Income Fund</b>		
Total Return Swaps		
BRC	\$ 6	0,00
FBF	6	0,00
MYC	12	0,00
<b>Summe</b>	<b>24</b>	<b>0,00</b>
Pensionsgeschäfte		
FICC	3.161	0,27
<b>Total Return Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
FBF	\$ (37)	0,00
Pensionsgeschäfte		
FICC	4.932	0,10
NOM	80.900	1,57
RDR	8.300	0,16
<b>Summe</b>	<b>94.132</b>	<b>1,83</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(635.626)	(12,36)
IND	(348.006)	(6,78)
SOG	(79.543)	(1,55)
<b>Summe</b>	<b>(1.063.175)</b>	<b>(20,69)</b>

Fonds	31. Dez. 2019	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
<b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 4.600	17,89
SSB	541	2,10
<b>Summe</b>	<b>5.141</b>	<b>19,99</b>
<b>UK Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BRC	£ 26.700	4,79
FICC	1.175	0,21
<b>Summe</b>	<b>27.875</b>	<b>5,00</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CFR	(320)	(0,06)
IND	(15.312)	(2,75)
SCX	(11.037)	(1,98)
<b>Summe</b>	<b>(26.669)</b>	<b>(4,79)</b>
<b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 1.319	0,32
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(2.714)	(0,67)
IND	(55.326)	(13,60)
JML	(1.447)	(0,35)
RYL	(1.726)	(0,42)
SCX	(44.148)	(10,85)
<b>Summe</b>	<b>(105.361)</b>	<b>(25,89)</b>
<b>US High Yield Bond Fund</b>		
Total Return Swaps		
BRC	\$ 313	0,01
FBF	171	0,01
GST	999	0,03
<b>Summe</b>	<b>1.483</b>	<b>0,05</b>
Pensionsgeschäfte		
BCY	18.900	0,68
FICC	2.868	0,10
<b>Summe</b>	<b>21.768</b>	<b>0,78</b>
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BCY	(5.036)	(0,18)
BRC	(4.258)	(0,15)
<b>Summe</b>	<b>(9.294)</b>	<b>(0,33)</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BCY	(18.876)	(0,67)
<b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 51.400	6,45
FICC	549	0,07
<b>Summe</b>	<b>51.949</b>	<b>6,52</b>
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(51.383)	(6,45)
<b>US Short-Term Fund</b>		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.457	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(293.303)	(12,42)
GRE	(24.426)	(1,04)
RCY	(108.400)	(4,59)
<b>Summe</b>	<b>(426.129)</b>	<b>(18,05)</b>

**(b) Sicherheiten****(i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:**

Die zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 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 31. Dezember 2020 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	Zum 31. Dez. 2020	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000\$)
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 von Belgien	€ 179.205
	Europäische Investitionsbank	36.820
	Landwirtschaftliche Rentenbank	53.152
Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	7.445
Emerging Markets Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 4.213
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 von Belgien	€ 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 von Belgien	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
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

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fonds	Zum 31. Dez. 2020	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
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	United Kingdom Government	£ 45.728
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	663
UK Long Term Corporate Bond Fund	United Kingdom Government	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

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2019 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	Zum 31. Dez. 2019	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 457
Asia Strategic Interest Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	290
PIMCO Capital Securities Fund	Credit Suisse Group AG	1.081
	JPMorgan Chase & Co.	2.110
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.011.629
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	29.691
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	867
Diversified Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.788.179
Diversified Income Duration Hedged Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	138.578
Dynamic Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	225.685
Dynamic Multi-Asset Fund	Germany Government	€ 7.722
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	4.054
Emerging Local Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 127
Emerging Markets Bond Fund	Sinopec Group Overseas Development Ltd.	393
Emerging Markets Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	57.109
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.043
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	920
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	182

Fonds	Zum 31. Dez. 2019	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
Euro Bond Fund	Germany Government	€ 16.863
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.433
Euro Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.210
Euro Income Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	4.328
Euro Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	293
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	225
Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 2.876
Global Advantage Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	391
Global Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	150.903
Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	26.423
Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	5.720
Global High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	238.265
Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	457.688
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.632
Global Libor Plus Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	14.384
Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.927
Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.306
Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	208.204
	United Overseas Bank Ltd.	270
Inflation Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	596
Low Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	53.454
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	12.867
Low Duration Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	57.568
Mortgage Opportunities Fund	Fannie Mae	324
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	51.312
StocksPLUS™ Fund	Ginnie Mae	109.229
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.024.023
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	989
Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.227
Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	95.774
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	5.247
UK Corporate Bond Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	£ 26.879
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.202
UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.347
US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 22.218
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	52.964
US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.487

### (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 31. Dezember 2020 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland 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	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Capital Securities Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	22.750	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury	Treasury	27.810	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Inflation Protected Securities							
		U.S. Treasury Bills	Treasury	12.489	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	102.407	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	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	Schweiz	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	73.081	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.506	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Climate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	\$ 12.400	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Commodity Real Return Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	380	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	670	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	270	k. A.	k. A.	USD	Schweiz	FED, Bilateral	
	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	6.110	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.419	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	7.942	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.725	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	505	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	47.186	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	498	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Schweiz	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	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	Japan	FED, Bilateral
	U.S. Treasury Bills	Treasury	12.209	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Dynamic Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	29.917	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Japan	FED, Bilateral
	U.S. Treasury Bills	Treasury	21.025	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	423	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	€ 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	Corporate	53.152	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
	U.S. Treasury Bills	Treasury	7.445	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Emerging Local Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 2.200	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	3.454	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	369	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Schweiz	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	390	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.982	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	258	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	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	Japan	FED, Bilateral	
	U.S. Treasury Bills	Treasury	4.407	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	620	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	940	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.596	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	260	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
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	Vereinigte Staaten	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	Vereinigte Staaten	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	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.929	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	666	k. A.	k. A.	USD	Schweiz	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	172	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	Belgium Government International Bond	Treasury	€ 7.614	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Netherlands Government International Bond	Treasury	55.268	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	Netherlands Government International Bond	Treasury	6.496	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	273	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Swap-Kontrakte	U.S. Treasury Bills	Treasury	\$ 1.324	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	9.310	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	19.623	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	27.703	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.772	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	616	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	224	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.212	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	458	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.208	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	46.725	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund		U.S. Treasury Bills	Treasury	5.142	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.090	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	300	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	430	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	572	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.790	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.001	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.114	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	20.890	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	20.890	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	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	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	30.612	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	10	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	874	k. A.	k. A.	USD	Schweiz	FED, Bilateral
	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	696	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	113	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Labor Plus Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	21.386	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.582	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	924	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	4.868	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.874	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	471	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	5.678	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	14.879	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Income Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	1.488	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	9.642	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	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	Schweiz	FED, Bilateral
		UniCredit SpA Unternehmensanleihen		3.394	BBB-	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	264	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.790	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	4.865	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	10.234	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing	
Inflation Strategy Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 60	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	582	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	5.719	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bills	Treasury	2.729	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.734	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	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	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	7.142	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.621	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
StocksPLUS™ Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	10.220	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	18.330	k. A.	k. A.	USD	Hongkong	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.817	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	139.628	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	458.089	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Portugal	FED, Bilateral	
		Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	24.845	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	457.384	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bills	Treasury	9.556	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	227	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
	PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	280	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
			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
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	142	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bills	Treasury	539	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	8.377	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bills	Treasury	5.164	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	117.015	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	8.674	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	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	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	7.040	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	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	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	206	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
UK Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	198	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	752	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		United Kingdom Gilt	Treasury	4.609	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	FED, Bilateral	
US High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	673	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.502	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 2.610	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.760	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	12.944	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bills	Treasury	2.244	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	16.538	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.412	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	2.945	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	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	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2019 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 457	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Asia Strategic Interest Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	290	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Capital Securities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	340.544	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	511.055	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	6.532	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	153.498	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Credit Suisse Group AG	Unternehmensanleihen	382	BBB+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Credit Suisse Group AG	Unternehmensanleihen	699	BBB+	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		JPMorgan Chase & Co.	Unternehmensanleihen	2.110	A-	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	750	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.531	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	330	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Commodity Real Return Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	800	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	260	k. A.	k. A.	USD	Schweiz	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	6.640	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.010	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	28.681	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	870	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	867	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.870	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	90	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	27.287	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	73.026	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Japan	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	1.438.657	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	1.240.910	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	8.299	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	380	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Diversified Income Duration Hedged Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	51.667	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Japan	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	78.228	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	8.683	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	13.994	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	61.241	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	58.061	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Japan	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	91.890	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	499	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	580	k. A.	k. A.	USD	Schweiz	FED, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Pensionsgeschäfte	Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	€ 7.722	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	4.054	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Local Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	\$ 127	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	5.965	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Sinopac Group Overseas Development Ltd.	Unternehmensanleihen	393	A+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	340	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	55.418	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Japan	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.691	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	270	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.043	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	920	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 182	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	€ 16.863	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.433	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.210	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	4.328	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	293	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	225	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Advantage Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 1.690	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.280	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.876	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Advantage Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	391	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.690	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	4.150	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	39.310	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	29.209	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	121.694	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	9.355	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.321	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.860	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	24.403	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.020	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	280	k. A.	k. A.	USD	Schweiz	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	360	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	750	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	4.995	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	725	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	340	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	13.350	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	9.140	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.380	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	300	k. A.	k. A.	USD	Schweiz	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.710	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	680	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	7.472	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	116.262	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	102.170	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	12.361	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	9.073	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	446.273	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.762	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	580	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	615	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.632	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Libor Plus Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	7.018	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Japan	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	7.366	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.927	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	271	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.306	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	4.709	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	807	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral

## Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing	
Income Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 3.100	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	11.210	k. A.	k. A.	USD	Schweiz	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	116.760	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	29.227	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	175.715	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	32.489	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	United Overseas Bank Ltd.	Unternehmensanleihen	270	AA-	3 Monate - 1 Jahr	USD	Schweiz	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.946	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
Barsicherheiten		Zahlungsmittel	170	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
Inflation Strategy Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	270	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	596	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	50.232	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Japan	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	3.222	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	7.680	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	540	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	12.148	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	719	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Duration Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	52.233	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.520	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	49.226	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Japan	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.086	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	324	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
StocksPLUS™ Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	39.900	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	11.850	k. A.	k. A.	USD	Hongkong	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	4.770	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	60.130	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	109.229	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	815.807	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Portugal	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	203.292	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	4.924	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	290	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	817	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	172	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	80	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	3.227	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	8.479	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	82.262	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Japan	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	5.033	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	4.695	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	552	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	United Kingdom Gilt	Treasury	£ 26.879	AAA	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.202	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
UK Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.347	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
US High Yield Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 260	k. A.	k. A.	USD	Schweiz	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	310	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	890	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	19.292	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.926	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	52.399	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	565	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral	
US Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.487	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	

Der Marktwert der Sicherheiten für Pensionsgeschäfte umfasst keine aufgelaufenen 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 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 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.

### (c) Rendite/Kosten

Die nachfolgenden Tabellen liefern detaillierte Angaben zur Rendite und den Kosten jeder Art von SFT und Total Return Swap für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019. Die Beträge sind in der Basiswährung der Fonds ausgewiesen.

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

### (iv) Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Als Sicherheiten erhaltene Wertpapiere wurden zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 nicht wiederverwendet.

Die zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 erhaltenen Sicherheiten wurden im Depotbanknetz der State Street Bank and Trust gehalten.

### (v) Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Die von den Fonds zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 verpfändeten Sicherheiten werden von den Kontrahenten in Konten gehalten, bei denen es sich nicht um getrennte oder Sammelkonten handelt.

Fonds	31. Dez. 2020							
	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 Asia High Yield Bond Fund	\$ 6	\$ 0	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Asia Strategic Interest Bond Fund	1	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO Capital Securities Fund	2.536	35	1.515	10.445	0	0	0	0
PIMCO Climate Bond Fund	2	0	0	0	0	0	0	0
Commodity Real Return Fund	9	0	0	995	0	0	0	13
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	9	0	0	0	0	0	0	0
Diversified Income Fund	3.154	216	8.242	65	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	211	0	28	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	226	0	29	347	0	0	0	19
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 9	€ 347	€ 12	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Emerging Local Bond Fund	\$ 73	\$ 0	\$ 1	\$ 11.691	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Emerging Markets Bond Fund	35	0	2	1.687	0	0	0	1
Emerging Markets Bond ESG Fund	226	0	8	672	0	0	0	0
Emerging Markets Corporate Bond Fund	7	0	16	13	0	0	0	11
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	5	0	4	163	0	0	0	0
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	21	0	0	0	0	0	0	0
Euro Bond Fund	€ 3	€ 168	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	4	113	60	0	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	11	171	371	0	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	0	0	1	7	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	1	258	1	0	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	0	51	0	0	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	1	35	14	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	\$ 3	\$ 0	\$ 95	\$ 214	\$ 14	\$ 0	\$ 0	\$ 32
Global Advantage Real Return Fund	1	0	0	5	0	0	0	0
Global Bond Fund	489	0	563	3.010	0	2	0	44
Global Bond ESG Fund	157	0	27	75	0	1	0	3
Global Bond Ex-US Fund	7	0	418	292	0	0	0	23
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	55	0	0	53	0	0	85	0
Global High Yield Bond Fund	137	0	14	15	0	0	0	2
Global Investment Grade Credit Fund	388	0	0	8.871	0	0	0	433
Global Investment Grade Credit ESG Fund	4	0	1	3	0	0	3	10
Global Libor Plus Bond Fund	130	0	3	53	0	0	0	9
Global Low Duration Real Return Fund	3	0	45	192	0	99	0	1.409
Global Real Return Fund	8	0	100	3.232	0	1	0	15
Income Fund	513	3	31	66.931	2	74	0	1.639
Inflation Strategy Fund	1	0	0	102	0	0	0	7
Low Average Duration Fund	106	0	0	421	0	0	0	1
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	13	0	0	31	0	0	0	3
Low Duration Income Fund	166	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	4	0	0	0	0	0	0	0
Mortgage Opportunities Fund	80	0	0	1.600	0	0	0	7
StocksPLUS™ Fund	2.917	0	0	1	0	0	0	0

# Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

31. Dez. 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 StocksPLUS™ AR Fund	\$ 8	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Strategic Income Fund	4	0	0	16	0	0	0	6
Total Return Bond Fund	311	0	120	2.334	0	3	0	25
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	26	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	12	0	19	495	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	\$ 192	\$ 0	\$ 55	\$ 7	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
US Investment Grade Corporate Bond Fund	9	0	18	80	0	0	0	48
US Short-Term Fund	107	11	1	1.024	0	0	0	170

31. Dez. 2019

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 Asia High Yield Bond Fund	\$ 26	\$ 0	\$ 0	\$ 32	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Asia Strategic Interest Bond Fund	5	0	0	8	0	0	0	0
PIMCO Capital Securities Fund	19.275	37	81	23.343	0	0	0	0
Commodity Real Return Fund	171	0	0	4.674	0	3	0	46
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	179	0	0	1	0	0	1	14
Diversified Income Fund	18.156	14	269	37	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	1.767	0	0	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	4.720	0	0	592	0	0	0	7
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 112	€ 220	€ 3	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Emerging Local Bond Fund	\$ 214	\$ 0	\$ 54	\$ 5.850	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Emerging Markets Bond Fund	143	0	11	426	0	0	1	5
Emerging Markets Bond ESG Fund	243	0	0	209	0	0	0	0
Emerging Markets Corporate Bond Fund	20	0	0	88	0	0	0	34
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	37	0	0	83	0	0	0	0
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	96	0	0	0	0	0	0	0
Euro Bond Fund	€ 37	€ 290	€ 10	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	33	36	65	0	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	83	573	370	0	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	4	17	28	0	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	6	194	1	0	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	3	11	12	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	\$ 34	\$ 0	\$ 156	\$ 1.595	\$ 0	\$ 13	\$ 0	\$ 126
Global Advantage Real Return Fund	19	0	19	304	0	1	0	52
Global Bond Fund	912	0	54	5.684	0	2	0	91
Global Bond ESG Fund	436	0	30	205	0	0	0	134
Global Bond Ex-US Fund	39	0	174	1.046	0	0	0	241
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	404	0	20	2.169	0	1	0	70
Global High Yield Bond Fund	4.426	0	67	365	0	0	0	13
Global Investment Grade Credit Fund	2.123	0	439	23.506	0	29	41	2.870
Global Investment Grade Credit ESG Fund	38	2	0	9	16	1	0	5
Global Libor Plus Bond Fund	1.293	0	0	82	0	3	0	20
Global Low Duration Real Return Fund	46	0	41	211	159	938	0	8.549
Global Real Return Fund	56	0	99	11.428	0	5	1	203
Income Fund	6.300	52	363	96.943	0	6	62	1.452
Inflation Strategy Fund	10	0	0	252	0	0	0	96
Low Average Duration Fund	254	0	0	5.819	0	3	0	153
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	35	0	0	1.044	0	2	0	522
Low Duration Income Fund	853	0	0	5	0	0	0	1
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	45	0	0	0	0	0	0	0
Mortgage Opportunities Fund	326	0	0	13.174	24	25	1	1.319
StocksPLUS™ Fund	12.312	0	0	17	0	0	0	0
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	18	0	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	37	0	0	155	0	3	0	43
Total Return Bond Fund	311	0	58	10.887	0	2	1	607
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	76	0	0	1	0	0	0	0
UK Corporate Bond Fund	£ 50	£ 0	£ 11	£ 270	£ 0	£ 0	£ 5	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	29	0	5	917	0	0	5	0

31. Dez. 2019

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)
US High Yield Bond Fund	\$ 5.015	\$ 0	\$ 19	\$ 512	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 7
US Investment Grade Corporate Bond Fund	44	0	0	484	37	9	3	451
US Short-Term Fund	53	28	0	3.903	0	9	1	1.049

Alle Renditen aus SFT-Derivatgeschäften laufen zugunsten des Fonds auf und fallen nicht unter Ertragsteuervereinbarungen mit der Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft oder sonstigen Dritten.

For 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.

### 23. WESENTLICHE EREIGNISSE

Seit Januar 2020 haben die globalen Finanzmärkte aufgrund der Ausbreitung eines 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 Marktsicherheit geführt. Die Auswirkungen von COVID-19 haben negative Folgen für die Weltwirtschaft die Volkswirtschaften verschiedener Länder und einzelne Emittenten, die möglicherweise anhalten werden.

Am 17. Januar 2020 wurde der Euro Low Duration Fund in PIMCO European Short-Term Opportunities Fund umbenannt.

Am 30. Januar 2020 und am 06. August 2020 wurden zwei separate Zeichnungen über 5.500.000 USD und 5.000.000 USD durch die Verwaltungsgesellschaft im US Short-Term Fund getätigt.

Am 31. Januar 2020 verließ das Vereinigte Königreich formal die EU („Brexit“). Am selben Tag wurden der PIMCO European High Yield Bond Fund und der Global Advantage Real Return Fund abgewickelt.

Am 03. April 2020 verkaufte der Income Fund Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 153.125.758 an die Körperschaft.

Am 20. April 2020 wurde eine Rücknahme in Höhe von USD 15.000.000 im US Short-Term Fund von der Verwaltungsgesellschaft durchgeführt.

Am 11. August 2020 wurde der Verkaufsprospekt der Gesellschaft aktualisiert und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

Am 12. August 2020 wurde für den Diversified Income Fund, den Global Bond Fund und den Global Investment Grade Credit Fund eine neue Anteilsklassenart, die Class W, aufgelegt.

Am 28. August 2020 wurde der Emerging Asia Bond Fund in Asia Strategic Interest Bond Fund umbenannt und das Hauptanlageziel des Fonds wurde geändert.

Am 23. September 2020 wurde der PIMCO Climate Bond Fund aufgelegt.

Am 27. Oktober 2020 wurde der Verkaufsprospekt der Gesellschaft aktualisiert und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

Am 20. November 2020 wurden der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund, der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund, der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund und der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund aufgelöst.

Am 23. November 2020 wurden der PIMCO RAE Emerging Markets Fund, der PIMCO RAE Europe Fund, der PIMCO RAE Global Developed Fund und der PIMCO RAE US Fund aufgelöst.

Am 10. Dezember 2020 wurde der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für den Low Duration Income Fund für alle Klassen bis zum 01. Januar 2023 verlängert.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Geschäftsjahres keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

### 24. EREIGNISSE NACH ABSCHLUSS DES BERICHTSZEITRAUMS

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 1. April 2021 wurde PIMCO Europe GmbH als Unter-Anlageberatungsgesellschaft für die vorstehend genannten Fonds sowie für den PIMCO Climate Bond Fund und den Income Fund II ernannt.

Am 29. Januar 2021 wurde der Income Fund II aufgelegt.

Am 09. März 2021 wurden der Prospekt der Gesellschaft sowie die Prospektergänzungen gemäß der Offenlegungsverordnung (EU) 2019/2088 („SFDR“) aktualisiert und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen. Außerdem wurden zu diesem Termin die Anlageziele des Emerging Markets Bond ESG Fund, des Global Bond ESG Fund und des Global Investment Grade Credit ESG Fund geändert, um nachhaltige Anlagen aufzunehmen und somit gezielt nachhaltige Investitionen anzustreben.

Am 23. April 2021 wurde eine Rücknahme in Höhe von USD 14.500.000 im US Short-Term Fund von der Verwaltungsgesellschaft durchgeführt.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren nach Abschluss des Geschäftsjahres keine weiteren Ereignisse zu verzeichnen.

### 25. GENEHMIGUNG VON FINANZABSCHLÜSSEN

Dieser Abschluss wurde am 28. April 2021 vom Verwaltungsrat genehmigt.

# Bericht des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat legt den Anteilhabern den geprüften Jahresabschluss für das zum 31. Dezember 2020 endende Geschäftsjahr vor.

## VERANTWORTUNG DES VERWALTUNGSRATS

Der Verwaltungsrat ist für die Erstellung des Jahresberichts und des Abschlusses gemäß geltendem irischem Recht und den Generally Accepted Accounting Practices von Irland, wozu auch die vom Financial Reporting Council herausgegebenen Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden zählen, verantwortlich.

Nach irischem Recht darf der Verwaltungsrat den Abschluss nur dann genehmigen, wenn er der Ansicht ist, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, der Verbindlichkeiten und der Finanzlage des Fonds zum Ende des Geschäftsjahres und des Gewinns oder Verlusts der Gesellschaft für das Geschäftsjahr widerspiegelt.

Bei der Erstellung des Abschlusses muss der Verwaltungsrat:

- geeignete Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden auswählen und diese konsequent anwenden;
- vernünftige, vorsichtige Beurteilungen und Schätzungen vornehmen;
- angeben, ob der Abschluss in Übereinstimmung mit den geltenden Bilanzierungsgrundsätzen erstellt wurde, die entsprechenden Standards identifizieren und wesentliche Abweichungen von diesen Richtlinien in den Erläuterungen zum Abschluss anzugeben und erläutern; und
- den Abschluss auf der Basis der Unternehmensfortführung erstellen, es sei denn, es ist unangemessen, davon auszugehen, dass die Gesellschaft ihre Geschäftstätigkeit fortsetzen wird.

Der Verwaltungsrat ist für die Führung ordnungsgemäßer Geschäftsbücher verantwortlich, die ausreichend sind, um:

- die Transaktionen der Gesellschaft korrekt zu erfassen und zu erläutern;
- jederzeit die Ermittlung der Vermögenswerte, der Verbindlichkeiten, der Finanzlage und des Gewinns oder Verlusts der Gesellschaft mit angemessener Genauigkeit zu ermöglichen; und
- den Verwaltungsrat in die Lage zu versetzen, sicherzustellen, dass der Abschluss dem Companies Act von 2014 entspricht, und eine Prüfung dieses Abschlusses zu ermöglichen.

Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat für den Schutz des Vermögens der Gesellschaft und somit für das Ergreifen angemessener Maßnahmen verantwortlich, um Betrug und anderen Regelwidrigkeiten vorzubeugen und diese aufzudecken.

Der Verwaltungsrat ist für die Pflege und Integrität der Unternehmens- und Finanzinformationen auf der Website der Gesellschaft verantwortlich. Die Gesetzgebung Irlands, die die Erstellung und Verteilung der Abschlüsse regelt, kann sich von der Gesetzgebung anderer Rechtsräume unterscheiden.

## ENTSPRECHENSERKLÄRUNG DES VERWALTUNGSRATS

Die Gesellschaft verfolgt die Politik, ihre maßgeblichen Pflichten (gemäß Definition im Companies Act 2014) zu erfüllen. Wie gemäß Section 225(2) des Companies Act von 2014 erforderlich, bestätigt der Verwaltungsrat, dass er dafür verantwortlich ist, die Erfüllung der maßgeblichen Pflichten durch die Gesellschaft sicherzustellen. Der Verwaltungsrat hat eine Compliance-Grundsatzserklärung im Sinne von Section 225(3)(a) des Companies Act von 2014 sowie eine Compliance-Richtlinie erarbeitet, die sich auf die Vorkehrungen und Strukturen bezieht, die eingerichtet wurden und nach Einschätzung des Verwaltungsrats darauf ausgelegt sind, eine wesentliche Erfüllung der maßgeblichen Pflichten der Gesellschaft sicherzustellen. Zudem hat der Verwaltungsrat während dieses Geschäftsjahres eine Prüfung entsprechender Vorkehrungen und Strukturen, die eingerichtet wurden, durchgeführt. Bei der Erfüllung seiner Verantwortlichkeiten gemäß Section 225 hat sich der Verwaltungsrat unter anderem auf bereitgestellte Dienste, Ratschläge und/oder Erklärungen von Dritten verlassen, die nach Einschätzung des Verwaltungsrats über das erforderliche Wissen und die Erfahrung verfügen, um eine wesentliche Erfüllung der maßgeblichen Pflichten der Gesellschaft sicherzustellen.

## ERKLÄRUNG ZU PRÜFUNGSRELEVANTEN ANGABEN

Die zum Datum dieses Berichts amtierenden Verwaltungsratsmitglieder haben jeweils bestätigt, dass:

- es nach ihrer Kenntnis keine relevanten Prüfungsinformationen gibt, die dem Abschlussprüfer der Gesellschaft nicht vorliegen; und
- sie alle Schritte unternommen haben, die von ihnen als Mitglieder des Verwaltungsrats erwartet werden, um Kenntnis aller prüfungsrelevanten Informationen zu erlangen und zu gewährleisten, dass der Abschlussprüfer der Gesellschaft diese Informationen erhält.

## ERGEBNISSE, AKTIVITÄTEN UND ZUKÜNFTIGE ENTWICKLUNGEN

Die Betriebsergebnisse und festgesetzten Dividenden werden in der Betriebsergebnisrechnung auf den Seiten 90 bis 110 ausgewiesen. Die Seiten 6 bis 62 enthalten einen Überblick über die Entwicklung der Anlagen der Fonds und ihrer Portfolios.

## HAUPTTRISIKEN UND UNGEWISSEHEITEN

Einzelheiten zu den Risikomanagementzielen und -grundsätzen der Gesellschaft und dem Marktpreis-, Fremdwährungs-, Zins-, Liquiditäts- und Kredit- und Kontrahentenrisiko der Gesellschaft sind in Erläuterung 16 in den Erläuterungen zum Abschluss angegeben.

## Brexit

Das Vereinigte Königreich ist am 31. Januar 2020 offiziell aus der EU ausgetreten („Brexit“). Weitere Informationen zu den Auswirkungen des Brexit auf die Gesellschaft finden Sie im Schreiben des Vorsitzenden.

## COVID-19

Weitere Informationen zu den Auswirkungen von COVID-19 auf die Gesellschaft finden Sie im Schreiben des Vorsitzenden und in Anmerkung 23.

## WESENTLICHE EREIGNISSE

Eine Liste der wesentlichen Ereignisse, die während des Geschäftsjahres Einfluss auf die Gesellschaft hatten, ist in Erläuterung 23 angegeben.

## EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Eine Liste der Ereignisse nach dem Bilanzstichtag, die nach Ende des Geschäftsjahres Einfluss auf die Gesellschaft hatten, ist in Erläuterung 24 angegeben.

## GESCHÄFTSBÜCHER

Die vom Verwaltungsrat ergriffenen Maßnahmen mit dem Ziel, die Erfüllung der Pflicht der Gesellschaft zur Führung ordnungsgemäßer Geschäftsbücher zu gewährleisten, umfassen den Einsatz geeigneter Systeme und Verfahren sowie den Einsatz kompetenter Personen. Die Geschäftsbücher werden bei State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin D02 HD32, Irland aufbewahrt.

## CORPORATE GOVERNANCE

Die Gesellschaft unterliegt irischem Recht und ist mit diesem konform, einschließlich des Companies Acts von 2014, der European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (S.I. Nr. 352 aus 2011) (die „UCITS Regulations“) sowie den für Investmentfonds geltenden Regeln für die Notierung am Global Exchange Market („GEM“) der Euronext Dublin. Der Verwaltungsrat (der „Verwaltungsrat“) hat die Maßgaben geprüft, die in dem von der Irish Fund Industry Association im Dezember 2011 veröffentlichten freiwilligen Corporate Governance Code for Collective Investment Schemes and Management Companies enthalten sind (der „IFIA Code“). Der Verwaltungsrat hat sämtliche Governance-Praktiken und -Verfahren des IFIA-Code IFIA Code angenommen.

Der Verwaltungsrat hat erklärt, dass die Maßnahmen im Code der IFIA mit seinen Corporate Governance-Praktiken und -verfahren für das Geschäftsjahr übereinstimmen. Die einzelnen, von der Gesellschaft engagierten Dienstleister unterliegen ihren eigenen Corporate Governance-Anforderungen.

## Finanzberichterstattung – Beschreibung der wichtigsten Merkmale

Der Verwaltungsrat muss für die Finanzberichterstattung angemessene interne Systeme zur Kontrolle und Verwaltung des Risikos der Gesellschaft einführen und aufrechterhalten. Derartige Systeme haben nicht zum Ziel, das Risiko, dass die Gesellschaft ihre Ziele im Zusammenhang mit der Finanzberichterstattung nicht erreicht, völlig auszuschalten, sondern es zu verwalten. Sie bieten keine vollständige, jedoch eine angemessene Absicherung gegen falsche Darstellungen und Verluste.

Der Verwaltungsrat verfügt über bewährte Verfahren im Zusammenhang mit Systemen für interne die Kontrolle und das Risikomanagement, um die effiziente Überwachung des Finanzberichterstattungsverfahrens zu gewährleisten. Dies schließt die Bestellung des Administrators, State Street Fund Administration Services (Ireland) Limited, zur Führung der Bücher und Aufzeichnungen ein. Der Administrator ist von der Zentralbank zugelassen und reguliert und muss sich an die von dieser erlassenen Regeln halten. Darüber hinaus ist der Administrator vertraglich verpflichtet, den Jahresbericht, einschließlich des Abschlusses, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Geschäftslage der Gesellschaft geben soll, sowie die Halbjahresabschlüsse zu erstellen, die durch den Verwaltungsrat überprüft und genehmigt werden.

Der Verwaltungsrat beurteilt und diskutiert bei Bedarf wesentliche Probleme im Zusammenhang mit der Rechnungslegung und Berichterstattung. Der Verwaltungsrat prüft und bewertet auch von Zeit zu Zeit die Rechnungslegungs- und Berichterstattungsabläufe der Verwaltungsstelle und überwacht und beurteilt

die Leistung der externen Abschlussprüfer, ihre Qualifikationen und ihre Unabhängigkeit. Der Administrator hat die operative Verantwortung für seine internen Kontrollen im Zusammenhang mit dem Finanzberichterstattungsverfahren und dem Bericht des Administrators an den Verwaltungsrat.

#### *Risikobewertung*

Der Verwaltungsrat ist für die Beurteilung des Risikos von Regelwidrigkeiten verantwortlich, unabhängig davon, ob diese auf Betrug oder Fehler in der Finanzberichterstattung zurückzuführen sind. Darüber hinaus muss er gewährleisten, dass entsprechende Verfahren zur rechtzeitigen Identifizierung interner und externer Angelegenheiten existieren, die sich möglicherweise auf die Finanzberichterstattung auswirken. Darüber hinaus hat der Verwaltungsrat Verfahren zur Identifizierung von Änderungen der Rechnungslegungsregeln und -empfehlungen eingeführt, und um zu gewährleisten, dass diesen Veränderungen in den Abschlüssen der Gesellschaft entsprechend Rechnung getragen wird.

#### *Kontrollaktivitäten*

Der Administrator verfügt über Kontrollstrukturen zur Verwaltung der mit der Finanzberichterstattung verbundenen Risiken. Diese Kontrollstrukturen umfassen die angemessene Teilung der Verantwortung und spezifischen Kontrollaktivitäten mit dem Ziel, für alle wichtigen Konten im Abschluss und in den entsprechenden Erläuterungen im Jahresbericht der Gesellschaft wesentliche Mängel in der Finanzberichterstattung aufzudecken oder solchen vorzubeugen. Beispiele für die durch den Administrator durchgeführten Kontrollen sind analytische Prüfungen, Abgleiche und automatische Kontrollen der IT-Systeme. Die Methode zur Bewertung von Wertpapieren und anderen Vermögenswerten, wenn keine Kurse aus externen, unabhängigen Quellen verfügbar sind, wird in Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss beschrieben.

#### *Information und Kommunikation*

Um zu gewährleisten, dass die Anforderungen an die Informationen über die Finanzberichterstattung vollständig und angemessen erfüllt werden, werden die Grundsätze der Gesellschaft und die Anweisungen des Verwaltungsrats, die Auswirkungen auf die Finanzberichterstattung haben, über geeignete Kanäle aktualisiert und mitgeteilt, z. B. über E-Mail, Schriftverkehr und Versammlungen.

#### *Überwachung*

Der Verwaltungsrat erhält regelmäßig Präsentationen und Kontrollberichte von der Verwahrstelle, der Anlageberatungsgesellschaft und dem Administrator. Des Weiteren verfügt der Verwaltungsrat über ein jährliches Verfahren, um angemessene Reaktionen auf vom unabhängigen Abschlussprüfer identifizierte Mängel und empfohlene Maßnahmen zu gewährleisten.

#### *Kapitalstruktur*

Niemand hält eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung an der Gesellschaft. Niemand verfügt über besondere Kontrollrechte am Grundkapital der Gesellschaft.

Die Stimmrechte sind in keiner Weise eingeschränkt.

#### *Befugnisse des Verwaltungsrats*

Im Hinblick auf die Ernennung und Ersetzung von Verwaltungsratsmitgliedern unterliegt die Gesellschaft ihrer Satzung, den irischen Gesetzen einschließlich dem Companies Act von 2014, den UCITS Regulations und den für Investmentfonds geltenden Notierungsregeln am GEM der Euronext Dublin. Die Satzung der Gesellschaft kann durch besonderen Beschluss der Anteilinhaber geändert werden.

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, die Geschäfte der Gesellschaft in Übereinstimmung mit der Satzung zu führen. Der Verwaltungsrat kann bestimmte Aufgaben an den Administrator und andere Parteien übertragen, wobei diese der Überwachung und Leitung des Verwaltungsrats unterstehen. Der Verwaltungsrat hat den Administrator mit der täglichen Verwaltung der Gesellschaft beauftragt und hat die Anlageverwaltung und die Vertriebsfunktionen an die Anlageverwaltungsgesellschaft übertragen. Kein Verwaltungsratsmitglied ist daher ein geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied.

Gemäß der Satzung darf der Verwaltungsrat die Befugnisse der Gesellschaft wahrnehmen, wie z. B. Kredite aufnehmen oder vergeben, das Unternehmen, dessen Eigentum oder einen Teil davon hypothekarisch oder anderweitig belasten, oder sie an die Anlageverwaltungsgesellschaft übertragen.

In den folgenden Situationen darf der Verwaltungsrat jederzeit und zu gegebener Zeit die Berechnung des Nettoinventarwerts eines bestimmten Fonds sowie die Ausgabe, die Rücknahme und den Umtausch von Anteilen vorübergehend aussetzen: (a) während Zeiträumen (mit Ausnahme von gesetzlichen Feiertagen oder üblichen Schließungen an Wochenenden), in denen ein Markt oder eine anerkannte Börse geschlossen oder der Handel an ihm/ihr eingeschränkt ist,

der/die den Hauptmarkt für einen wesentlichen Teil der Anlagen des betreffenden Fonds bildet;

(b) während Zeiträumen, in denen eine Notsituation vorliegt, die dazu führt, dass die Gesellschaft Anlagen, die einen wesentlichen Teil des Vermögens einer bestimmten Klasse bilden, praktisch nicht veräußern kann, die Übertragung von Geldern für den Erwerb oder die Veräußerung von Anlagen zu normalen Wechselkursen nicht möglich ist oder der Verwaltungsrat oder dessen Bevollmächtigter praktisch nicht in der Lage ist, den Wert von Anlagen des betreffenden Fonds angemessen zu bestimmen;

(c) während eines Ausfalls der normalerweise zur Bestimmung des Preises irgendeiner Anlage des betreffenden Fonds oder der aktuellen Kurse an einem beliebigen Markt oder einer anerkannten Börse verwendeten Kommunikationsmittel;

(d) wenn aus irgendeinem Grund die Preise einer Anlage der betreffenden Klasse nicht angemessen, umgehend oder genau ermittelt werden können;

(e) während Zeiträumen, in denen die Überweisung von Geldern für die Zahlung einer der Anlagen der betreffenden Klasse nach Meinung des Verwaltungsrats nicht zu normalen Wechselkursen möglich ist;

(f) bei Abwicklung der Gesellschaft oder Beendigung eines Fonds; oder

(g) wenn die Bestimmung des Wertes eines wesentlichen Teils der Anlagen der Gesellschaft oder eines Fonds aus einem anderen Grund unmöglich oder undurchführbar ist.

Die Zentralbank und die Euronext Dublin müssen umgehend über eine derartige Aussetzung und über das Ende einer derartigen Aussetzung informiert werden. Darüber hinaus muss sie Anteilszeichnern und Anteilhabern, die die Rücknahme ihrer Anteile beantragen, bei Antragstellung oder Registrierung des schriftlichen Antrags auf Rücknahme mitgeteilt werden. Soweit möglich werden alle angemessenen Schritte unternommen, um die Aussetzung so schnell wie möglich zu beenden.

Eingetragene Anteile können schriftlich übertragen werden. Der schriftlichen Übertragung muss eine Bescheinigung des Übertragungsempfängers beiliegen, dass er die Anteile nicht für eine oder zugunsten einer US-Person erwirbt. Im Falle des Todes eines Mitanteilinhabers sind die anderen Mitanteilinhaber die einzigen Personen, die laut Administrator Anspruch auf das Eigentum oder eine Beteiligung an den auf den Namen der Mitanteilinhaber eingetragenen Anteile haben. Der Verwaltungsrat kann die Eintragung einer Übertragung ablehnen, wenn er darüber informiert oder davon überzeugt ist, dass die Übertragung dazu führen würde, dass das wirtschaftliche Eigentum einer Person zufällt, die damit gegen die vom Verwaltungsrat auferlegten Einschränkungen für den Besitz verstößt oder rechtliche, aufsichtsrechtliche, geldliche, steuerliche oder wesentliche administrative Nachteile für den entsprechenden Fonds oder die Anteilinhaber allgemein zur Folge hätte.

#### *Versammlungen der Anteilinhaber*

Die Jahreshauptversammlung der Gesellschaft findet normalerweise im Mai, an einem vom Verwaltungsrat festgelegten Datum in Dublin statt. Die Einladung zur Jahreshauptversammlung, auf der jedes Jahr der geprüfte Jahresabschluss der Gesellschaft (und die Berichte des Verwaltungsrats und der Abschlussprüfer) vorgelegt wird, wird den Anteilhabern mindestens 21 volle Tage vor dem Datum der Versammlung an ihre eingetragene Anschrift zugesandt. Der Verwaltungsrat kann zu gegebener Zeit gemäß irischem Recht andere Hauptversammlungen einberufen.

Jeder Anteil berechtigt seinen Inhaber, an den Hauptversammlungen der Gesellschaft und des Fonds, den die Anteile repräsentieren, teilzunehmen und auf diesen abzustimmen. Auf Versammlungen der Anteilinhaber kann die Abstimmung per Handzeichen erfolgen, es sei denn, ein Anteilinhaber mit Stimmrecht auf der Versammlung oder der Vorsitzende der Versammlung verlangt eine Abstimmung per Stimmzettel. Bei einer Abstimmung per Handzeichen verfügt jeder Anteilinhaber über eine Stimme. Bei Angelegenheiten im Zusammenhang mit der Gesellschaft, die den Anteilhabern zur Abstimmung per Stimmzettel vorgelegt werden, verleiht jeder Anteil seinem Inhaber eine Stimme.

Keine Anteilsklasse verleiht ihren Anteilhabern Vorzugs- oder Vorrechte oder Rechte auf Beteiligung an den Gewinnen oder Dividenden einer anderen Anteilsklasse oder Stimmrechte im Zusammenhang mit Angelegenheiten, die sich ausschließlich auf eine andere Anteilsklasse beziehen.

Beschlüsse zur Änderung der mit einer Anteilsklasse verbundenen Rechte erfordern die Zustimmung von drei Vierteln der Inhaber der Anteile, die auf der Hauptversammlung der Anteilsklasse anwesend oder vertreten sind und an der Abstimmung teilnehmen. Die beschlussfähige Mehrheit für Hauptversammlungen von Anteilsklassen, auf denen über eine Änderung der mit der Klasse verbundenen Rechte entschieden wird, beträgt mindestens zwei Personen, deren Anteilsbesitz ein Drittel der Anteile ausmacht.

Alle Anteile mit Ausnahme der Zeichneranteile geben dem Anteilinhaber Anspruch auf eine anteilmäßige Beteiligung an den Dividenden und am Nettovermögen des Fonds, der die Anteile ausgegeben hat. Dies gilt nicht für Dividenden, die vor dem Erwerb der Anteile durch den Anteilinhaber festgesetzt wurden.

Zeichneranteile berechtigen ihre Inhaber zur Teilnahme an und Abstimmung auf allen Hauptversammlungen der Gesellschaft, verleihen jedoch keinen Anspruch auf eine Beteiligung an den Dividenden oder am Nettovermögen der Gesellschaft.

### *Zusammensetzung und Funktionsweise des Verwaltungsrats und seiner Ausschüsse*

Der Verwaltungsrat besteht derzeit aus sechs Mitgliedern, von denen keines geschäftsführende Aufgaben übernimmt und von denen drei von den Anlageberatungsgesellschaften unabhängig sind. Die Verwaltungsratsmitglieder können durch einen ordentlichen Beschluss der Anteilinhaber gemäß den durch den Irish Companies Act von 2014 festgelegten Verfahren ihres Amtes enthoben werden. Der Verwaltungsrat tritt während jedes Kalenderjahres mindestens einmal pro Quartal zusammen. Der Verwaltungsrat verfügt über einen für die Abschlussprüfung zuständigen Prüfungsausschuss, der derzeit aus drei unabhängigen Mitgliedern besteht und im Laufe des Berichtsjahres viermal zusammengetreten ist.

### **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 Anteilinhaber 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 Geschäftsjahres eingehalten wurden.

### **MITGLIEDER DES VERWALTUNGSRATS**

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 setzte sich der Verwaltungsrat aus folgenden Mitgliedern zusammen:

V. Mangala Ananthanarayanan – ernannt am 30. Juni 2016  
Ryan P. Blute – ernannt am 30. Mai 2014  
John Bruton – ernannt am 28. Februar 2018  
Craig A. Dawson – ernannt am 6. Mai 2009  
David M. Kennedy – ernannt am 16. April 1999  
Frances Ruane – ernannt am 28. Februar 2018

Die Satzung sieht keinen turnusmäßigen Rücktritt der Verwaltungsratsmitglieder vor.

### **SEKRETÄR**

State Street Fund Services (Ireland) Limited war während des zum 31. Dezember 2020 endenden Geschäftsjahres Sekretär der Gesellschaft.

### **BETEILIGUNGEN DER VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND DES SEKRETÄRS AN ANTEILEN UND VERTRÄGEN**

Zum 31. Dezember 2020 hielt V. Mangala Ananthanarayanan 8.757,87 (31. Dezember 2019: 8.757,87) Anteile des Dynamic Multi-Asset Fund, 7.990,84 (31. Dezember 2019: 7.761,45) Anteile des Global Investment Grade Credit Fund und 21.184,85 (31. Dezember 2019: 20.342,32) Anteile des Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 2020 hielt Craig A. Dawson 18.118,23 (31. Dezember 2019: Null) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 92.850,51 (31. Dezember 2019: 92.850,51) Anteile des Global Libor Plus Bond Fund und 97.370,98 (31. Dezember 2019: 97.370,98) Anteile des Low Duration Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 2020 hielt David M. Kennedy 5.026,09 (31. Dezember 2019: 5.341,79) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 16.786,79 (31. Dezember 2019: 16.786,79) Anteile des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund. Beide sind Fonds der Gesellschaft.

Während der zum 31. Dezember 2020 bzw. zum 31. Dezember 2019 endenden Geschäftsjahre hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Keines der Verwaltungsratsmitglieder verfügte über einen Dienstleistungsvertrag mit der Gesellschaft.

### **RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT**

Dillon Eustace war während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2020 Rechtsberater (für irisches Recht) der Gesellschaft.

### **UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER**

Die unabhängigen Abschlussprüfer, PricewaterhouseCoopers, haben ihre Bereitschaft bestätigt, ihre Aufgabe weiterhin gemäß § 383 des Companies Act 2014 wahrzunehmen.

Für den Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglied: Craig A. Dawson

Verwaltungsratsmitglied: David M. Kennedy

Datum: 28. April 2021

# Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers an die Anteilhaber der Pimco Funds: Global Investors Series plc

## Bericht über die Prüfung des Abschlusses

### Testat

Nach unserer Einschätzung:

- vermittelt der Abschluss von PIMCO Funds: Global Investor Series plc (der „Abschluss“) ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, der Verbindlichkeiten und der Finanzlage der Gesellschaft und der Fonds zum 31. Dezember 2020 sowie der Ergebnisse für das an diesem Tag abgelaufene Geschäftsjahr;
- wurde der Abschluss ordnungsgemäß im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsrichtlinien (die vom Financial Reporting Council ausgegebenen Rechnungslegungsstandards, einschließlich Financial Reporting Standard 102 „The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ und irisches Recht) erstellt; und
- wurde der Abschluss in Übereinstimmung mit den Vorschriften des Companies Acts von 2014 und den European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) ordnungsgemäß erstellt.

Wir haben den im Jahresbericht enthaltenen Abschluss geprüft, der Folgendes umfasst:

- den Finanzstatus zum 31. Dezember 2020;
- die Betriebsergebnisrechnung für das an diesem Tag abgelaufene Geschäftsjahr;
- den Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen für das an diesem Tag abgelaufene Geschäftsjahr;
- die Aufstellung der Wertpapieranlagen jedes Fonds zum 31. Dezember 2020; und
- die Erläuterungen zum Abschluss für die Gesellschaft sowie für sämtliche Fonds, einschließlich einer Beschreibung der wichtigsten Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden.

### Grundlage unseres Bestätigungsvermerks

Wir haben unsere Prüfung gemäß den International Standards on Auditing (Ireland) („ISAs (Ireland)“) und geltendem Recht durchgeführt.

Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen der ISAs (Ireland) sind im Abschnitt „Verantwortung der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses“ unseres Berichts näher beschrieben. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und angemessen sind, um eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu bilden.

#### Unabhängigkeit

Wir sind gemäß den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Abschlusses in Irland relevant sind und die den Ethikstandard der IAASA, wie er auf börsennotierte Unternehmen anzuwenden ist, umfassen, von der Gesellschaft unabhängig geblieben und haben unsere sonstigen ethischen Verpflichtungen gemäß mit diesen Anforderungen erfüllt.

### Unser Prüfungsansatz

#### Überblick



#### Wesentlichkeit

- Allgemeine Wesentlichkeit: 50 Basispunkte des Nettoinventarwerts („NIW“) zum 31. Dezember 2020 für jeden aktiven Fonds der Gesellschaft und 50 Basispunkte des durchschnittlichen NIW für die Fonds der Gesellschaft, die den Handel im laufenden Jahr eingestellt haben.

#### Prüfungsumfang

- Bei der Gesellschaft handelt es sich um eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital. Sie hat PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) mit der Verwaltung bestimmter Pflichten und Verantwortlichkeiten im Zusammenhang mit der täglichen Verwaltung der Gesellschaft beauftragt. Bei der Bestimmung des Umfangs unserer Prüfung haben wir die Arten von Anlagen der Fonds, die Beteiligung der umseitig aufgeführten Dritten, die bilanziellen Verfahren und Kontrollen sowie die Branche, in der die Gesellschaft tätig ist, berücksichtigt. Wir betrachten jeden Fonds einzeln.

#### Wesentliche Prüfungsschwerpunkte

- Bewertung der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten.
- Existenz der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten.

### Umfang unserer Prüfung

Im Rahmen der Planung unserer Prüfung haben wir die Wesentlichkeit ermittelt und die Risiken wesentlicher Falschangaben im Abschluss beurteilt. Insbesondere haben wir Bereiche untersucht, in denen der Verwaltungsrat subjektive Beurteilungen vorgenommen hat, beispielsweise bei der Auswahl von Preisquellen für die Bewertung des Anlageportfolios. Wie in unseren Prüfungen üblich, sind wir auch auf das Risiko eingegangen, dass die Unternehmensleitung interne Kontrollmaßnahmen umgehen könnte. Unter anderem haben wir untersucht, ob Hinweise auf eine Voreingenommenheit des Verwaltungsrats vorliegen, wodurch sich ein Risiko wesentlicher Falschangaben aufgrund von Betrug ergeben könnte.

### Wesentliche Prüfungsschwerpunkte

Bei den wesentlichen Prüfungsschwerpunkten handelt es sich um diejenigen Sachverhalte, die nach pflichtgemäßem Ermessen der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses für den aktuellen Berichtszeitraum von größter Bedeutung waren. Sie umfassen die erheblichsten von den Abschlussprüfern ermittelten Risiken wesentlicher Falschangaben (sei es aufgrund von Betrug oder anderweitig), einschließlich der Risiken mit den stärksten Auswirkungen auf die Prüfungsstrategie insgesamt, die Zuteilung von Ressourcen im Rahmen der Prüfung und die Steuerung der Anstrengungen des Prüfungsteams. Diese Sachverhalte und alle Bemerkungen, die wir zu den Ergebnissen unserer diesbezüglichen Verfahren machen, wurden im Rahmen unserer Prüfung des Abschlusses als Ganzes und bei der Erstellung unseres Bestätigungsvermerks behandelt, und wir geben zu diesen Sachverhalten kein gesondertes Prüfungsurteil ab. Hierbei handelt es sich nicht um eine vollständige Liste sämtlicher im Rahmen unserer Prüfung identifizierten Risiken.

---

### Wesentlicher Prüfungsschwerpunkt

#### *Bewertung der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten.*

Informationen hierzu finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen für den jeweiligen Fonds, unter „Wichtige Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden“ in Erläuterung 2 und unter „Anlagen zum Marktwert und Marktbewertungshierarchie“ in Erläuterung 3.

Die im Finanzstatus der Fonds zum 31. Dezember 2020 enthaltenen ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten Verbindlichkeiten werden gemäß den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsrichtlinien zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

Wir betrachteten die erfolgswirksame Bewertung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert als wesentlichen Prüfungsschwerpunkt, da diese das Hauptelement des Abschlusses darstellt.

---

#### *Vorliegen der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten.*

Informationen hierzu finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen für den jeweiligen Fonds, unter „Wichtige Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden“ in Erläuterung 2 und unter „Anlagen zum Marktwert und Marktbewertungshierarchie“ in Erläuterung 3.

Die im Finanzstatus der Fonds ausgewiesenen ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Finanzvermögen und -verbindlichkeiten der jeweiligen Fonds wurden zum 31. Dezember 2020 im Namen der einzelnen Fonds gehalten.

Wir betrachteten das Vorliegen von ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten als wesentlichen Prüfungsschwerpunkt, da diese das Hauptelement des Abschlusses darstellt.

---

### Umgang mit dem Prüfungsschwerpunkt im Rahmen unserer Prüfung

Wir prüften die Bewertung der übertragbaren Wertpapiere und den beizulegenden Zeitwert von Wertpapieren, die zum 31. Dezember 2020 short an Drittanbieter verkauft wurden, soweit verfügbar. Da für bestimmte Wertpapiere der Stufen 1 oder 2 keine Quellen von Drittanbietern verfügbar waren, haben wir alternative Prüfverfahren abgeschlossen, einschließlich der Abstimmung des beizulegenden Zeitwerts mit den Angaben von Gegenparteien oder der Liquidation für Kontoauszüge nach Jahresende.

Wir prüften den beizulegenden Zeitwert übertragbarer Wertpapiere, die als Anlagen der Stufe 3 ausgewiesen sind, unter Berücksichtigung der Methoden, wesentlichen Annahmen und Daten, die das Management zur Entwicklung der geschätzten beizulegenden Zeitwerte verwendet. Für bestimmte Positionen der Stufe 3, wie im Anlageplan für den Emerging Local Bond Fund angegeben, prüften wir den beizulegenden Zeitwert von Wertpapieren, die vom Management bewertet wurden, unter Verwendung der Bewertungstechnik „Referenzinstrumente“ unter Verwendung unseres internen Bewertungsexperten zur Entwicklung eines Wertpapiers, um eine unabhängige Schätzung des beizulegenden Zeitwerts zu entwickeln. Wir verglichen die Ergebnisse unserer unabhängigen Bewertung mit der Schätzung des Managements, um Angemessenheit der Schätzung des beizulegenden Zeitwerts durch das Management zu beurteilen.

Die Investmentfonds umfassen börsengehandelte Fonds und kollektive Kapitalanlagen. Wir prüften die Bewertung von börsengehandelten Fonds gegenüber Quellen von Drittanbietern. In Bezug auf kollektive Kapitalanlagen haben wir den beizulegenden Zeitwert mit einer unabhängigen Bestätigung durch die zugrunde liegende Transferstelle abgestimmt.

Wir prüften den beizulegenden Zeitwert von Pensionsgeschäften, indem wir den beizulegenden Zeitwert mit den Angaben von Gegenparteien abstimmten.

Wir prüften die Bewertung von Finanzderivaten unter Heranziehung unseres internen Bewertungssachverständigen, um eine unabhängige Schätzung des beizulegenden Zeitwerts zu erstellen und festzustellen, ob die Schätzung des beizulegenden Zeitwerts des Managements angemessen war, oder unter Einholung von Preisangaben von Drittanbietern, soweit vorhanden.

Bei der Durchführung dieser Verfahren wurden keine wesentlichen Fehldarstellungen festgestellt.

Wir holten von der Verwahrstelle oder von unabhängigen Gegenparteien unabhängige Bestätigungen bezüglich der Bestände an übertragbaren Wertpapieren zum 31. Dezember 2020 ein. Wir haben die Bestände gemäß den Bestätigungen mit den Beständen gemäß den Geschäftsbüchern abgeglichen, und eine Stichprobe der aufgeführten Abgleichsposten wurde mit den zugrunde liegenden Belegen verglichen.

Für den beizulegenden Zeitwert von Leerverkäufen holten wir unabhängige Bestätigungen von den Gegenparteien ein.

Die Investmentfonds umfassen börsengehandelte Fonds und kollektive Kapitalanlagen. Für börsengehandelte Fonds haben wir eine unabhängige Bestätigung von der Verwahrstelle erhalten. In Bezug auf kollektive Kapitalanlagen haben wir eine unabhängige Bestätigung durch die zugrunde liegende Transferstelle erhalten.

In Bezug auf Finanzderivate holten wir für alle wesentlichen Positionen unabhängige Bestätigungen der Gegenparteien ein. Hinsichtlich wesentlichen Devisenterminkontrakten stimmten wir die Abrechnung der Positionen mit nach dem Jahresende ausgestellten Kontoauszügen ab.

Bei der Durchführung dieser Verfahren wurden keine wesentlichen Fehldarstellungen festgestellt.

---

## Bestimmung des Prüfungsumfangs

Wir haben den Umfang unserer Prüfung so bemessen, dass gewährleistet ist, dass wir ausreichende Leistungen erbracht haben, um ein Prüfungsurteil über den Jahresabschluss als Ganzes unter Berücksichtigung der Struktur der Gesellschaft, der Rechnungslegungsprozesse und -kontrollen sowie der Branche, in der sie tätig ist, abgeben zu können.

Zum 31. Dezember 2020 waren 51 Fonds aktiv, 9 Fonds haben den Handel im laufenden Jahr eingestellt. Der Finanzstatus, die Betriebsergebnisrechnung und der Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen der Gesellschaft sind eine Zusammenfassung der Positionen und Ergebnisse der einzelnen Fonds.

Der Verwaltungsrat kontrolliert die Geschäfte der Gesellschaft und ist für die allgemeine Anlagepolitik verantwortlich, die von ihm festgelegt wird. Die Gesellschaft hat die Verwaltungsgesellschaft mit der Verwaltung bestimmter Pflichten und Verantwortlichkeiten im Zusammenhang mit der täglichen Verwaltung der Gesellschaft beauftragt. Die Verwaltungsgesellschaft hat bestimmte Verantwortlichkeiten an die Anlageberatungsgesellschaften sowie an State Street Fund Services (Ireland) Limited (den „Administrator“) delegiert. Der Abschluss, der weiterhin in der Verantwortung des Verwaltungsrats liegt, wird in seinem Namen vom Administrator erstellt. Die Gesellschaft hat State Street Custodial Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) zur Verwahrstelle für das Vermögen der Gesellschaft bestellt. Bei der Festlegung des globalen Ansatzes für unsere Prüfung haben wir das Risiko wesentlicher Falschangaben auf Fondsebene beurteilt. Hierbei haben wir die Art, die Wahrscheinlichkeit und das potenzielle Ausmaß möglicher Falschangaben berücksichtigt. Im Rahmen unserer Risikobeurteilung haben wir die Interaktion der Gesellschaft mit dem Administrator berücksichtigt und das beim Administrator vorliegende Kontrollumfeld beurteilt.

## Wesentlichkeit

Der Umfang unserer Prüfung wurde durch Anwendung von Wesentlichkeitskriterien bestimmt. Wir haben bestimmte quantitative Wesentlichkeitsgrenzen angesetzt, die uns gemeinsam mit qualitativen Überlegungen geholfen haben, den Umfang unserer Prüfung und die Art, die zeitliche Gestaltung und das Ausmaß unserer Prüfverfahren für die einzelnen Posten des Abschlusses und die darin enthaltenen Angaben festzulegen und die Auswirkungen von Falschangaben sowohl individuell betrachtet als auch bezüglich des Abschlusses insgesamt zu beurteilen.

Nach unserem pflichtgemäßen Ermessen haben wir Wesentlichkeit für die Abschlüsse der einzelnen Fonds der Gesellschaft folgendermaßen bestimmt:

<i>Allgemeine Wesentlichkeit und Art der Bestimmung</i>	50 Basispunkte (2019: 50 Basispunkte) des Nettoinventarwerts („NIW“) zum 31. Dezember 2020 für jeden aktiven Fonds der Gesellschaft und 50 Basispunkte des durchschnittlichen NIW für die Fonds der Gesellschaft, die den Handel im laufenden Jahr eingestellt haben.
<i>Begründung für den angewandten Vergleichswert</i>	Wir haben diese Benchmark verwendet, weil das Hauptziel der Gesellschaft darin besteht, den Anlegern eine Gesamtrendite auf Fondsebene zu bieten, die Kapital- und Ertragsrenditen enthält.

Wir haben mit dem Verwaltungsrat vereinbart, diesem sämtliche bei unserer Prüfung ermittelten Falschangaben mit Auswirkung auf den NIW je Anteil in Höhe von mehr als 10 % der allgemeinen Wesentlichkeit (2019: 10 % der allgemeinen Wesentlichkeit bei Differenzen mit Auswirkung auf den NIW je Anteil) zu melden, ebenso wie Falschangaben unterhalb dieses Betrags, die unserer Einschätzung nach aus qualitativen Gründen zu melden sind.

## Schlussfolgerungen zur Unternehmensfortführung der Gesellschaft und der Fonds, bei denen der Grundsatz der Unternehmensfortführung als Grundlage der Rechnungslegung übernommen wurde

Unsere Bewertung der Beurteilung des Verwaltungsrats hinsichtlich der Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds zur Rechnungslegung unter der Annahme der Unternehmensfortführung umfasste Folgendes:

- Erlangung eines Verständnisses der Schlüsselindikatoren, die im Hinblick auf die Annahme der Unternehmensfortführung und die künftigen Pläne des Managements für die Fonds über den Zeitraum der Unternehmensfortführung (12 Monate ab dem Datum der Genehmigung des Abschlusses) überwacht werden;
- Der Jahresabschluss beschreibt die Gründe der Mitglieder des Verwaltungsrats dafür, warum die Jahresabschlüsse des Global Advantage Real Return Fund, des PIMCO RAE Emerging Markets Fund, des PIMCO RAE Europe Fund, des PIMCO RAE Global Developed Fund, des PIMCO RAE US Fund, des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund, des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund, des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund und des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund auf einem anderen Grundsatz als dem der Unternehmensfortführung erstellt wurden.
- Überprüfung der verfügbaren Sitzungsprotokolle des Verwaltungsrats während des Prüfungszeitraums und der bis zum Datum dieses Berichts verfügbaren Protokolle;
- Berücksichtigung der Kapitalaktivität nach Jahresende, wie in den zugrunde liegenden Buchhaltungsunterlagen erfasst;
- Anfragen des Managements in Bezug auf geplante bedeutende Rücknahmen, über die sie informiert wurden;
- Berücksichtigung der Liquiditätsrisikomanagementtechniken, die der Gesellschaft und den Fonds zur Verfügung stehen.

Im Rahmen unserer Prüfung haben wir keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder zusammen erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds aufwerfen, für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Datum, an dem der Abschluss zur Veröffentlichung genehmigt wird, weiter zu bestehen.

Bei der Prüfung des Abschlusses sind wir zu dem Schluss gekommen, dass die Anwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung als Grundlage der Rechnungslegung durch den Verwaltungsrat für die Erstellung des Jahresabschlusses der Gesellschaft und der Fonds, bei denen der Grundsatz der Unternehmensfortführung als Grundlage der Rechnungslegung angewendet wurde, angemessen ist.

Da es jedoch nicht möglich ist, alle künftigen Ereignisse oder Schlussfolgerungen vorherzusagen, ist diese Erklärung keine Garantie für die Fähigkeit der Gesellschaft bzw. der Fonds, bei denen der Grundsatz der Unternehmensfortführung als Grundlage der Rechnungslegung angewendet wurde, zur Fortsetzung des Geschäftsbetriebs auf der Grundlage der Unternehmensfortführung.

Unsere Verantwortlichkeiten und die Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats im Hinblick auf die Unternehmensfortführung werden in den jeweiligen Abschnitten dieses Berichts beschrieben.

## Berichterstattung über sonstige Informationen

Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, nicht jedoch den Abschluss und unseren diesbezüglichen Prüfungsbericht. Der Verwaltungsrat ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Unser Bestätigungsvermerk zum Abschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir auch weder einen Bestätigungsvermerk noch, sofern in diesem Bericht nicht ausdrücklich etwas anderes angegeben ist, eine Zusicherung jeglicher Art darüber ab. In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses liegt es in unserer Verantwortung, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu erwägen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Widersprüche zum Abschluss oder unseren im Rahmen der Prüfung erlangten Kenntnissen enthalten oder anderweitig wesentlich fehlerhaft zu sein scheinen. Wenn wir offensichtliche wesentliche Widersprüchlichkeiten oder wesentliche Fehldarstellungen feststellen, sind wir verpflichtet, Verfahren durchzuführen, um zu bestimmen, ob eine wesentliche Fehldarstellung des Abschlusses oder eine wesentliche Fehldarstellung der sonstigen Informationen vorliegt. Wenn wir aufgrund der von uns geleisteten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Fehldarstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, diese Tatsache zu melden. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Im Hinblick auf den Bericht des Verwaltungsrats haben wir zudem geprüft, ob die vom Companies Act 2014 geforderten Angaben enthalten sind.

## Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers (Fortsetzung)

---

Beruhend auf den oben beschriebenen Verantwortlichkeiten und unserer Arbeit im Rahmen der Abschlussprüfung sind wir gemäß den ISAs (Irland) und dem Companies Act 2014 zudem verpflichtet, bestimmte Meinungen und Sachverhalte, wie nachfolgend beschrieben, offenzulegen:

- Auf Basis der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entsprechen die Angaben im Bericht des Verwaltungsrats für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 unseres Erachtens dem Jahresabschluss und wurden in Übereinstimmung mit den anwendbaren gesetzlichen Vorschriften erstellt.
- Auf Basis unserer Kenntnis und unseres Verständnisses der Gesellschaft und ihres Umfelds, die wir im Rahmen unserer Prüfung erlangt haben, haben wir keine wesentlichen Fehldarstellungen im Bericht des Verwaltungsrats identifiziert.

---

### Verantwortung für den Abschluss und die Prüfung

#### *Verantwortung des Verwaltungsrats für den Abschluss*

Wie in der auf Seite 848 dargelegten Aufgaben des Verwaltungsrats ausführlicher erläutert, sind die Verwaltungsratsmitglieder für die Erstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den anwendbaren Bilanzierungsrichtlinien verantwortlich und müssen sich davon überzeugen, dass dieser ein wahrheitsgemäßes und angemessenes Bild vermittelt.

Der Verwaltungsrat ist außerdem für interne Kontrollmaßnahmen verantwortlich, die er für notwendig erachtet, um die Erstellung von Abschlüssen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen Fehldarstellungen sind, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat dafür verantwortlich, die Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds zur Unternehmensfortführung zu beurteilen, wobei er gegebenenfalls Angelegenheiten in Bezug auf die Unternehmensfortführung oder die Anwendung des Fortführungsprinzips offenlegen muss, sofern der Verwaltungsrat nicht die Auflösung der Gesellschaft oder die Einstellung des Betriebs beabsichtigt oder keine realistische Alternative dazu hat.

#### *Verantwortung der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses*

Unsere Zielsetzung ist es, eine hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen Fehldarstellungen ist, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum, und einen Prüfbericht zu erstellen, der unseren Bestätigungsvermerk enthält. Eine hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, jedoch keine Garantie dafür, dass eine gemäß den ISAs (Irland) durchgeführte Prüfung stets eine eventuell vorliegende wesentliche Fehldarstellung aufdeckt. Fehldarstellungen können aufgrund von Betrug oder Irrtum entstehen und werden als wesentlich angesehen, wenn angemessenerweise davon ausgegangen werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Benutzern beeinflussen könnten.

Zu den Prüfungen im Rahmen unserer Abschlussprüfung kann die Prüfung vollständiger Bestände bestimmter Transaktionen und Salden zählen, möglicherweise unter Verwendung von Datenprüfungstechniken. Üblicherweise wird jedoch eine beschränkte Anzahl von Elementen für die Prüfung ausgewählt, statt vollständige Bestände zu prüfen. Oftmals sind wir bestrebt, uns bei der Prüfung auf bestimmte Elemente zu konzentrieren, basierend auf deren Umfang oder Risikomeerkmalen. In anderen Fällen führen wir eine stichprobenbasierte Prüfung durch, um Schlussfolgerungen hinsichtlich des Bestandes zu ziehen, aus dem die Stichprobe ausgewählt wurde.

Eine weitere Beschreibung unserer Verantwortlichkeiten für die Prüfung des Abschlusses finden sich auf der IAASA-Website unter

[https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description\\_of\\_auditors\\_responsibilities\\_for\\_audit.pdf](https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf).

Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Berichts des Abschlussprüfers.

#### *Verwendung dieses Berichts*

Dieser Bericht einschließlich des Testats wurde ausschließlich für die Anteilhaber der Gesellschaft als Organ gemäß § 391 des Companies Act von 2014 und zu keinem anderen Zweck erstellt. Mit unserer Stellungnahme akzeptieren oder übernehmen wir keine Verantwortung für andere Zwecke oder gegenüber anderen Personen, die von diesem Bericht Kenntnis erhalten oder in deren Hände er gerät, es sei denn, dies wurde von uns vorab ausdrücklich schriftlich zugesichert.

---

## Sonstige Berichtspflichten

### Stellungnahmen zu anderen Angelegenheiten gemäß dem Companies Act 2014

- Wir haben alle Informationen und Erklärungen erhalten, die wir für unsere Prüfung für notwendig halten.
- Unserer Auffassung nach waren die Geschäftsbücher der Gesellschaft ausreichend, um eine problemlose und ordnungsgemäße Prüfung des Abschlusses zu ermöglichen.
- Der Abschluss stimmt mit den Geschäftsbüchern überein.

---

### Ausnahmemeldungen gemäß dem Companies Act 2014

#### *Vergütung und Transaktionen der Verwaltungsratsmitglieder*

Gemäß dem Companies Act von 2014 müssen wir Ihnen mitteilen, wenn unserer Auffassung nach die von den Paragraphen 305 bis 312 dieses Gesetzes geforderten Angaben zur Vergütung und den Transaktionen der Verwaltungsratsmitglieder nicht gemacht wurden. Wir haben diesbezüglich keine Ausnahmen zu melden.

Jonathan O'Connell  
für und im Namen von PricewaterhouseCoopers  
Chartered Accountants und Statutory Audit Firm  
Dublin  
29. April 2021

Wir haben das Geschäftsgebaren der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“) für das zum 31. Dezember 2020 endende Geschäftsjahr in unserer Eigenschaft als Verwahrstelle der Gesellschaft untersucht.

Dieser Bericht, einschließlich des Bestätigungsvermerks, wurde ausschließlich für die Anteilhaber der Gesellschaft als Körperschaft im Einklang mit Verordnung 34, (1), (3) und (4) in Teil 5 der European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2011 in ihrer jeweils geltenden Fassung („UCITS Regulations“) und zu keinem anderen Zweck erstellt. Mit diesem Testat übernehmen und akzeptieren wir keinerlei Verantwortung zu anderen Zwecken oder gegenüber anderen Personen, die Kenntnis von diesem Bericht erhalten.

### VERANTWORTUNG DER VERWAHRSTELLE

Unsere Pflichten und unsere Verantwortung sind in Verordnung 34, (1), (3) und (4) in Teil 5 der UCITS Regulations dargelegt. Eine dieser Pflichten ist die Untersuchung des Geschäftsgebarens der Gesellschaft für jeden Rechnungslegungszeitraum von einem Jahr und die Berichterstattung hierüber an die Anteilhaber.

Aus unserem Bericht geht hervor, ob die Gesellschaft unserer Meinung nach während dieses Zeitraums in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Satzung der Gesellschaft (die „Satzung“) und den UCITS Regulations verwaltet wurde. Die Gesellschaft ist dafür verantwortlich, diese Bestimmungen einzuhalten. Sollte die Gesellschaft nicht für eine derartige Übereinstimmung gesorgt haben, ist es unsere Pflicht als Verwahrstelle, hierüber zu berichten und die von uns getroffenen Abhilfemaßnahmen aufzuführen.

### GRUNDLAGE DES TESTATS DER VERWAHRSTELLE

Die Verwahrstelle führt alle Prüfungen durch, die ihrer Meinung nach angemessen sind, um ihre in Verordnung 34, (1), (3) und (4) in Teil 5 der UCITS Regulations erwähnten Pflichten zu erfüllen und zu gewährleisten, dass die Gesellschaft unter allen wesentlichen Gesichtspunkten folgendermaßen verwaltet wurde: (i) unter Einhaltung der von ihrer Satzung und den UCITS Regulations auferlegten Anlagegrenzen und Kreditaufnahmebefugnisse und (ii) ansonsten in Übereinstimmung mit der Satzung und den entsprechenden Vorschriften.

### TESTAT

Unserer Meinung nach wurde die Gesellschaft während des Berichtszeitraums unter allen wesentlichen Gesichtspunkten folgendermaßen verwaltet:

- (i) unter Einhaltung der von ihrer Satzung, den UCITS Regulations und den Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „Central Bank UCITS Regulations“) auferlegten Anlagegrenzen und Kreditaufnahmebefugnisse; und
- (ii) ansonsten in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Satzung, den UCITS Regulations und den Central Bank UCITS Regulations.

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

Datum: 28. April 2021

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) ist im Rahmen ihren Pflichten gemäß Richtlinie 2009/65/EG in ihrer jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinie“) verpflichtet, für diejenigen Mitarbeiterkategorien, einschließlich Geschäftsleitung, Risikoträger und Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen und aller Mitarbeiter, die eine Gesamtvergütung erhalten, aufgrund derer sie sich in derselben Einkommensstufe befinden wie Mitglieder der Geschäftsleitung und Risikoträger, deren Tätigkeit sich wesentlich auf die Risikoprofile der Verwaltungsgesellschaft oder von dieser verwalteter Organismen für gemeinsame Anlagen („OGAW“) auswirkt, Vergütungsrichtlinien und -praktiken vorzuhalten, die mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar und diesem förderlich sind und keine Anreize zur Eingehung von Risiken setzen, die nicht mit dem Risikoprofil, den Vorschriften oder der Gründungsurkunde der Verwaltungsgesellschaft oder von PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“) vereinbar sind.

Die Vergütung besteht aus allen Arten von Zahlungen oder Leistungen, die unmittelbar durch die oder mittelbar, jedoch im Auftrag der Verwaltungsgesellschaft als Gegenleistung für von Mitarbeitern erbrachte berufliche Dienstleistungen gewährt werden. Hierzu zählen, je nach Sachlage: (i) alle Arten von Zahlungen oder Leistungen, die durch die Verwaltungsgesellschaft gezahlt werden; (ii) jeder Betrag, der durch die Gesellschaft gezahlt wird, einschließlich jedes Anteils an Erfolgsgebühren; und/oder (iii) jede Übertragung von Anteilen oder Aktien einer Gesellschaft als Gegenleistung für durch die identifizierten Mitarbeiter erbrachte berufliche Dienstleistungen. Bei einer festen Vergütung erfolgen Zahlungen oder Leistungen ohne Berücksichtigung von Leistungskriterien. Bei einer variablen Vergütung erfolgen zusätzliche Zahlungen oder Leistungen in Abhängigkeit von der Leistung oder ggf. anderen vertraglich vereinbarten Kriterien.

Angaben erfolgen in Bezug auf (a) die Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft; (b) Mitarbeiter, die der Geschäftsleitung angehören; und (c) Mitarbeiter mit der Fähigkeit, wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds zu nehmen, einschließlich natürlicher Personen, die zwar nicht unmittelbar durch die Verwaltungsgesellschaft beschäftigt sind, jedoch von ihrem Arbeitgeber für die Erbringung von Dienstleistungen unmittelbar für die Verwaltungsgesellschaft abgestellt sind („Beauftragte“).

Der Betrag der Gesamtvergütung, die die Verwaltungsgesellschaft ihren Mitarbeitern gewährt und die dem OGAW-bezogenen Geschäft der Verwaltungsgesellschaft im Hinblick auf das Geschäftsjahr der Verwaltungsgesellschaft zum 31. Dezember 2020 zugerechnet wurde, beläuft sich auf 180.000 EUR. Dieser Wert umfasst die feste Vergütung in Höhe von 180.000 EUR und die variable Vergütung in Höhe von 0 EUR. Insgesamt gab es drei Begünstigte bezüglich der vorstehend beschriebenen Vergütung.

Der Betrag der durch die Verwaltungsgesellschaft gewährten Gesamtvergütung, die dem OGAW-bezogenen Geschäft der Verwaltungsgesellschaft im Hinblick auf das Geschäftsjahr der Verwaltungsgesellschaft zum 31. Dezember 2020 zugerechnet wurde, belief sich für ihre Geschäftsleitung auf 0 USD und für andere Mitglieder ihrer Belegschaft, deren Handlungen eine wesentliche Auswirkung auf das Risikoprofil des OGAW-bezogene Geschäft der Verwaltungsgesellschaft haben, auf 0 USD.

Der Betrag der durch ihren identifizierten Mitarbeitern durch Beauftragte gewährten Gesamtvergütung, der den Teilfonds im Hinblick auf das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 zugerechnet wird, beläuft sich auf 12.157.274 USD. Diese Zahl umfasst eine feste Vergütung in Höhe von 86.469 USD und eine variable Vergütung in Höhe von 12.070.805 USD. Insgesamt gab es 56 Begünstigte bezüglich der vorstehend beschriebenen Vergütung.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	33.981.025	\$ 338.738	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	28.202.589	\$ 281.061
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
NWD Finance BVI Ltd. 4,800 % fällig am 09.09.2023	\$ 15.000	15.026	Philippines Government International Bond 2,950 % fällig am 05.05.2045	\$ 7.400	7.957
Scenery Journey Ltd. 11,500 % fällig am 24.10.2022	15.300	14.426	Indonesia Government International Bond 4,200 % fällig am 15.10.2050	6.100	7.216
Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	12.600	13.194	China Evergrande Group 8,250 % fällig am 23.03.2022	6.900	6.210
Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 15.01.2026	12.300	12.391	Scenery Journey Ltd. 11,500 % fällig am 24.10.2022	6.100	5.185
Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.09.2026	IDR 144.400.000	11.735	China Evergrande Group 8,750 % fällig am 28.06.2025	6.200	4.997
Vedanta Resources Finance PLC 8,000 % fällig am 23.04.2023	\$ 15.605	11.417	Sunac China Holdings Ltd. 7,500 % fällig am 01.02.2024	4.600	4.618
ABJA Investment Co. Pte. Ltd. 5,450 % fällig am 24.01.2028	11.300	11.283	Country Garden Holdings Co. Ltd. 4,800 % fällig am 08.06.2030	4.100	4.371
China Evergrande Group 8,750 % fällig am 28.06.2025	13.900	11.212	Meituan 3,050 % fällig am 28.10.2030	4.200	4.300
Fortune Star BVI Ltd. 5,950 % fällig am 19.10.2025	10.700	10.904	CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 3,000 % fällig am 22.09.2030	4.100	4.125
Agile Group Holdings Ltd. 7,875 % fällig am 31.07.2024	10.487	10.896	Delhi International Airport Ltd. 6,450 % fällig am 04.06.2029	3.800	4.012
Sri Lanka Government International Bond 6,200 % fällig am 11.05.2027	17.700	10.604	Fantasia Holdings Group Co. Ltd. 10,875 % fällig am 01.09.2020	3.900	3.944
Kaisa Group Holdings Ltd. 10,500 % fällig am 15.01.2025	10.600	10.460	Li & Fung Ltd. 4,500 % fällig am 18.08.2025	3.900	3.900
Studio City Finance Ltd. 7,250 % fällig am 11.02.2024	9.600	9.989	Proven Honour Capital Ltd. 4,125 % fällig am 05.06.2026	3.700	3.824
TML Holdings Pte. Ltd. 5,500 % fällig am 03.06.2024	9.200	9.300	New Metro Global Ltd. 6,800 % fällig am 05.08.2023	3.700	3.820
Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	9.100	9.075	Axiata SPV2 Bhd. 2,163 % fällig am 19.08.2030	3.800	3.793
Fantasia Holdings Group Co. Ltd. 9,250 % fällig am 28.07.2023	9.000	8.960	Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	3.800	3.779
Easy Tactic Ltd. 12,375 % fällig am 18.11.2022	8.800	8.861	Sri Lanka Government International Bond 5,750 % fällig am 18.04.2023	5.300	3.776
Yanlord Land HK Co. Ltd. 6,800 % fällig am 27.02.2024	8.500	8.774	MTR Corp. Ltd. 1,625 % fällig am 19.08.2030	3.800	3.755
Prosus NV 3,832 % fällig am 08.02.2051	8.400	8.379	Pakistan Government International Bond 6,875 % fällig am 05.12.2027	3.800	3.753

(a) Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds 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 Fondsbarmittel 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	4.544.382	\$ 45.316
	<b>PARI (000S)</b>	
Lenovo Group Ltd. 5,875 % fällig am 24.04.2025	\$ 2.500	2.855
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,150 % fällig am 29.03.2027	2.200	2.526
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 2,700 % fällig am 13.05.2030	2.200	2.282
Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	2.000	2.121
Huaxin Cement International Finance Co. Ltd. 2,250 % fällig am 19.11.2025	2.100	2.091
Tencent Holdings Ltd. 3,240 % fällig am 03.06.2050	2.000	2.069
Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	2.000	1.994
Greenland Global Investment Ltd. 7,250 % fällig am 22.01.2025	2.000	1.923
Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.09.2026	IDR 23.000.000	1.863
Indonesia Government International Bond 8,125 % fällig am 15.05.2024	24.018.000	1.831
Airport Authority Hong Kong 2,400 % fällig am 08.03.2028	\$ 1.800	1.829
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,700 % fällig am 27.02.2022	1.800	1.826
Pertamina Persero PT 4,300 % fällig am 20.05.2023	1.600	1.721
Kaisa Group Holdings Ltd. 10,500 % fällig am 15.01.2025	1.700	1.708
Cerah Capital Ltd. 0,000 % fällig am 08.08.2024	1.700	1.649
China Construction Bank Corp. 2,450 % fällig am 24.06.2030	1.600	1.620
China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd. 3,080 % fällig am 09.12.2025	1.600	1.603
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5,450 % fällig am 15.05.2030	1.400	1.580
Link CB Ltd. 1,600 % fällig am 03.04.2024	HKD 12.000	1.541

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.278.489	\$ 32.700
	<b>PARI (000S)</b>	
Indonesia Government International Bond 4,450 % fällig am 11.02.2024	\$ 850	940
Ronshine China Holdings Ltd. 7,350 % fällig am 15.12.2023	900	913
CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 3,000 % fällig am 22.09.2030	700	701
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5,450 % fällig am 15.05.2030	600	680
Vedanta Resources Ltd. 6,125 % fällig am 09.08.2024	900	663
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 3,250 % fällig am 28.04.2025	600	652
China Evergrande Group 8,250 % fällig am 23.03.2022	700	641
Philippines Government International Bond 7,750 % fällig am 14.01.2031	400	610
Fantasia Holdings Group Co. Ltd. 10,875 % fällig am 09.01.2023	600	608
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. 4,000 % fällig am 30.07.2027	600	600
Harvest Operations Corp. 2,330 % fällig am 14.04.2021	540	546
Pertamina Persero PT 4,175 % fällig am 21.01.2050	500	534
Sri Lanka Government International Bond 6,125 % fällig am 03.06.2025	600	495
Hungary Government International Bond 1,500 % fällig am 17.11.2050	€ 400	469
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,550 % fällig am 29.03.2026	\$ 400	461
Dongfeng Motor Hong Kong International Co. Ltd. 1,150 % fällig am 23.10.2021	€ 400	454
Bank Mandiri Persero Tbk PT 4,750 % fällig am 13.05.2025	\$ 400	443
CK Hutchison International Ltd. 3,375 % fällig am 08.05.2050	400	439
Hutchison Whampoa International Ltd. 3,625 % fällig am 31.10.2024	400	438

(a) Der Asia Strategic Interest Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds 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 Fondsbarmittel 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	38.962.485	\$ 388.234	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	26.035.539	\$ 259.740
	<b>PARI (000S)</b>		PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	1.713.600	170.211
Deutsche Bank AG 5,625 % fällig am 19.05.2031	€ 148.700	164.916		<b>PARI (000S)</b>	
Bank of America Corp. 1,319 % fällig am 19.06.2026	\$ 124.000	124.000	Banco Santander S.A. 6,250 % fällig am 11.09.2021	€ 128.800	139.588
Barclays PLC 6,125 % fällig am 15.12.2025	91.283	92.304	Natwest Group PLC 4,269 % fällig am 22.03.2025	\$ 80.000	85.273
Banco Santander S.A. 4,375 % fällig am 14.01.2026	€ 69.800	74.443	Wells Fargo & Co. 3,069 % fällig am 24.01.2023	59.400	60.725
ING Groep NV 4,875 % fällig am 16.05.2029	\$ 69.600	69.600	Bank of America Corp. 3,194 % fällig am 23.07.2030	42.700	45.300
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % fällig am 15.01.2026	€ 59.000	68.742	Bank of America Corp. 1,319 % fällig am 19.06.2026	43.500	43.937
Credit Suisse Group AG 4,194 % fällig am 01.04.2031	\$ 60.200	68.072	Societe Generale S.A. 6,750 % fällig am 06.04.2028	44.350	43.780
Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025	€ 61.100	66.524	Goldman Sachs Group, Inc. 3,691 % fällig am 05.06.2028	36.500	39.931
Credit Agricole S.A. 4,000 % fällig am 23.12.2027	53.200	63.135	BNP Paribas S.A. 3,800 % fällig am 10.01.2024	36.000	38.943
Natwest Group PLC 6,000 % fällig am 29.12.2025	\$ 60.100	60.100	HSBC Holdings PLC 6,000 % fällig am 29.12.2049	€ 32.205	34.337
BNP Paribas S.A. 4,500 % fällig am 25.02.2030	57.000	57.000	HSBC Capital Funding Dollar LP 10,176 % fällig am 30.06.2030	\$ 20.100	34.050
	<b>AKTIEN</b>		Credit Suisse Group AG 3,750 % fällig am 26.03.2025	29.060	32.083
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	479.700	48.777	Bank of America Corp. 3,124 % fällig am 20.01.2023	30.000	31.053
	<b>PARI (000S)</b>		Citigroup, Inc. 3,887 % fällig am 10.01.2028	26.732	29.388
Erste Group Bank AG 4,250 % fällig am 15.10.2027	€ 38.200	45.239	Danske Bank A/S 5,875 % fällig am 06.04.2022	€ 25.000	28.981
Intesa Sanpaolo SpA 5,148 % fällig am 10.06.2030	£ 30.300	39.436	Goldman Sachs Group, Inc. 2,908 % fällig am 05.06.2023	\$ 28.000	28.661
Volkswagen International Finance NV 3,875 % fällig am 17.06.2029	€ 34.400	39.051	JPMorgan Chase & Co. 2,739 % fällig am 15.10.2030	27.100	27.791
Coöperatieve Rabobank UA 4,375 % fällig am 29.06.2027	32.400	36.571	BNP Paribas S.A. 4,500 % fällig am 25.02.2030	30.000	27.738
ABN AMRO Bank NV 4,375 % fällig am 22.09.2025	30.300	35.531	Intesa Sanpaolo SpA 7,000 % fällig am 29.12.2049	€ 23.600	27.652
Banco de Sabadell S.A. 1,125 % fällig am 27.03.2025	37.300	33.823	Volkswagen International Finance NV 4,625 % fällig am 27.06.2028	29.700	26.223
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 8,500 % fällig am 10.09.2030	28.000	33.145	Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.06.2024	\$ 24.250	24.803
Barclays PLC 3,250 % fällig am 17.01.2033	£ 24.250	32.184	KBC Group NV 4,750 % fällig am 05.03.2024	€ 21.400	24.724
Bank of Nova Scotia 4,900 % fällig am 04.06.2025	\$ 31.900	31.876	Telefonica Europe BV 4,375 % fällig am 14.12.2024	25.000	24.708
			Wells Fargo & Co. 3,000 % fällig am 22.04.2026	\$ 22.500	24.479
			NN Group NV 4,500 % fällig am 15.07.2049	18.300	24.420

(a) Der PIMCO Capital Securities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds 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 Fondsbarmittel 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.11.2027	\$ 16.530	\$ 16.487	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.11.2027	\$ 14.850	\$ 14.782
U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	13.090	13.070	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	5.600	5.595
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.08.2030	4.420	4.372	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.08.2030	4.420	4.359
Eversource Energy 1,650 % fällig am 15.08.2030	2.705	2.689	Egypt Government International Bond 5,250 % fällig am 06.10.2025	700	747
Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032	2.000	2.000	Hungary Government International Bond 1,750 % fällig am 05.06.2035	€ 200	270
Unipol Gruppo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2030	€ 1.500	1.908	Egypt Government International Bond 5,250 % fällig am 06.10.2025	\$ 200	213
Host Hotels & Resorts LP 3,500 % fällig am 15.09.2030	\$ 1.675	1.718	LeasePlan Corp. NV 3,500 % fällig am 09.04.2025	€ 100	131
Avangrid, Inc. 3,800 % fällig am 01.06.2029	1.365	1.573	Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2030	70	87
Prologis International Funding S.A. 1,625 % fällig am 17.06.2032	€ 1.125	1.548	Eversource Energy 1,650 % fällig am 15.08.2030	\$ 25	25
Iberdrola Finanzas S.A. 1,000 % fällig am 07.03.2024	1.100	1.383			
Boston Properties LP 3,400 % fällig am 21.06.2029	\$ 1.200	1.326			
Avangrid, Inc. 3,150 % fällig am 01.12.2024	1.200	1.307			
Agence Francaise de Developpement 1,375 % fällig am 17.09.2024	€ 1.000	1.299			
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 1,500 % fällig am 13.02.2025	\$ 1.240	1.295			
Dell International LLC 6,200 % fällig am 15.07.2030	1.000	1.281			
Enel Finance International NV 2,650 % fällig am 10.09.2024	1.200	1.280			
Assicurazioni Generali SpA 4,125 % fällig am 04.05.2026	€ 900	1.271			
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD 1.550	1.202			
Kimco Realty Corp. 2,700 % fällig am 01.10.2030	\$ 1.125	1.177			
ING Groep NV 4,875 % fällig am 16.05.2029	1.100	1.132			

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 Fondsbarmittel 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	\$ 24.197	\$ 24.698	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2021 (b)	\$ 96.685	\$ 95.775
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	23.573	24.182	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b)	34.167	34.146
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	16.746	18.611	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	27.841	29.934
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	16.025	17.012	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	23.847	25.364
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	15.859	16.493	<b>AKTIEN</b>		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	10.436	11.108	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	237.000	23.626
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	9.415	9.978		<b>PARI (000S)</b>	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025	€ 6.094	7.730	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	\$ 19.840	20.628
U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	\$ 6.710	6.753	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	17.000	17.277
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	6.319	6.648	Spain Government International Bond 0,150 % fällig am 30.11.2023	€ 14.234	17.187
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	5.366	5.950	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$ 12.679	14.017
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	5.345	5.878	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	11.989	13.241
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030	€ 4.200	5.159	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	12.710	12.370
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$ 4.738	5.082	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2021 (b)	9.794	9.790
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	4.086	4.676	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	8.171	9.351
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2021 (b)	1.737	1.734	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	8.540	8.968
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.11.2036	£ 894	1.734	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	6.606	6.722
France Government International Bond 1,100 % fällig am 25.07.2022	€ 511	629	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	5.967	6.180
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	\$ 330	337	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)	4.725	5.253
France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024	€ 106	133	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b)	3.710	4.523
			United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 2.141	3.744
			Mexico Government International Bond 7,250 % fällig am 09.12.2021	MXN 48.400	2.627

(a) Der Commodity Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds 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 Fondsbarmittel 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	4.667.433	\$ 46.492	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	5.060.446	\$ 50.400
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	\$ 4.123	4.386	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	\$ 4.123	4.360
U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	1.887	1.919	American Tower Corp. 3,800 % fällig am 15.08.2029	2.000	2.279
Netflix, Inc. 4,375 % fällig am 15.11.2026	1.400	1.475	Crown Castle International Corp. 3,100 % fällig am 15.11.2029	2.000	2.160
DaVita, Inc. 4,625 % fällig am 01.06.2030	1.200	1.196	AT&T, Inc. 4,100 % fällig am 15.02.2028	1.500	1.637
Southwest Airlines Co. 5,250 % fällig am 04.05.2025	1.000	1.107	Virgin Media Secured Finance PLC 5,250 % fällig am 15.05.2029	£ 1.100	1.549
Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN 3.200	1.107	Standard Industries, Inc. 4,750 % fällig am 15.01.2028	\$ 1.400	1.424
Delta Air Lines, Inc. 7,000 % fällig am 01.05.2025	\$ 1.000	1.038	Univision Communications, Inc. 5,125 % fällig am 15.02.2025	1.450	1.385
Community Health Systems, Inc. 6,625 % fällig am 15.02.2025	1.000	1.034	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024	1.200	1.269
Live Nation Entertainment, Inc. 6,500 % fällig am 15.05.2027	1.000	1.028	Dell International LLC 6,020 % fällig am 15.06.2026	1.100	1.269
American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 4,000 % fällig am 15.01.2028	1.000	998	NXP BV 3,875 % fällig am 18.06.2026	1.100	1.166
Rackspace Hosting, Inc. 4,000 % fällig am 03.11.2023	1.000	981	Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022	1.000	1.030
Advantage Sales & Marketing, Inc. 6,500 % fällig am 15.11.2028	900	911	Novatek OAO Via Novatek Finance DAC 4,422 % fällig am 13.12.2022	1.000	1.029
CSC Holdings LLC 4,125 % fällig am 01.12.2030	900	896	STORE Capital Corp. 4,625 % fällig am 15.03.2029	1.100	1.001
HSBC Holdings PLC 6,000 % fällig am 22.05.2027	800	868	Natwest Group PLC 4,269 % fällig am 22.03.2025	900	959
Citigroup, Inc. 5,950 % fällig am 15.05.2025	800	866	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. 6,720 % fällig am 01.12.2022	1.221	934
Boston Scientific Corp. 2,650 % fällig am 01.06.2030	800	808	Bank of America Corp. 5,875 % fällig am 15.03.2028	900	914
Fortune Brands Home & Security, Inc. 3,250 % fällig am 15.09.2029	800	805	Beacon Roofing Supply, Inc. 4,875 % fällig am 01.11.2025	900	907
General Electric Co. 4,250 % fällig am 01.05.2040	800	798	Fortune Brands Home & Security, Inc. 3,250 % fällig am 15.09.2029	800	894
Core & Main LP 3,750 % fällig am 01.08.2024	800	792	Banco do Brasil S.A. 4,875 % fällig am 19.04.2023	800	847

(a) Der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds 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 Fondsbarmittel 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	233.921.006	\$ 2.329.869	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	280.577.639	\$ 2.793.729
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	8.353.600	844.669		<b>PARI (000S)</b>	
	<b>PARI (000S)</b>		Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.12.2049	\$ 433.731	430.885
Italy Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.05.2020	€ 237.000	260.997	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.11.2049	337.710	335.493
	<b>AKTIEN</b>		Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.12.2049	285.458	300.696
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (a)	24.149.140	243.702		<b>AKTIEN</b>	
	<b>PARI (000S)</b>		PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	1.832.900	180.669
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,350 % fällig am 01.04.2030	€ 132.000	148.201		<b>PARI (000S)</b>	
Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 91.800	93.343	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,350 % fällig am 01.04.2030	€ 132.000	153.032
Saudi Government International Bond 4,500 % fällig am 26.10.2046	78.300	87.304	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.11.2049	\$ 135.124	134.237
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 3,000 % fällig am 29.06.2027	83.300	83.278	Turkey Government International Bond 5,750 % fällig am 22.03.2024	83.800	80.600
QNB Finance Ltd. 1,310 % fällig am 12.02.2022	79.200	79.200	Turkey Government International Bond 5,125 % fällig am 25.03.2022	66.500	65.643
Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026	€ 65.400	77.852	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.12.2049	58.873	58.487
Qatar Government International Bond 4,400 % fällig am 16.04.2050	\$ 64.200	73.563	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.01.2050	57.532	57.154
ZF Finance GmbH 3,750 % fällig am 21.09.2028	€ 58.300	68.620	Virgin Media Vendor Financing Notes DAC 4,875 % fällig am 15.07.2028	£ 37.200	48.627
Petroleos Mexicanos 6,625 % fällig am 15.06.2035	\$ 62.100	64.419	Netflix, Inc. 3,875 % fällig am 15.11.2029	€ 33.800	37.679
EQT Corp. 7,875 % fällig am 01.02.2025	67.935	63.473	Turkey Government International Bond 7,625 % fällig am 26.04.2029	\$ 31.600	32.957
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 2,700 % fällig am 02.09.2070	59.800	59.800	QNB Finance Ltd. 1,310 % fällig am 12.02.2022	32.900	32.900
UniCredit SpA 2,200 % fällig am 22.07.2027	€ 51.600	59.498	PCF GmbH 5,000 % fällig am 01.08.2024	€ 27.200	29.334
FEL Energy SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040	\$ 58.500	58.500	Petroleos Mexicanos 4,750 % fällig am 26.02.2029	27.050	28.142
	<b>AKTIEN</b>		Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.10.2049	\$ 27.904	27.721
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a)	5.124.030	58.000	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.12.2049	27.813	27.631
	<b>PARI (000S)</b>		Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 12.02.2021	€ 21.600	25.549
Wells Fargo & Co. 2,406 % fällig am 30.10.2025	\$ 51.700	53.041			
Ukraine Government International Bond 4,375 % fällig am 27.01.2030	€ 48.100	51.952			

(a) Der Diversified Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds 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 Fondsbarmittel 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	12.928.340	\$ 128.664	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	13.251.110	\$ 131.982
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (a)	5.046.705	50.940	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (a)	6.427.229	65.276
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	410.800	41.574			
			<b>PARI (000S)</b>		
QNB Finance Ltd. 1,295 % fällig am 12.02.2022	\$ 13.800	13.800	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.12.2049	\$ 20.767	21.646
Saudi Government International Bond 4,500 % fällig am 26.10.2046	8.400	9.357		<b>AKTIEN</b>	
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 3,000 % fällig am 29.06.2027	9.200	9.197	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	160.400	16.214
Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	7.800	7.918		<b>PARI (000S)</b>	
Qatar Government International Bond 4,400 % fällig am 16.04.2050	5.900	6.928	Turkey Government International Bond 5,125 % fällig am 25.03.2022	\$ 8.300	8.193
Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026	€ 5.400	6.431	DISH DBS Corp. 6,750 % fällig am 01.06.2021	4.400	4.598
EQT Corp. 6,125 % fällig am 01.02.2025	\$ 6.800	6.348	Virgin Media Vendor Financing Notes DAC 4,875 % fällig am 15.07.2028	£ 3.000	3.921
			Turkey Government International Bond 5,750 % fällig am 22.03.2024	\$ 3.900	3.752
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (a)	538.168	5.923	Netflix, Inc. 3,875 % fällig am 15.11.2029	€ 2.600	2.897
			Charter Communications Operating LLC 4,464 % fällig am 23.07.2022	\$ 2.600	2.752
ZF Finance GmbH 3,750 % fällig am 21.09.2028	€ 5.000	5.885	Petroleos Mexicanos 4,750 % fällig am 26.02.2029	€ 2.600	2.706
Ukraine Government International Bond 4,375 % fällig am 27.01.2030	5.800	5.822	PCF GmbH 6,000 % fällig am 01.08.2024	2.400	2.603
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 2,700 % fällig am 02.09.2070	\$ 5.600	5.600	Ziggo BV 4,875 % fällig am 15.01.2030	\$ 2.500	2.587
Virgin Media Secured Finance PLC 4,125 % fällig am 15.08.2030	£ 4.400	5.495	Bacardi Ltd. 4,700 % fällig am 15.05.2028	2.500	2.568
Wells Fargo & Co. 2,406 % fällig am 30.10.2025	\$ 5.200	5.335	Turkey Government International Bond 7,625 % fällig am 26.04.2029	2.300	2.393
Lloyds Banking Group PLC 4,450 % fällig am 08.05.2025	4.700	5.172	China Evergrande Group 9,500 % fällig am 11.04.2022	2.500	2.374
FEL Energy SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040	4.900	4.900	Virgin Media Secured Finance PLC 4,500 % fällig am 15.08.2030	2.300	2.360
Volkswagen International Finance NV 3,875 % fällig am 17.06.2029	€ 4.300	4.881	Weyerhaeuser Co. 4,000 % fällig am 15.04.2030	2.000	2.351
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,300 % fällig am 23.06.2025	\$ 4.700	4.720	Ziggo BV 4,875 % fällig am 15.01.2030	2.200	2.276
			Oracle Corp. 3,850 % fällig am 01.04.2060	1.900	2.208

(a) Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds 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 Fondsbarmittel 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)	BESCHREIBUNG			ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020				VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020			
	AKTIEN				AKTIEN		
PIMCO Select Funds plc - US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	75.357.584	\$	750.389	PIMCO Select Funds plc - US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	84.264.347	\$	839.400
	<b>PARI (000S)</b>				<b>PARI (000S)</b>		
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	894.100	61.051	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.05.2049	\$	180.070	190.708
U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030	\$	41.900	41.726	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)		69.091	73.634
China Development Bank 3,230 % fällig am 10.01.2025	CNY	258.200	38.189	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)		67.607	71.735
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	\$	35.300	37.481	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.07.2022		62.200	64.548
China Development Bank 3,340 % fällig am 14.07.2025	CNY	230.200	34.155	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.11.2048		27.149	28.753
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	\$	18.589	19.350	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)		23.770	25.193
QNB Finance Ltd. 1,303 % fällig am 12.02.2022		19.100	19.100	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)		18.771	19.145
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)		18.479	19.035	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 15.08.2050		14.900	14.281
	<b>AKTIEN</b>			Saudi Government International Bond 4,500 % fällig am 17.04.2030		11.000	12.664
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (a)	1.496.908		15.000	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)		9.005	9.958
	<b>PARI (000S)</b>			Heathrow Finance PLC 5,250 % fällig am 01.03.2024	£	6.400	8.999
U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 15.08.2050	\$	14.900	14.045	Türkiye Is Bankasi A/S 7,750 % fällig am 22.01.2030	\$	8.400	8.206
U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.08.2025		12.200	12.188	Goldman Sachs Group, Inc. 2,876 % fällig am 31.10.2022		7.900	8.034
Enbridge, Inc. 0,720 % fällig am 18.02.2022		11.300	11.300	QBE Insurance Group Ltd. 7,500 % fällig am 24.11.2043		7.000	7.886
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 4,000 % fällig am 01.05.2031		10.400	10.400	Ziggo BV 4,875 % fällig am 15.01.2030		7.300	7.775
Ares European CLO Designated Activity Co. 1,120 % fällig am 21.10.2033	€	8.500	10.042	Lloyds Banking Group PLC 2,858 % fällig am 17.03.2023		7.500	7.715
Durham Mortgages B PLC 0,651 % fällig am 31.03.2054	£	7.003	9.146	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.12.2048		5.686	6.054
T-Mobile USA, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2030	\$	9.000	8.935	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % fällig am 29.03.2024	€	4.800	5.957
Finsbury Square PLC 0,854 % fällig am 16.03.2070	£	6.800	8.909	General Motors Financial Co., Inc. 3,550 % fällig am 08.07.2022		5.700	5.927
Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	\$	8.600	8.600				
Türkiye Is Bankasi A/S 7,750 % fällig am 22.01.2030		8.400	8.400				

(a) Der Dynamic Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds 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 Fondsbarmittel 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	3.855.900	€ 384.698	Bundesrepublik Deutschland 0,250 % fällig am 16.10.2020	€ 68.300	€ 68.548
Invesco Physical Gold ETC	1.302.900	198.705			
				<b>AKTIEN</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$ 193.196	181.582	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund (a)	4.821.376	68.353
			PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	606.000	60.456
Invesco Physical Gold ETC	687.500	106.524	Apple, Inc.	198.180	34.683
				<b>PARI (000S)</b>	
Bundesrepublik Deutschland 0,250 % fällig am 16.10.2020	€ 104.300	104.981	France Government International Bond 2,500 % fällig am 25.10.2020	€ 33.500	33.915
France Government International Bond 2,500 % fällig am 25.10.2020	79.250	80.667		<b>AKTIEN</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.02.2041 (b)	\$ 55.964	74.001	QUALCOMM, Inc.	333.500	29.118
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 10.02.2021	€ 61.070	61.207	Bristol-Myers Squibb Co.	441.800	26.983
			Xilinx, Inc.	202.500	22.690
Stora Enso Oyj 'R'	3.242.700	46.712	Pinduoduo, Inc. ADR	310.200	19.434
UPM-Kymmene Oyj	1.593.800	43.143	Facebook, Inc. 'A'	80.000	18.477
Samsung Electronics Co. Ltd.	892.200	40.327	Micron Technology, Inc.	409.200	17.710
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	2.987.000	38.873	JOYY, Inc. ADR	251.200	16.042
SolarEdge Technologies, Inc.	202.100	31.565	Semiconductor Manufacturing International Corp.	7.199.000	14.671
Baidu, Inc. SP - ADR	240.200	29.250	JD.com, Inc.	261.400	13.562
			Bilibili, Inc. ADR	419.700	13.238
Germany Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.09.2020	€ 28.710	28.750	Microsoft Corp.	71.885	13.094
			Alexion Pharmaceuticals, Inc.	97.400	12.500
Mondi PLC	1.520.600	28.304	Accenture PLC 'A'	53.930	10.556
NetEase, Inc. ADR	136.600	26.840	Tencent Holdings Ltd.	170.200	10.337
First Solar, Inc.	410.200	24.008	Alibaba Group Holding Ltd.	350.150	9.619
Arista Networks, Inc.	110.300	23.200	Twitter, Inc.	277.600	8.850
			Centene Corp.	139.900	8.779
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.02.2044 (b)	\$ 19.548	22.903	Fortinet, Inc.	62.500	8.114
				<b>PARI (000S)</b>	
			Contemporary Ruiding Development Ltd. 1,875 % fällig am 17.09.2025	\$ 9.600	8.112
				<b>AKTIEN</b>	
			PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (a)	783.835	7.978
			Omron Corp.	117.100	7.914
			NetEase, Inc. ADR	20.384	7.853
			ANTA Sports Products Ltd.	947.950	7.764
				<b>PARI (000S)</b>	
			Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,650 % fällig am 01.11.2020	€ 7.675	7.733
			U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$ 7.383	6.953

(a) Der Dynamic Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds 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 Fondsbarmittel 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 (000\$)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		238.370.049	\$ 2.377.637
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		1.440.400	146.120
		<b>PARI (000\$)</b>	
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	1.704.700	130.911
China Development Bank 3,000 % fällig am 07.08.2023	CNY	510.900	77.344
QNB Finance Ltd. 6,800 % fällig am 04.03.2030	IDR	951.700.000	66.632
China Development Bank 4,040 % fällig am 10.04.2027	CNY	441.000	65.448
Russia Government International Bond 7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB	3.546.000	60.454
Mexico Government International Bond 6,750 % fällig am 09.03.2023	MXN	1.052.700	55.115
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,000 % fällig am 01.03.2023	CLP	32.480.000	43.566
China Development Bank 1,860 % fällig am 09.04.2023	CNY	301.100	42.889
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 2,300 % fällig am 01.10.2028	CLP	31.345.000	40.762
China Development Bank 3,420 % fällig am 02.07.2024	CNY	260.700	39.398
Thailand Government International Bond 3,300 % fällig am 17.06.2038	THB	982.250	39.168
Mexico Government International Bond 7,750 % fällig am 13.11.2042	MXN	797.900	39.070
Romania Government International Bond 4,500 % fällig am 17.06.2024	RON	145.300	34.712
China Development Bank 4,040 % fällig am 06.07.2028	CNY	230.000	34.507
Poland Government International Bond 2,750 % fällig am 25.04.2028	PLN	116.200	33.887
China Government Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027	CNY	210.000	32.439
JPMorgan Chase Bank N.A. 7,500 % fällig am 18.08.2032	IDR	437.430.000	32.173
Malaysia Government International Bond 3,502 % fällig am 31.05.2027	MYR	125.800	31.027

BESCHREIBUNG			AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		235.309.644	\$	2.347.856
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		1.663.608		166.061
		<b>PARI (000\$)</b>		
Poland Government International Bond 3,250 % fällig am 25.07.2025	PLN	332.400		96.846
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,000 % fällig am 01.03.2023	CLP	49.800.000		62.844
Hungary Government International Bond 1,500 % fällig am 24.08.2022	HUF	15.838.100		54.559
South Africa Government International Bond 7,750 % fällig am 28.02.2023	ZAR	679.800		47.312
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026		664.600		44.496
Colombian TES 7,750 % fällig am 18.09.2030	COP	134.009.000		43.807
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,500 % fällig am 01.03.2026	CLP	32.820.000		42.200
Colombian TES 7,000 % fällig am 04.05.2022	COP	129.047.800		39.230
Hungary Government International Bond 2,750 % fällig am 22.12.2026	HUF	11.037.300		38.508
Turkey Government International Bond 0,000 % fällig am 16.09.2020	TRY	239.600		37.975
Export-Import Bank of Korea 6,710 % fällig am 25.11.2024	IDR	485.000.000		35.746
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN	90.500		34.369
Colombian TES 6,000 % fällig am 28.04.2028	COP	111.346.700		33.919
Mexico Government International Bond 6,750 % fällig am 09.03.2023	MXN	641.800		33.569
Mexico Government International Bond 8,000 % fällig am 07.12.2023		608.000		33.217
Russia Government International Bond 7,700 % fällig am 23.03.2033	RUB	2.083.700		32.278
China Development Bank 4,040 % fällig am 10.04.2027	CNY	211.900		31.995
Mexico Government International Bond 7,250 % fällig am 09.12.2021	MXN	607.700		31.976

(a) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds 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 Fondsbarmittel 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)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	214.501.279	\$ 2.139.067
	<b>PARI (000S)</b>	
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 859.600	65.838
Saudi Government International Bond 4,500 % fällig am 26.10.2046	\$ 37.200	44.556
Saudi Arabian Oil Co. 3,500 % fällig am 24.11.2070	43.400	43.836
Petroleos Mexicanos 5,950 % fällig am 28.01.2031	44.900	41.493
Petroleos Mexicanos 6,950 % fällig am 28.01.2060	45.680	41.368
Saudi Government International Bond 4,500 % fällig am 22.04.2060	35.500	38.457
<b>Emirate of Abu Dhabi Government International Bond</b> 3,125 % fällig am 16.04.2030	31.200	32.725
Chile Government International Bond 1,250 % fällig am 29.01.2040	€ 29.600	32.568
Mexico Government International Bond 3,771 % fällig am 24.05.2061	\$ 30.000	30.000
Egypt Government International Bond 6,125 % fällig am 31.01.2022	28.574	29.734
Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2021	27.980	28.998
Egypt Government International Bond 7,625 % fällig am 29.05.2032	26.600	26.563
Turkey Government International Bond 5,950 % fällig am 15.01.2031	26.000	26.495
<b>Dominican Republic Government International Bond</b> 4,875 % fällig am 23.09.2032	25.300	26.419
Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	€ 23.200	26.344
Turkey Government International Bond 5,750 % fällig am 11.05.2047	\$ 33.500	25.893
Saudi Government International Bond 3,750 % fällig am 21.01.2055	25.300	25.830
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd. 3,250 % fällig am 15.08.2030	25.800	25.643
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd. 2,625 % fällig am 31.03.2036	24.800	24.795

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	200.881.756	\$ 2.002.500
	<b>PARI (000S)</b>	
Turkey Government International Bond 6,350 % fällig am 10.08.2024	\$ 46.000	46.892
Russia Government International Bond 7,700 % fällig am 23.03.2033	RUB 2.597.500	46.031
Hazine Mustesarliği Varlik Kiralama A/S 5,800 % fällig am 21.02.2022	\$ 40.900	40.141
Saudi Government International Bond 4,500 % fällig am 22.04.2060	31.400	39.374
Serbia Government International Bond 1,500 % fällig am 26.06.2029	€ 28.900	32.332
Oman Government International Bond 6,000 % fällig am 01.08.2029	\$ 37.900	31.242
Chile Government International Bond 1,250 % fällig am 29.01.2040	€ 30.400	30.145
Saudi Government International Bond 4,375 % fällig am 16.04.2029	\$ 26.100	28.253
Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2021	25.000	26.125
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd. 2,625 % fällig am 31.03.2036	24.800	25.547
Republic of Belarus Ministry of Finance 6,378 % fällig am 24.02.2031	23.700	23.579
Kenya Government International Bond 6,875 % fällig am 24.06.2024	24.932	23.284
Ukraine Government International Bond 7,253 % fällig am 15.03.2033	22.300	22.035
Samba Funding Ltd. 2,750 % fällig am 02.10.2024	21.500	20.601
Saudi Government International Bond 2,000 % fällig am 09.07.2039	€ 20.000	20.339
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.11.2049	\$ 19.829	19.648
Egypt Government International Bond 7,625 % fällig am 29.05.2032	19.500	19.193
Petroleos Mexicanos 7,690 % fällig am 23.01.2050	22.900	18.719
Brazil Government International Bond 4,750 % fällig am 14.01.2050	19.000	18.714

(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)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
Egypt Government International Bond 5,250 % fällig am 06.10.2025	\$ 29.700	\$ 29.918
Hungary Government International Bond 1,750 % fällig am 05.06.2035	€ 15.200	17.947
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 225.600	17.380
Egypt Government International Bond 7,625 % fällig am 29.05.2032	\$ 13.600	13.686
Ukraine Government International Bond 7,253 % fällig am 15.03.2033	13.800	13.597
Brazil Government International Bond 4,750 % fällig am 14.01.2050	11.700	12.458
Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2021	11.800	12.195
South Africa Government International Bond 4,300 % fällig am 12.10.2028	12.000	11.673
Panama Government International Bond 4,500 % fällig am 01.04.2056	9.300	10.076
Peru Government International Bond 2,780 % fällig am 01.12.2060	10.200	10.067
Oman Government International Bond 6,750 % fällig am 28.10.2027	9.600	9.694
Kenya Government International Bond 8,000 % fällig am 22.05.2032	8.200	9.585
Dominican Republic Government International Bond 5,875 % fällig am 30.01.2060	9.700	9.559
India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	9.400	9.469
Ivory Coast Government International Bond 5,750 % fällig am 31.12.2032	9.213	9.162
Bank of America Corp. 0,981 % fällig am 25.09.2025	8.700	8.700
Uruguay Government International Bond 4,375 % fällig am 23.01.2031	7.000	8.444
Malaysia Sukuk Global Bhd. 3,179 % fällig am 27.04.2026	7.400	8.159
Serbia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.05.2027	€ 6.600	7.948
Ecuador Government International Bond 0,500 % fällig am 31.07.2035	\$ 13.900	7.844

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
Russia Government International Bond 7,700 % fällig am 23.03.2033	RUB 473.300	\$ 8.387
Turkey Government International Bond 5,600 % fällig am 14.11.2024	\$ 6.900	7.145
Brazil Government International Bond 4,750 % fällig am 14.01.2050	6.900	6.751
Serbia Government International Bond 1,500 % fällig am 26.06.2029	€ 5.900	6.686
Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2021	\$ 6.100	6.375
Ukraine Government International Bond 7,253 % fällig am 15.03.2033	6.400	6.307
Dominican Republic Government International Bond 6,000 % fällig am 19.07.2028	5.400	5.636
Chile Government International Bond 1,250 % fällig am 29.01.2040	€ 5.100	5.363
Tencent Holdings Ltd. 3,975 % fällig am 11.04.2029	\$ 4.800	5.340
Mexico Government International Bond 3,250 % fällig am 16.04.2030	5.268	5.286
Russia Government International Bond 5,100 % fällig am 28.03.2035	3.600	4.284
Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 15.03.2115	€ 3.200	4.258
Egypt Government International Bond 7,625 % fällig am 29.05.2032	\$ 4.300	4.208
Dominican Republic Government International Bond 6,400 % fällig am 05.06.2049	4.100	4.104
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 5,800 % fällig am 21.02.2022	4.000	3.941
Turkey Government International Bond 6,000 % fällig am 25.03.2027	4.250	3.916
Turkey Government International Bond 7,250 % fällig am 23.12.2023	3.500	3.819
Ghana Government International Bond 8,950 % fällig am 26.03.2051	4.000	3.691
Ukraine Government International Bond 6,750 % fällig am 20.06.2026	€ 3.000	3.551
Adani Renewable Energy RJ Ltd. 4,625 % fällig am 15.10.2039	\$ 3.400	3.485
Albania Government International Bond 3,500 % fällig am 16.06.2027	€ 2.800	3.405
Turkey Government International Bond 6,350 % fällig am 10.08.2024	\$ 3.200	3.399
Guatemala Government International Bond 5,750 % fällig am 06.06.2022	3.200	3.387
Dominican Republic Government International Bond 5,500 % fällig am 27.01.2025	3.000	3.278
Republic of Belarus Ministry of Finance 6,378 % fällig am 24.02.2031	3.200	3.273
Ukraine Government International Bond 4,375 % fällig am 27.01.2030	€ 2.900	3.250
Kenya Government International Bond 7,000 % fällig am 22.05.2027	\$ 3.300	3.125
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,700 % fällig am 01.09.2030	CLP 2.315.000	3.078
JSL Europe S.A. 7,750 % fällig am 26.07.2024	\$ 2.900	2.844
Mexico Government International Bond 4,500 % fällig am 31.01.2050	2.662	2.818
Ukraine Government International Bond 7,375 % fällig am 25.09.2032	2.600	2.595
Mexico Government International Bond 5,750 % fällig am 12.10.2110	2.100	2.440
Qatar Government International Bond 4,400 % fällig am 16.04.2050	1.800	2.336

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 Teilfondsvermögen 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	19.464.641	\$ 194.176
	<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045	\$ 9.300	10.581
BOC Aviation Ltd. 2,625 % fällig am 17.09.2030	4.100	4.091
BanColombia S.A. 3,000 % fällig am 29.01.2025	3.200	3.177
Banco Daycoval S.A. 4,250 % fällig am 13.12.2024	2.800	2.815
Lamar Funding Ltd. 3,958 % fällig am 07.05.2025	2.800	2.784
First Quantum Minerals Ltd. 6,875 % fällig am 15.10.2027	2.700	2.700
Saudi Arabian Oil Co. 3,250 % fällig am 24.11.2050	2.700	2.674
Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	2.500	2.497
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 4,950 % fällig am 23.03.2027	2.200	2.490
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,250 % fällig am 23.05.2023	2.300	2.462
Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % fällig am 10.01.2025	2.400	2.424
Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3,050 % fällig am 23.01.2025	2.400	2.400
Saudi Arabian Oil Co. 2,250 % fällig am 24.11.2030	2.400	2.386
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 3,250 % fällig am 25.02.2030	2.300	2.300
Banco Santander Mexico S.A. 5,375 % fällig am 17.04.2025	2.000	2.218
Hikma Finance USA LLC 3,250 % fällig am 09.07.2025	2.200	2.175
Stillwater Mining Co. 7,125 % fällig am 27.06.2025	1.990	2.109
Lukoil Securities BV 3,875 % fällig am 06.05.2030	2.000	2.094
First Abu Dhabi Bank PJSC 3,000 % fällig am 30.03.2022	2.000	2.073

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	20.233.812	\$ 201.900
	<b>PARI (000S)</b>	
Banco Daycoval S.A. 4,250 % fällig am 13.12.2024	\$ 2.800	2.750
Constellation Oil Services Holding S.A. 10,000 % fällig am 09.11.2024	5.093	2.674
Vale Overseas Ltd. 6,875 % fällig am 10.11.2039	1.900	2.559
DP World Crescent Ltd. 3,908 % fällig am 31.05.2023	2.321	2.460
Adaro Indonesia PT 4,250 % fällig am 31.10.2024	2.200	2.207
African Export-Import Bank 4,125 % fällig am 20.06.2024	2.100	2.185
MAF Sukuk Ltd. 4,500 % fällig am 03.11.2025	2.000	2.135
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 3,250 % fällig am 25.02.2030	2.300	2.116
SURA Asset Management S.A. 4,875 % fällig am 17.04.2024	1.900	2.077
First Abu Dhabi Bank PJSC 3,000 % fällig am 30.03.2022	2.000	2.063
Türkiye İş Bankası A/S 7,750 % fällig am 22.01.2030	2.000	2.034
Banco do Brasil S.A. 4,750 % fällig am 20.03.2024	1.900	1.899
First Quantum Minerals Ltd. 6,875 % fällig am 15.10.2027	1.800	1.843
GLP Pte. Ltd. 3,875 % fällig am 04.06.2025	1.800	1.842
Horse Gallop Finance Ltd. 1,431 % fällig am 28.06.2021	1.800	1.777
Yapı ve Kredi Bankası A/S 5,750 % fällig am 24.02.2022	1.800	1.665
CSN Islands XI Corp. 6,750 % fällig am 28.01.2028	1.700	1.663
Minejesa Capital BV 4,625 % fällig am 10.08.2030	1.700	1.646
VLL International, Inc. 5,750 % fällig am 28.11.2024	1.650	1.635

(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			KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG			ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020				VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		13.695.803	\$ 136.660	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		13.200.550	\$ 131.652
			<b>PARI (000S)</b>				<b>PARI (000S)</b>
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 05.04.2022	COP	85.650.000	24.554	Republic of Colombia 1,000 % fällig am 05.04.2022	COP	85.650.000	24.681
Israel Government International Bond 1,250 % fällig am 30.11.2022	ILS	51.900	15.405				<b>AKTIEN</b>
			<b>AKTIEN</b>	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		207.600	21.091
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		100.900	10.216				<b>PARI (000S)</b>
			<b>PARI (000S)</b>	Israel Government International Bond 1,250 % fällig am 30.11.2022	ILS	51.900	15.489
South Africa Government International Bond 7,750 % fällig am 28.02.2023	ZAR	127.500	8.593	Mexico Government International Bond 7,250 % fällig am 12.09.2021	MXN	145.900	7.659
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN	22.600	8.318	South Africa Government International Bond 7,750 % fällig am 28.02.2023	ZAR	96.400	6.709
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	87.800	6.708	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026		87.800	6.352
Mexico Government International Bond 7,750 % fällig am 13.11.2042	MXN	129.200	6.584	Mexico Government International Bond 6,500 % fällig am 06.09.2022	MXN	109.000	5.613
Malaysia Government Investment Issue 4,128 % fällig am 15.08.2025	MYR	20.000	5.153	Hungary Government International Bond 1,500 % fällig am 24.08.2022	HUF	1.235.000	4.286
			<b>AKTIEN</b>	Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,000 % fällig am 03.01.2023	CLP	2.885.000	3.623
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a)		367.599	4.190	Poland Government International Bond 0,690 % fällig am 25.05.2025	PLN	13.800	3.502
			<b>PARI (000S)</b>	Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,500 % fällig am 01.03.2026	CLP	2.545.000	3.418
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 2,300 % fällig am 01.10.2028	CLP	3.145.000	4.090	Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 2,300 % fällig am 01.10.2028		2.555.000	3.337
Malaysia Government International Bond 3,882 % fällig am 14.03.2025	MYR	14.000	3.540	Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN	8.000	3.051
Malaysia Government International Bond 3,955 % fällig am 15.09.2025		13.700	3.516	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 12.01.2049	\$	2.689	2.665
Poland Government International Bond 0,690 % fällig am 25.05.2025	PLN	13.800	3.284	Daimler Finance North America LLC 3,400 % fällig am 22.02.2022		2.500	2.568
Ghana Government International Bond 20,750 % fällig am 16.01.2023	GHS	17.200	3.137	Broadcom, Inc. 3,125 % fällig am 04.15.2021		2.500	2.534
Hungary Government International Bond 3,250 % fällig am 22.10.2031	HUF	819.000	2.933	Guatemala Government International Bond 5,750 % fällig am 06.06.2022		2.400	2.478
Dominican Republic Government International Bond 9,750 % fällig am 05.06.2026	DOP	154.500	2.590	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 12.01.2049		2.131	2.111
Namibia Government International Bond 5,500 % fällig am 03.11.2021	\$	2.200	2.225	GE Capital International Funding Co. Unlimited Co. 2,342 % fällig am 11.15.2020		2.100	2.107
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 24.07.2024	COP	6.489.000	2.151				
Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025		6.753.800	2.141				

(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	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.324.398	\$ 33.128	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.292.561	\$ 32.800
	<b>PARI (000S)</b>		PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	52.812	5.272
Mexico Government International Bond 6,500 % fällig am 09.06.2022	MXN 85.100	3.905		<b>PARI (000S)</b>	
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,000 % fällig am 01.03.2023	CLP 1.990.000	2.648	Mexico Government International Bond 6,500 % fällig am 09.06.2022	MXN 85.100	3.931
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,500 % fällig am 01.03.2021	2.025.000	2.624	Mexico Government International Bond 7,250 % fällig am 09.12.2021	69.000	3.401
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 27.800	2.029	Colombian TES 7,000 % fällig am 04.05.2022	COP 10.986.800	3.041
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN 4.300	1.610	Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,000 % fällig am 01.03.2023	CLP 2.360.000	2.964
Malaysia Government International Bond 3,659 % fällig am 15.10.2020	MYR 6.800	1.605	Hungary Government International Bond 1,500 % fällig am 24.08.2022	HUF 809.600	2.603
	<b>AKTIEN</b>		Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN 5.500	2.063
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	15.300	1.555	Malaysia Government International Bond 3,659 % fällig am 15.10.2020	MYR 6.800	1.630
	<b>PARI (000S)</b>		Hungary Government International Bond 2,500 % fällig am 27.10.2021	HUF 383.200	1.244
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 0,000 % fällig am 01.07.2021	CLP 1.010.000	1.357	Hungary Government International Bond 5,375 % fällig am 21.02.2023	\$ 1.100	1.215
China Development Bank 4,880 % fällig am 09.02.2028	CNY 7.500	1.187	China Development Bank 4,880 % fällig am 09.02.2028	CNY 7.500	1.182
Mexico Government International Bond 8,000 % fällig am 07.12.2023	MXN 19.200	1.059	Mexico Government International Bond 8,000 % fällig am 07.12.2023	MXN 19.200	943
Israel Government International Bond 1,250 % fällig am 30.11.2022	ILS 2.700	849	Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,500 % fällig am 01.03.2026	CLP 655.000	880
Hungary Government International Bond 5,375 % fällig am 21.02.2023	\$ 700	771	Deutsche Bank AG 4,250 % fällig am 14.10.2021	\$ 800	822
South Africa Government International Bond 7,750 % fällig am 28.02.2023	ZAR 9.500	680	Guatemala Government International Bond 5,750 % fällig am 06.06.2022	700	735
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 24.07.2024	COP 1.953.000	647	South Africa Government International Bond 7,750 % fällig am 28.02.2023	ZAR 9.500	661
Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 600	610	Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 600	610
Petroleos Mexicanos 7,190 % fällig am 12.09.2024	MXN 16.500	577	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 9.000	609
Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN 1.500	511	Sempre Energy 0,667 % fällig am 15.03.2021	\$ 600	601
Citigroup Mortgage Loan Trust 0,625 % fällig am 25.03.2037	\$ 500	486			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 8,875 % fällig am 14.04.2021	€ 400	479			

(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			KOSTEN (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020			
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		2.805.000	€ 274.828
		<b>PARI (000S)</b>	
Bundesrepublik Deutschland 0,250 % fällig am 16.10.2020	€	80.630	81.094
Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030		50.700	52.631
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,500 % fällig am 01.02.2026		46.300	47.353
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	310.700	41.165
France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.11.2020	€	39.850	40.053
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028		34.600	35.764
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,850 % fällig am 01.07.2025		34.600	34.483
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	232.100	31.163
Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	€	29.200	30.207
France Government International Bond 2,500 % fällig am 25.10.2020		28.250	28.765
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£	13.054	28.423
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$	29.532	28.132
		<b>AKTIEN</b>	
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		272.500	27.245
		<b>PARI (000S)</b>	
Spain Government International Bond 0,800 % fällig am 30.07.2027	€	23.500	24.843
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,800 % fällig am 01.03.2067		17.400	23.076
Europäische Investitionsbank 0,000 % fällig am 28.03.2028		22.200	23.035
Spain Government International Bond 1,000 % fällig am 31.10.2050		22.600	22.916
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 02.09.2020		22.300	22.326
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	152.100	20.344
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.07.2022		139.900	19.248
U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.12.2024	\$	21.120	19.061
Jupiter Mortgage Ltd. 1,000 % fällig am 01.06.2060	£	16.600	18.276
Germany Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2021	€	17.880	17.928
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,450 % fällig am 01.09.2050		17.300	17.175

BESCHREIBUNG			AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020				
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		2.145.500	€	213.257
		<b>PARI (000S)</b>		
Bundesrepublik Deutschland 0,250 % fällig am 16.10.2020	€	78.206		78.525
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,700 % fällig am 01.03.2047		53.700		61.407
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	\$	63.628		57.273
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)		50.604		49.444
Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	€	50.200		49.390
France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.11.2020		39.850		40.004
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	\$	40.183		37.601
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,350 % fällig am 01.02.2025	€	37.900		35.538
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£	13.045		26.005
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,450 % fällig am 01.09.2050	€	17.300		21.409
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 02.09.2020		20.200		20.222
Spain Government International Bond 1,500 % fällig am 30.04.2027		17.800		19.707
France Government International Bond 2,500 % fällig am 25.10.2020		19.250		19.505
U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.12.2024	\$	21.120		19.171
Germany Treasury Bills 0,000 % fällig am 09.04.2021	€	17.880		17.927
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,010 % fällig am 04.03.2030		14.800		15.322
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK	109.600		14.936
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 24.04.2023	€	14.100		14.331
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$	13.243		13.669
Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	€	12.000		13.320
Spain Government International Bond 3,450 % fällig am 30.07.2066		7.000		12.730
Europäische Investitionsbank 0,050 % fällig am 16.01.2030		11.700		12.083
Cars Alliance Auto Loans France 0,000 % fällig am 21.10.2029		11.972		11.992
Ireland Government International Bond 1,350 % fällig am 18.03.2031		10.700		11.798

(a) Der Euro 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	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	2.020.800	€ 198.698	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	1.823.300	€ 179.443
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 90.400	12.153	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 99.938	13.779
Abertis Infraestructuras S.A. 2,250 % fällig am 29.03.2029	€ 10.100	10.065	Santander UK Group Holdings PLC 2,875 % fällig am 05.08.2021	\$ 10.400	9.019
Citigroup, Inc. 0,000 % fällig am 21.03.2023	9.200	9.155	Utah Acquisition Sub, Inc. 3,125 % fällig am 22.11.2028	€ 8.500	8.935
Santander UK Group Holdings PLC 3,625 % fällig am 14.01.2026	£ 7.400	8.989	Schaeffler Finance BV 3,250 % fällig am 15.05.2025	6.700	6.880
BPCE S.A. 0,500 % fällig am 15.09.2027	€ 8.400	8.334	Dell International LLC 4,000 % fällig am 15.07.2024	\$ 7.600	6.872
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 50.200	6.725	JPMorgan Chase & Co 4,500 % fällig am 24.01.2022	6.222	5.826
Petroleos Mexicanos 4,875 % fällig am 21.02.2028	€ 6.200	6.687	Worldline S.A. 0,875 % fällig am 30.06.2027	€ 5.500	5.734
Ares European CLO Designated Activity Co. 1,120 % fällig am 21.10.2033	6.600	6.600	HSBC Holdings PLC 3,400 % fällig am 03.08.2021	\$ 6.200	5.717
QNB Finance Ltd. 1,310 % fällig am 12.02.2022	\$ 7.100	6.432	Jyske Realkredit A/S 0,250 % fällig am 13.01.2026	DKK 41.300	5.420
Nykredit Realkredit A/S 0,250 % fällig am 13.01.2026	€ 6.400	6.392	Tauron Polska Energia S.A. 2,375 % fällig am 07.05.2027	€ 5.300	5.310
JPMorgan Chase & Co. 4,203 % fällig am 23.07.2029	\$ 6.200	6.356	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 37.690	5.197
UniCredit SpA 2,200 % fällig am 22.07.2027	€ 6.200	6.338	UniCredit SpA 3,750 % fällig am 04.12.2022	\$ 5.700	5.047
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,125 % fällig am 15.10.2024	6.700	6.181	Clydesdale Bank PLC 2,250 % fällig am 21.04.2020	£ 4.200	4.932
Jupiter Mortgage Ltd. 1,000 % fällig am 01.06.2060	£ 5.500	6.055	Infineon Technologies AG 2,000 % fällig am 24.06.2032	€ 4.300	4.857
Renault S.A. 1,250 % fällig am 24.06.2025	€ 6.000	5.989	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,875 % fällig am 16.07.2024	4.100	4.547
Vonovia Finance BV 0,625 % fällig am 09.07.2026	6.000	5.981	Cappgemini SE 0,625 % fällig am 23.06.2025	4.300	4.431
HSBC Holdings PLC 3,950 % fällig am 18.05.2024	\$ 6.200	5.920	Agence Francaise de Developpement 2,750 % fällig am 22.03.2021	\$ 4.800	4.373
AMCO - Asset Management Co. SpA 2,625 % fällig am 13.02.2024	€ 5.500	5.814	Cappgemini SE 1,125 % fällig am 23.06.2030	€ 4.100	4.361
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 43.300	5.811	Svenska Handelsbanken Ab 0,500 % fällig am 18.02.2030	4.900	4.291

(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 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)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (a)	13.154.723	€ 120.722
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	371.500	36.773
	<b>PARI (000S)</b>	
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 224.100	30.047
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	197.400	26.497
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	172.900	23.209
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,625 % fällig am 24.09.2024	€ 21.900	22.746
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 162.600	21.781
QNB Finance Ltd. 1,303 % fällig am 12.02.2022	\$ 22.700	20.564
ZF Finance GmbH 3,000 % fällig am 21.09.2025	€ 19.400	19.289
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 143.000	19.161
Ares European CLO Designated Activity Co. 1,12 % fällig am 21.10.2033	€ 18.500	18.500
Jupiter Mortgage Ltd. 1,000 % fällig am 01.06.2060	£ 15.500	17.065
Aeroporti di Roma SpA 5,441 % fällig am 20.02.2023	14.100	17.030
	<b>AKTIEN</b>	
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (a)	1.694.264	17.000
	<b>PARI (000S)</b>	
Worldline S.A. 0,500 % fällig am 30.06.2023	€ 16.300	16.309
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 1,550 % fällig am 20.07.2031	16.300	16.300
Bastille Funding Designated Activity Co. 1,150 % fällig am 15.01.2034	16.200	16.200
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 119.300	15.984
Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % fällig am 09.10.2025	€ 15.900	15.900
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	15.400	15.362
HSBC Holdings PLC 1,589 % fällig am 24.05.2027	\$ 17.500	14.736
Service Properties Trust 4,350 % fällig am 01.10.2024	15.400	14.598
Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 20.01.2027	€ 14.200	14.239

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	3.438.680	€ 341.443
	<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.12.2049	\$ 151.379	147.926
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 382.681	52.723
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.12.2049	\$ 53.353	47.472
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.11.2049	43.843	39.011
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.01.2050	25.032	22.273
UniCredit Bank AG 1,875 % fällig am 05.07.2022	25.000	21.982
Jyske Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 14.859	20.455
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,500 % fällig am 01.10.2050	133.475	18.389
Worldline S.A. 0,500 % fällig am 30.06.2023	€ 16.300	16.580
Tauron Polska Energia S.A. 2,375 % fällig am 05.07.2027	14.900	14.928
Service Properties Trust 4,350 % fällig am 01.10.2024	\$ 16.100	12.422
BMW Finance NV 2,250 % fällig am 12.08.2022	13.300	11.764
Silverstone Master Issuer PLC 0,815 % fällig am 21.01.2070	£ 10.461	11.666
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.12.2049	\$ 12.302	10.946
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,000 % fällig am 29.01.2024	€ 10.300	10.933
Euroclear Bank S.A. 0,000 % fällig am 08.03.2021	9.600	9.622
Brunel Residential Mortgage Securitisation PLC 0,313 % fällig am 13.01.2039	£ 8.803	9.603
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,350 % fällig am 01.04.2030	€ 9.100	9.469
Societe Generale S.A. 0,309 % fällig am 01.04.2022	9.200	9.283

(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.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	304.000	€ 29.797
	<b>PARI (000S)</b>	
Bundesrepublik Deutschland 0,250 % fällig am 16.10.2020	€ 22.440	22.573
France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050	6.550	8.522
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050	7.400	7.770
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 34.000	4.543
Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	€ 3.400	3.665
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2060	1.600	3.436
Bundesrepublik Deutschland 1,250 % fällig am 15.08.2048	2.200	3.116
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2066	2.050	2.917
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.07.2048	\$ 2.969	2.715
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028	€ 2.200	2.274
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,500 % fällig am 01.02.2026	2.200	2.249
France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048	1.300	1.889
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030	1.800	1.857
Land Nordrhein-Westfalen 1,650 % fällig am 22.02.2038	1.400	1.773
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,375 % fällig am 31.07.2035	1.400	1.691
France Government International Bond 1,250 % fällig am 25.05.2036	1.300	1.524
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£ 637	1.386
	<b>AKTIEN</b>	
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	12.000	1.200
	<b>PARI (000S)</b>	
France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.11.2020	€ 1.100	1.106

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
Bundesrepublik Deutschland 0,250 % fällig am 16.10.2020	€ 22.440	€ 22.562
	<b>AKTIEN</b>	
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	200.000	19.556
	<b>PARI (000S)</b>	
France Government International Bond 1,250 % fällig am 25.05.2036	€ 9.700	11.033
France Government International Bond 4,500 % fällig am 25.04.2041	2.500	4.613
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	\$ 5.067	4.537
	<b>AKTIEN</b>	
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	42.000	4.196
	<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	\$ 3.862	3.774
Freddie Mac 3,500 % fällig am 01.07.2048	2.969	2.716
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2066	€ 1.780	2.673
France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050	2.000	2.635
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050	2.600	2.586
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.06.2039	2.000	2.491
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028	2.200	2.278
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2055	1.000	2.017
Spain Government International Bond 1,400 % fällig am 30.07.2028	1.800	2.005
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,700 % fällig am 01.03.2047	1.700	1.858
Cooperative Rabobank UA 1,500 % fällig am 26.04.2038	1.500	1.846
Region Wallonne Belgium 1,250 % fällig am 03.05.2034	1.700	1.833
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030	1.800	1.831
Land Nordrhein-Westfalen 1,650 % fällig am 22.02.2038	1.400	1.783
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,375 % fällig am 31.07.2035	1.400	1.692
Spain Government International Bond 1,950 % fällig am 30.04.2026	1.500	1.686
Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	1.600	1.602
SNCF Reseau 2,000 % fällig am 05.02.2048	1.200	1.469
France Government International Bond 3,250 % fällig am 25.05.2045	900	1.455
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£ 637	1.344

(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.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,650 % fällig am 23.04.2020	€	13.604	NatWest Markets PLC 0,030 % fällig am 02.03.2020	€	10.900
NatWest Markets PLC 0,625 % fällig am 02.03.2022		9.600	Cars Alliance Auto Loans France 0,000 % fällig am 21.10.2029		9.312
JPMorgan Chase & Co. 1,500 % fällig am 26.10.2022		7.500	Mercedes-Benz Finance Co. Ltd. 0,100 % fällig am 20.11.2020		7.900
FMS Wertmanagement 0,000 % fällig am 30.03.2020		7.800	FMS Wertmanagement 0,000 % fällig am 30.03.2020		7.800
Infraestruturas de Portugal S.A. 4,250 % fällig am 13.12.2021		7.300	Schaeffler Finance BV 3,250 % fällig am 15.05.2025		6.500
Lanark Master Issuer PLC 0,373 % fällig am 22.12.2054		7.608	American Honda Finance Corp. 0,671 % fällig am 15.02.2022	\$	4.600
Imperial Brands Finance PLC 9,000 % fällig am 17.02.2022	£	5.800	Cars Alliance Auto Loans France 0,139 % fällig am 21.10.2036	€	4.000
Belfius Bank S.A. 0,000 % fällig am 18.03.2020	€	7.000	Sunrise SPV 0,273 % fällig am 23.05.2044		4.000
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,500 % fällig am 16.11.2022		6.900	Sveriges Sakerstallida Obligationer AB 1,000 % fällig am 17.03.2021	SEK	38.000
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031		6.700	Swedbank Hypotek AB 1,000 % fällig am 15.09.2021		37.600
Freddie Mac 0,700 % fällig am 19.08.2025	\$	7.900	ING Bank NV 0,121 % fällig am 26.11.2020	€	3.600
Goldman Sachs Group, Inc. 0,041 % fällig am 21.04.2023	€	6.700	Volkswagen International Finance NV 0,500 % fällig am 30.03.2021		3.600
Israel Government International Bond 0,000 % fällig am 22.07.2022		6.600	RCI Banque S.A. 2,250 % fällig am 29.02.2021		3.500
Glencore Finance Europe Ltd. 1,250 % fällig am 17.03.2021		6.300	Asset-Backed European Securitisation Transaction 0,137 % fällig am 15.04.2032		3.500
Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC 0,000 % fällig am 16.09.2025	£	5.669	FT RMBS Prado 0,356 % fällig am 17.03.2056		3.188
Poland Government International Bond 0,000 % fällig am 07.07.2023	€	6.100	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 0,625 % fällig am 21.08.2020	CHF	3.250
Glencore Finance Europe Ltd. 6,000 % fällig am 03.04.2022	£	5.000	JPMorgan Chase & Co. 0,146 % fällig am 27.01.2020	€	3.000
Bureau Veritas S.A. 1,250 % fällig am 09.07.2023	€	5.700	Accor S.A. 2,625 % fällig am 05.02.2021		3.000
Eurofins Scientific SE 3,375 % fällig am 30.01.2023		5.300	Goldman Sachs Group, Inc. 0,488 % fällig am 27.07.2021		2.900
Wells Fargo & Co. 2,125 % fällig am 22.04.2022	£	5.000	Bank of America Corp. 1,375 % fällig am 10.09.2021		2.700
Bank of America Corp. 0,189 % fällig am 25.04.2024	€	5.500	HSBC Continental Europe S.A. 0,200 % fällig am 04.09.2021		2.600
Cooperative Rabobank UA 6,875 % fällig am 19.03.2020		5.400	Morgan Stanley 0,141 % fällig am 21.05.2021		2.600
Fukuoka Prefecture 0,880 % fällig am 22.06.2022	¥	680.000	RCI Banque S.A. 0,625 % fällig am 10.11.2021		2.600
Bumper UK Finance PLC 0,653 % fällig am 20.12.2028	£	4.400	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.04.2020	DKK	18.200
HSBC Holdings PLC 0,159 % fällig am 27.09.2022	€	5.200	Ford Motor Credit Co. LLC 0,000 % fällig am 14.05.2021	€	2.300
Societe Generale S.A. 0,000 % fällig am 27.05.2022		4.700	NORDILB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank 0,250 % fällig am 10.03.2020		2.200
UniCredit Spa 6,950 % fällig am 01.10.2022		4.000	FCT Titrisocram 0,000 % fällig am 25.07.2036		2.179
Brazilian Government International Bond 2,875 % fällig am 01.04.2021		4.300	Japan Student Services Organization 0,001 % fällig am 19.06.2020	¥	250.000
Bank of America Corp. 0,260 % fällig am 04.05.2023		4.300	Iberdrola International BV 3,500 % fällig am 01.02.2021	€	2.000
			Unibail-Rodamco-Westfield SE 0,125 % fällig am 14.05.2021		2.000
			Mylan NV 0,090 % fällig am 24.05.2020		2.000
			Clydesdale Bank PLC 2,250 % fällig am 21.04.2020	£	1.600
			ING Bank NV 0,082 % fällig am 08.04.2022	€	1.900
			Autonoría Spain 0,234 % fällig am 25.12.2035		1.800
			Driver Espana Six FT 0,222 % fällig am 25.09.2030		1.743
			Driver Italia One SRL 0,000 % fällig am 29.04.2029		1.748
			Euroclear Bank S.A. 0,000 % fällig am 08.03.2021		1.700
			Japan Housing Finance Agency 1,122 % fällig am 20.12.2021	¥	200.000
			Toyota Finance Australia Ltd. 0,000 % fällig am 09.04.2021	€	1.500

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 ausgeschlossen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	254.000	€ 24.909	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	150.700	€ 14.755
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Telecom Italia SpA 4,000 % fällig am 11.04.2024	€ 5.800	6.323	Casino Guichard Perrachon S.A. 4,498 % fällig am 07.03.2024	€ 3.900	3.509
Atlantia SpA 1,625 % fällig am 03.02.2025	4.300	4.252	Ypso Finance Bis S.A. 4,000 % fällig am 15.02.2028	3.250	3.154
thyssenkrupp AG 2,750 % fällig am 08.03.2021	3.600	3.659	IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK) 3,875 % fällig am 15.05.2027	2.850	2.731
Casino Guichard Perrachon S.A. 4,498 % fällig am 07.03.2024	3.900	3.593	Elis S.A. 1,875 % fällig am 15.02.2023	2.300	2.220
Petroleos Mexicanos 3,625 % fällig am 24.11.2025	4.300	3.501	Aston Martin Capital Holdings Ltd. 5,750 % fällig am 15.04.2022	£ 1.900	2.089
Ford Motor Credit Co. LLC 0,172 % fällig am 01.12.2024	4.400	3.454	Telecom Italia SpA 4,000 % fällig am 11.04.2024	€ 2.000	2.006
International Game Technology PLC 2,375 % fällig am 15.04.2028	3.450	3.419	LeasePlan Corp. NV 7,375 % fällig am 29.05.2024	1.850	1.900
Altice France S.A. 2,125 % fällig am 15.02.2025	3.500	3.398	Schaeffler AG 3,375 % fällig am 12.10.2028	1.700	1.862
Ypso Finance Bis S.A. 4,000 % fällig am 15.02.2028	3.250	3.220	Lloyds Banking Group PLC 3,500 % fällig am 01.04.2026	1.700	1.840
DKT Finance ApS 7,000 % fällig am 17.06.2023	2.900	3.048	Energizer Gamma Acquisition BV 4,625 % fällig am 15.07.2026	1.750	1.816
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK) 3,875 % fällig am 15.05.2027	2.850	2.979	Sarens Finance Co. NV 5,750 % fällig am 21.02.2027	1.850	1.775
LeasePlan Corp. NV 7,375 % fällig am 29.05.2024	2.250	2.618	Dufry One BV 2,500 % fällig am 15.10.2024	2.200	1.771
Sigma Bidco BV 3,500 % fällig am 02.07.2025	2.600	2.572	Darling Global Finance BV 3,625 % fällig am 15.05.2026	1.700	1.739
Smurfit Kappa Treasury ULC 1,500 % fällig am 15.09.2027	2.450	2.510	Nokia Oyj 3,125 % fällig am 15.05.2028	1.500	1.649
Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	2.450	2.494	Avantor, Inc. 4,750 % fällig am 01.10.2024	1.600	1.648
Casino Guichard Perrachon S.A. 5,500 % fällig am 31.01.2024	2.600	2.493	INEOS Finance PLC 2,500 % fällig am 01.04.2024	1.691	1.641
Zayo Group Holdings, Inc. 3,250 % fällig am 09.03.2027	2.497	2.435	James Hardie International Finance DAC 3,625 % fällig am 01.10.2026	1.600	1.624
Elis S.A. 1,875 % fällig am 15.02.2023	2.300	2.390	SoftBank Group Corp. 4,000 % fällig am 19.09.2029	1.600	1.587
Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024	2.450	2.343	Ford Motor Credit Co. LLC 0,172 % fällig am 01.12.2024	1.800	1.568
			Faurecia SE 2,625 % fällig am 15.06.2025	1.600	1.568
			Sigma Bidco BV 3,500 % fällig am 02.07.2025	1.600	1.552
			Zayo Group Holdings, Inc. 3,250 % fällig am 09.03.2027	1.493	1.463
			International Game Technology PLC 2,375 % fällig am 15.04.2028	1.600	1.456
			Boxer Parent Co., Inc. 6,500 % fällig am 02.10.2025	1.400	1.453
			Aker BP ASA 3,000 % fällig am 15.01.2025	\$ 1.700	1.451
			Aston Martin Capital Holdings Ltd. 6,500 % fällig am 15.04.2022	2.000	1.444
			Cogent Communications Group, Inc. 4,375 % fällig am 30.06.2024	€ 1.400	1.440
			CSC Holdings LLC 6,500 % fällig am 01.02.2029	\$ 1.500	1.421
			Lloyds Banking Group PLC 7,875 % fällig am 27.06.2029	£ 900	1.411
			Charter Communications Operating LLC 5,050 % fällig am 30.03.2029	\$ 1.300	1.393

(a) Der PIMCO European 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	792.400	€ 77.890
	<b>PARI (000S)</b>	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025	€ 17.279	17.707
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 105.600	13.966
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	101.100	13.414
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	84.100	11.217
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	\$ 8.722	8.213
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 51.500	6.876
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030	€ 6.800	6.823
Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	5.900	6.258
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$ 5.808	5.492
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,500 % fällig am 01.02.2026	€ 5.000	5.114
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 36.100	4.792
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,500 % fällig am 01.10.2050	32.000	4.314
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	31.800	4.284
Jyske Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	31.200	4.207
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028	€ 3.100	3.204
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£ 1.380	3.004
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 19.500	2.597
Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	€ 2.500	2.586
Jupiter Mortgage Ltd. 1,000 % fällig am 01.06.2060	£ 1.600	1.762

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	773.800	€ 76.578
	<b>PARI (000S)</b>	
Dexia Credit Local S.A. 2,000 % fällig am 22.01.2021	€ 7.400	7.564
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030	6.800	6.472
Autonomous Community of Madrid 0,125 % fällig am 30.04.2022	5.300	5.373
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$ 5.757	5.248
Hamburg Commercial Bank AG 0,250 % fällig am 25.04.2022	€ 4.500	4.560
British Telecommunications PLC 0,625 % fällig am 10.03.2021	4.400	4.392
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,500 % fällig am 01.10.2040	DKK 33.129	4.300
Nykredit Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2040	32.940	4.271
Jyske Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2040	32.404	4.206
Citigroup, Inc. 0,302 % fällig am 24.05.2021	€ 3.400	3.429
UBS AG 4,000 % fällig am 08.04.2022	3.000	3.242
Origin Energy Ltd. 2,500 % fällig am 23.10.2020	3.100	3.114
Silverstone Master Issuer PLC 0,000 % fällig am 21.01.2070	3.080	3.067
Japan Finance Organization for Municipalities 0,875 % fällig am 22.09.2021	3.000	3.050
Cartesian Residential Mortgages S.A. 0,000 % fällig am 18.11.2051	2.909	2.870
PKO Bank Hipoteczny S.A. 0,250 % fällig am 23.11.2021	2.800	2.800
FT RMBS Prado 0,356 % fällig am 17.03.2056	2.656	2.664
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 0,375 % fällig am 17.10.2023	2.700	2.616
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£ 1.378	2.520
Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	€ 2.500	2.440
Telefonica Emisiones S.A. 1,477 % fällig am 14.09.2021	2.200	2.239
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.02.2022	2.200	2.229
Lanark Master Issuer PLC 0,000 % fällig am 22.12.2054	2.136	2.130
Braskem Finance Ltd. 6,450 % fällig am 03.02.2024	\$ 2.388	2.042

- (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)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	12.483.933	\$ 124.426	PIMCO Select Funds plc - US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	12.682.387	\$ 126.500
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€ 16.514	20.138	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2026	¥ 1.235.354	11.853
QNB Finance Ltd. 1,310 % fällig am 12.02.2022	\$ 7.500	7.500	Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	€ 7.300	7.644
Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	€ 4.700	5.570	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	\$ 6.869	7.513
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	¥ 499.505	4.814	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	7.197	7.444
Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD 6.700	4.769	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b)	4.143	4.854
U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	\$ 4.300	4.233	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b)	3.834	4.652
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2026	¥ 374.470	3.610	Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos 4,500 % fällig am 01.03.2026	CLP 3.000.000	3.978
Finland Government International Bond 0,500 % fällig am 15.04.2026	€ 2.900	3.376	China Development Bank 3,680 % fällig am 26.02.2026	CNY 26.700	3.911
Serbia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.05.2027	3.000	3.198	Finland Government International Bond 0,500 % fällig am 15.04.2026	€ 2.900	3.581
China Development Bank 3,340 % fällig am 14.07.2025	CNY 19.800	3.002	Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	2.700	3.556
U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	\$ 2.700	2.715	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,350 % fällig am 01.04.2030	3.200	3.549
Jupiter Mortgage Ltd. 1,000 % fällig am 01.06.2060	£ 1.900	2.517	China Development Bank 4,040 % fällig am 10.04.2027	CNY 23.700	3.542
Freddie Mac 3,000 % fällig am 01.03.2050	\$ 2.282	2.399	Indonesia Treasury Bond 8,250 % fällig am 15.05.2036	IDR 43.550.000	3.290
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.03.2050	2.271	2.387	Russia Government International Bond 7,250 % fällig am 10.05.2034	RUB 185.700	2.529
Israel Government International Bond 2,000 % fällig am 31.03.2027	ILS 7.300	2.346	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	\$ 2.225	2.465
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$ 1.917	2.325	Freddie Mac 3,000 % fällig am 01.03.2050	2.282	2.399
Spain Government International Bond 1,850 % fällig am 30.07.2035	€ 1.700	2.260	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.03.2050	2.192	2.328
Russia Government International Bond 7,650 % fällig am 10.04.2030	RUB 137.400	2.259	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 12.773	2.081
Australia Government International Bond 1,750 % fällig am 21.06.2051	AUD 3.200	2.216	United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.01.2049	£ 1.100	1.826

(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.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	221.004.535	\$ 2.200.209
	<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2049	\$ 551.611	584.972
QNB Finance Ltd. 1,310 % fällig am 12.02.2022	286.150	286.150
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2049	241.768	256.330
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2048	197.633	210.787
Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	€ 174.270	207.836
Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD 286.300	203.791
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2050	\$ 187.402	198.690
U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	181.110	181.561
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.05.2050	166.900	174.384
Israel Government International Bond 1,000 % fällig am 30.04.2021	ILS 556.700	162.118
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,000 % fällig am 01.03.2023	CLP 109.740.000	144.646
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,850 % fällig am 01.07.2025	€ 102.200	129.097
Finland Government Bond 0,500 % fällig am 15.04.2026	109.800	127.731
U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	\$ 92.650	91.647
Spain Government International Bond 1,850 % fällig am 30.07.2035	€ 67.100	89.695
United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.01.2049	£ 55.150	88.814
Jupiter Mortgage Ltd. 1,000 % fällig am 01.06.2060	64.100	84.914
Finland Government Bond 0,875 % fällig am 15.09.2025	€ 70.800	82.890
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.03.2050	\$ 78.067	82.043

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	230.723.124	\$ 2.298.900
	<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2048	\$ 197.590	209.507
Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	€ 167.400	175.479
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.05.2050	\$ 165.920	171.623
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,000 % fällig am 01.03.2023	CLP 109.740.000	137.804
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.06.2029	¥ 14.790.000	135.061
Finland Government Bond 0,500 % fällig am 15.04.2026	€ 109.800	131.266
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,000 % fällig am 01.08.2029	94.600	121.616
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,350 % fällig am 01.04.2030	102.800	113.764
Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	80.700	106.387
Finland Government Bond 0,875 % fällig am 15.09.2025	70.800	90.842
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.03.2029	¥ 9.400.000	85.925
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,450 % fällig am 15.11.2024	€ 72.950	80.270
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.03.2050	\$ 75.333	79.995
Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 30.04.2029	€ 70.358	79.484
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)	\$ 65.831	74.969
United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.01.2049	£ 45.850	74.498
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.04.2049	\$ 69.972	74.192
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 447.448	72.889
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.04.2049	\$ 66.000	69.981

(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.

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>				
China Development Bank 4,240 % fällig am 24.08.2027	CNY	146.200	\$	21.883
Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	€	17.000		20.686
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.01.2050	\$	18.480		19.443
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 07.09.2020	¥	1.990.000		18.137
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.07.2048	\$	16.534		17.600
U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050		16.400		16.436
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.07.2022	DKK	75.000		12.244
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050		78.000		12.186
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2030	€	9.500		11.779
China Development Bank 3,340 % fällig am 14.07.2025	CNY	75.600		11.462
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,850 % fällig am 01.07.2025	€	8.700		10.998
U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	\$	10.000		9.869
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.07.2050		9.384		9.755
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	58.400		9.606
Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD	12.700		9.040
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,000 % fällig am 03.01.2023	CLP	6.255.000		8.352
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.04.2022	DKK	51.300		8.327
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.03.2050	\$	7.181		7.556
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (a)		6.626		7.407
Province of Quebec 0,000 % fällig am 29.10.2030	€	6.000		7.111

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>				
Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	€	10.600	\$	11.085
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.07.2050	\$	9.022		9.417
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a)		8.162		8.773
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 30.04.2025		7.700		8.537
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,000 % fällig am 01.03.2023	CLP	6.255.000		7.859
France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050	€	5.300		7.137
International Bank for Reconstruction & Development 0,100 % fällig am 17.09.2035		5.700		6.877
Finland Government Bond 0,500 % fällig am 15.04.2026		5.700		6.788
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.06.2029	¥	720.000		6.575
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0,000 % fällig am 25.11.2030	€	5.300		6.376
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 13.10.2027		5.200		6.366
Japan Government International Bond 1,200 % fällig am 20.09.2035	¥	580.000		6.228
Landesbank Baden-Wuerttemberg 2,375 % fällig am 31.05.2022	\$	5.700		5.874
United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.01.2049	£	3.600		5.853
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,527 % fällig am 13.09.2023	\$	5.400		5.688
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,000 % fällig am 01.08.2029	€	4.200		5.399
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,350 % fällig am 01.04.2030		4.800		5.266
Niagara Mohawk Power Corp. 1,960 % fällig am 27.06.2030	\$	5.100		5.220
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.03.2029	¥	570.000		5.210
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,100 % fällig am 15.07.2026	€	4.000		5.167
Finland Government Bond 0,875 % fällig am 15.09.2025		3.900		5.004
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.12.2049	\$	4.981		4.942
China Development Bank 3,340 % fällig am 14.07.2025	CNY	32.000		4.858
China Development Bank 4,240 % fällig am 24.08.2027		28.200		4.490
Societe Du Grand Paris EPIC 1,000 % fällig am 18.02.2070	€	3.300		4.268
Japan Government International Bond 1,300 % fällig am 20.06.2035	¥	350.000		3.905
Land Nordrhein-Westfalen 0,000 % fällig am 26.11.2029	€	3.200		3.859
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,000 % fällig am 29.09.2022	\$	3.400		3.512
Bank of America Corp. 1,486 % fällig am 19.05.2024		3.400		3.484
Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 30.04.2029	€	2.800		3.413
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,450 % fällig am 01.10.2023		2.600		3.311

(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	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	16.046.510	\$ 159.820
	<b>PARI (000S)</b>	
QNB Finance Ltd. 1,310 % fällig am 12.02.2022	\$ 20.300	20.300
Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD 22.600	16.087
Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	€ 11.600	13.842
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.05.2050	\$ 10.400	10.866
Finland Government Bond 0,500 % fällig am 15.04.2026	€ 9.100	10.580
United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.01.2049	£ 4.700	7.545
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,850 % fällig am 01.07.2025	€ 5.600	7.085
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	\$ 5.900	5.877
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.03.2030	¥ 590.000	5.533
Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.12.2048	CAD 5.600	5.361
Freddie Mac 3,000 % fällig am 01.03.2050	\$ 4.763	5.006
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.03.2050	4.741	4.982
Spain Government International Bond 1,850 % fällig am 30.07.2035	€ 3.600	4.787
Jupiter Mortgage Ltd. 1,000 % fällig am 01.06.2060	£ 3.600	4.769
Morgan Stanley 0,790 % fällig am 03.02.2023	CAD 6.300	4.764
China Development Bank 3,430 % fällig am 14.01.2027	CNY 32.400	4.743
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 3.900	4.618
Australia Government International Bond 1,750 % fällig am 21.06.2051	AUD 6.400	4.430
Japan Government International Bond 1,400 % fällig am 20.09.2034	¥ 390.000	4.234

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	16.052.712	\$ 159.900
	<b>PARI (000S)</b>	
Japan Government International Bond 1,400 % fällig am 20.09.2034	¥ 2.720.000	29.871
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 30.04.2025	\$ 19.400	21.826
Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	€ 19.300	20.637
Finland Government Bond 0,500 % fällig am 15.04.2026	9.100	11.447
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,000 % fällig am 01.08.2029	8.800	11.301
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.05.2050	\$ 10.339	10.694
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)	9.390	10.693
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 57.200	8.809
Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 30.04.2029	€ 6.900	8.117
Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 8.000	8.068
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,350 % fällig am 01.04.2030	€ 6.600	7.332
ING Bank NV 2,625 % fällig am 05.12.2022	\$ 6.800	7.034
U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 15.11.2029	5.900	6.497
Land Nordrhein-Westfalen 0,250 % fällig am 13.03.2026	€ 5.600	6.323
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.03.2030	¥ 590.000	5.661
Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.12.2048	CAD 5.600	5.406
Japan Government International Bond 0,700 % fällig am 20.12.2048	¥ 520.000	5.157
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,250 % fällig am 24.05.2033	€ 4.100	5.131
Freddie Mac 3,000 % fällig am 01.03.2050	\$ 4.763	5.006

(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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	66.234.919	\$ 660.825	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	54.666.418	\$ 545.689
	<b>PARI (000S)</b>		PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	955.300	94.717
China Development Bank 3,340 % fällig am 14.07.2025	CNY 409.200	62.475		<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.01.2027	\$ 18.600	18.514	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.11.2048	\$ 62.628	66.630
U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 28.02.2027	17.500	17.357		<b>AKTIEN</b>	
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 184.200	14.340	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Mortgage Opportunities Fund (a)	3.875.853	39.174
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,500 % fällig am 01.02.2026	€ 10.200	12.391		<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$ 10.861	12.244	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	\$ 30.861	31.784
	<b>AKTIEN</b>		Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 15.01.2026	24.068	25.234
WisdomTree WTI Crude Oil	1.068.119	8.158	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.11.2049	24.911	24.683
Equinix, Inc.	9.126	5.732	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2048	19.163	20.388
	<b>PARI (000S)</b>		U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.01.2027	18.600	18.556
U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.02.2050	\$ 5.700	5.622	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	16.780	17.850
U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	5.700	5.590	U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 28.02.2027	17.500	17.564
	<b>AKTIEN</b>		Mexico Government International Bond 7,250 % fällig am 09.12.2021	MEX 167.000	9.061
SBA Communications Corp.	20.888	5.570	Spain Government International Bond 2,150 % fällig am 31.10.2025	€ 6.300	7.588
Invitation Homes, Inc.	148.944	4.643	Mexico Government International Bond 6,500 % fällig am 09.06.2022	MEX 139.000	7.448
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	24.303	4.059		<b>AKTIEN</b>	
Equity Residential	47.827	4.045	WisdomTree WTI Crude Oil	1.068.119	6.852
Equity LifeStyle Properties, Inc.	53.650	3.924		<b>PARI (000S)</b>	
Duke Realty Corp.	104.593	3.906	UBS AG 2,450 % fällig am 01.12.2020	\$ 5.700	5.728
Welltower, Inc.	45.218	3.882	U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.02.2050	5.700	5.655
First Industrial Realty Trust, Inc.	88.640	3.874		<b>AKTIEN</b>	
Life Storage, Inc.	34.138	3.848	Equinix, Inc.	7.662	5.254
			Amazon.com, Inc.	2.229	4.216
			Microsoft Corp.	22.290	3.639

(a) Der PIMCO Global Dividend 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)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	100.821.088	\$ 1.004.057	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	79.618.200	\$ 794.100
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (a)	3.637.652	40.036	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	2.115.800	213.130
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Catalent Pharma Solutions, Inc. 2,375 % fällig am 01.03.2028	€ 21.500	23.152	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 31.07.2023	\$ 97.920	105.162
Techem Verwaltungsgesellschaft mbH 2,000 % fällig am 15.07.2025	15.000	16.387	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.07.2024	39.200	41.960
Ashland Services BV 2,000 % fällig am 30.01.2028	15.000	16.060	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.10.2024	25.000	25.864
Ortho-Clinical Diagnostics, Inc. 7,250 % fällig am 01.02.2028	\$ 16.000	15.927	U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 31.07.2023	17.880	18.184
Virgin Media Finance PLC 3,750 % fällig am 15.07.2030	€ 14.000	15.840	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 30.11.2024	15.000	15.536
UniCredit SpA 5,459 % fällig am 30.06.2035	\$ 14.000	15.324	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.03.2025	13.600	14.976
B.C. Unlimited Liability Co. 4,000 % fällig am 15.10.2030	15.000	15.000	Credit Agricole S.A. 7,875 % fällig am 23.01.2024	10.000	11.351
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.08.2030	15.000	14.865	Park Aerospace Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 15.08.2022	10.000	10.694
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 13.07.2027	€ 12.500	13.685	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5,125 % fällig am 30.06.2027	9.000	10.011
Reynolds Group Issuer, Inc. 4,000 % fällig am 15.10.2027	\$ 13.000	13.000	Jaguar Holding Co. 6,375 % fällig am 01.08.2023	9.500	9.202
CeramTec BondCo GmbH 5,250 % fällig am 15.12.2025	€ 12.000	12.919	Lennar Corp. 5,250 % fällig am 01.06.2026	6.500	7.681
Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % fällig am 31.01.2031	10.750	12.761	Advanced Disposal Services, Inc. 5,625 % fällig am 15.11.2024	7.000	7.285
Tenet Healthcare Corp. 6,125 % fällig am 01.10.2028	\$ 12.750	12.750	Sprint Communications, Inc. 6,000 % fällig am 15.11.2022	7.000	7.055
Western Midstream Operating LP 6,250 % fällig am 01.02.2050	15.000	12.536	Trinseo Materials Operating S.C.A. 5,375 % fällig am 01.09.2025	7.000	7.047
Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3,500 % fällig am 11.02.2027	€ 11.000	12.488	Bausch Health Cos., Inc. 4,500 % fällig am 15.05.2023	€ 7.000	6.560
Ford Motor Credit Co. LLC 0,172 % fällig am 01.12.2024	14.250	12.485	PDC Energy, Inc. 6,250 % fällig am 01.12.2025	\$ 6.000	6.060
Altice Financing S.A. 3,000 % fällig am 15.01.2028	11.000	11.928	Standard Industries, Inc. 5,000 % fällig am 15.02.2027	6.000	5.955
Adevinta ASA 2,625 % fällig am 15.11.2025	10.000	11.836	Lennar Corp. 4,750 % fällig am 29.11.2027	5.000	5.899

(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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	767.469.307	\$ 7.640.930	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	610.237.323	\$ 6.083.400
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.11.2049	\$ 679.699	773.301	U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.11.2049	\$ 679.699	823.520
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	392.100	394.459	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2049	252.362	307.400
U.S. Treasury Bonds 1,250 % fällig am 15.05.2050	292.597	283.886	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	279.518	298.467
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	279.518	276.313	U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 15.08.2029	272.245	272.224
U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030	190.100	188.957	U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 15.11.2029	187.388	187.608
U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	159.020	156.405	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	187.910	183.021
U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.08.2050	118.464	110.326	U.S. Treasury Bonds 1,250 % fällig am 15.05.2050	187.000	176.771
	<b>AKTIEN</b>		U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.08.2045	91.888	118.185
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (a)	8.242.686	93.000	U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.08.2049	71.471	85.443
	<b>PARI (000S)</b>		U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.11.2048	47.901	62.241
Russia Government International Bond 8,500 % fällig am 17.09.2031	RUB 4.523.900	74.439	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 2,500 % fällig am 13.09.2022	61.000	60.284
Deutsche Bank AG 1,750 % fällig am 19.11.2030	€ 60.000	71.259	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	55.434	59.268
GE Capital Funding LLC 4,400 % fällig am 15.05.2030	\$ 65.700	68.881	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	53.692	55.719
Wells Fargo & Co. 1,741 % fällig am 04.05.2030	€ 57.500	68.692	U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.05.2046	43.483	52.585
Comcast Corp. 2,800 % fällig am 15.01.2051	\$ 68.700	68.185	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 2,949 % fällig am 24.01.2024	€ 43.900	46.107
Comcast Corp. 3,750 % fällig am 01.04.2040	58.100	66.891	Apple, Inc. 1,650 % fällig am 11.05.2030	\$ 45.600	45.968
QNB Finance Ltd. 1,310 % fällig am 12.02.2022	57.400	57.400	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b)	34.208	38.837
NVR, Inc. 3,000 % fällig am 15.05.2030	52.800	56.359	HSBC Holdings PLC 4,750 % fällig am 04.07.2029	€ 43.025	35.990
Boeing Co. 5,150 % fällig am 01.05.2030	54.400	54.952	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	\$ 32.857	34.560
Deutsche Bank AG 3,547 % fällig am 18.09.2031	52.843	53.178			
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,125 % fällig am 29.10.2022	49.950	52.931			

(a) Der Global Investment Grade Credit Fonds 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	\$ 21.200	\$ 21.149	U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 15.11.2029	\$ 4.969	\$ 5.017
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2030	€ 7.800	9.672	U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.02.2050	3.945	4.463
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.08.2030	\$ 7.500	7.460	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	2.200	2.191
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	4.913	4.852	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	1.813	1.953
U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.02.2050	3.945	4.646	Australia Government International Bond 1,750 % fällig am 21.06.2051	AUD 2.300	1.619
U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	4.700	4.641	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3,455 % fällig am 02.03.2023	\$ 1.200	1.284
U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 15.11.2029	4.400	4.455	ABN AMRO Bank NV 4,375 % fällig am 22.09.2025	€ 900	1.099
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (a)	3.438	3.819	ING Groep NV 4,625 % fällig am 06.01.2026	\$ 900	1.065
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	3.500	3.490	Tucson Electric Power Co. 1,500 % fällig am 01.08.2030	1.000	989
Australia Government International Bond 1,000 % fällig am 21.12.2030	AUD 3.540	2.602	Electricite de France S.A. 3,625 % fällig am 13.10.2025	850	957
International Bank for Reconstruction & Development 0,100 % fällig am 17.09.2035	€ 2.100	2.487	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.08.2049	885	910
Solar Star Funding LLC 5,375 % fällig am 30.06.2035	\$ 2.133	2.393	Ireland Government International Bond 1,350 % fällig am 18.03.2031	€ 700	836
Nederlandse Waterschapsbank NV 0,125 % fällig am 03.09.2035	€ 1.900	2.243	Welltower, Inc. 2,700 % fällig am 15.02.2027	\$ 800	811
Europäische Union 0,300 % fällig am 04.11.2050	1.900	2.235	Digital Euro Finco LLC 2,500 % fällig am 16.01.2026	€ 600	781
BBVA USA 3,500 % fällig am 11.06.2021	\$ 1.995	2.017	BNP Paribas S.A. 2,375 % fällig am 20.05.2024	600	768
Mexico Government International Bond 1,350 % fällig am 18.09.2027	€ 1.600	1.868	Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	700	748
Romanian Government International Bond 2,625 % fällig am 02.12.2040	1.500	1.786	Progressive Corp. 4,000 % fällig am 01.03.2029	\$ 600	722
Australia Government International Bond 1,750 % fällig am 21.06.2051	AUD 2.300	1.627	JPMorgan Chase & Co. 2,301 % fällig am 15.10.2025	700	704
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,650 % fällig am 01.12.2030	€ 1.300	1.624	Hungary Government International Bond 1,750 % fällig am 05.06.2035	€ 500	675
Mizuho Financial Group, Inc. 2,201 % fällig am 10.07.2031	\$ 1.500	1.534	Fortune Brands Home & Security, Inc. 3,250 % fällig am 15.09.2029	\$ 600	669
			Ryder System, Inc. 2,875 % fällig am 01.06.2022	600	622
			Weyerhaeuser Co. 4,000 % fällig am 15.04.2030	500	593
			Societe Generale S.A. 0,750 % fällig am 25.01.2027	€ 500	590
			JPMorgan Chase & Co. 3,960 % fällig am 29.01.2027	\$ 500	574
			AT&T, Inc. 1,800 % fällig am 14.09.2039	€ 600	571
			Bank of New York Mellon Corp. 4,700 % fällig am 20.09.2025	\$ 500	543

(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	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	48.358.092	\$ 481.484
	<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 1,503 % fällig am 15.02.2030	\$ 52.800	56.618
China Development Bank 3,230 % fällig am 10.01.2025	CNY 206.600	30.557
China Development Bank 3,340 % fällig am 14.07.2025	184.300	27.345
U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 30.09.2025	\$ 24.400	24.374
U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	15.600	15.600
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	13.062	13.597
	<b>AKTIEN</b>	
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (a)	1.197.507	12.000
	<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$ 9.733	10.904
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	9.789	10.084
QNB Finance Ltd. 1,303 % fällig am 12.02.2022	10.000	10.000
Ares European CLO Designated Activity Co. 1,120 % fällig am 21.10.2033	€ 8.000	9.452
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 0,298 % fällig am 25.09.2036	\$ 17.159	8.269
Jupiter Mortgage Ltd. 0,000 % fällig am 01.06.2060	£ 5.500	7.286
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,750 % fällig am 01.05.2029	\$ 6.500	6.500
U.S. Foods, Inc. 1,897 % fällig am 27.06.2023	6.575	6.493
Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 19.100	6.351
Enbridge, Inc. 0,720 % fällig am 18.02.2022	\$ 6.000	6.000
Zayo Group Holdings, Inc. 3,147 % fällig am 09.03.2027	5.944	5.910
Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % fällig am 19.07.2024	€ 5.400	5.868

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	57.657.691	\$ 575.038
	<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.05.2049	\$ 55.952	59.274
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,875 % fällig am 15.12.2020 (b)	51.800	52.417
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	38.306	39.903
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	36.596	39.128
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2049	19.013	19.935
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	9.847	10.405
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	9.371	10.293
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b)	8.144	9.494
Saudi Government International Bond 4,500 % fällig am 17.04.2030	7.200	8.289
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	6.719	7.443
U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2021	6.900	7.042
Broadcom, Inc. 3,459 % fällig am 15.09.2026	5.184	5.695
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2026 (b)	5.135	5.489
Motability Operations Group PLC 0,375 % fällig am 03.01.2026	€ 3.700	4.469
CVS Health Corp. 3,700 % fällig am 09.03.2023	\$ 3.500	3.656
INEOS Finance PLC 2,875 % fällig am 01.05.2026	€ 3.200	3.583
T-Mobile USA, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2030	\$ 3.200	3.484
KBC Group NV 4,750 % fällig am 05.03.2024	€ 2.600	3.290
Volkswagen Leasing GmbH 0,500 % fällig am 20.06.2022	2.700	3.238

(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)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	35.113.431	\$ 350.338
	<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	\$ 60.569	63.086
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	53.931	58.479
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2021 (b)	46.305	46.386
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 182.800	26.817
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$ 23.649	26.738
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£ 16.088	24.940
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	\$ 22.034	22.729
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	22.092	22.583
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025	€ 18.042	20.967
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$ 18.622	20.734
France Government International Bond 1,100 % fällig am 25.07.2022	€ 13.950	17.171
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	\$ 14.345	15.107
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2029	€ 9.633	12.488
United Kingdom Gilt 2,750 % fällig am 07.09.2024	£ 8.900	12.371
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.11.2036	5.140	9.968
France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024	€ 7.982	9.953
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	7.070	8.986
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£ 3.609	8.497
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2026	€ 6.195	7.835

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	31.023.947	\$ 309.500
	<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2021 (b)	\$ 143.932	144.024
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	69.722	75.304
France Government International Bond 1,100 % fällig am 25.07.2022	€ 29.256	35.200
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2024	£ 21.875	30.386
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	\$ 26.117	27.310
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 12.695	22.198
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	\$ 20.833	21.177
Spain Government International Bond 0,150 % fällig am 30.11.2023	€ 16.769	20.441
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	\$ 17.543	19.762
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,600 % fällig am 15.09.2023	€ 14.838	18.206
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 116.493	17.660
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	\$ 14.534	15.014
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 98.000	14.503
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b)	\$ 12.118	12.399
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	11.931	12.178
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2028	£ 7.500	11.749
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2022 (b)	\$ 9.992	10.108
United Kingdom Gilt 1,875 % fällig am 22.11.2022	£ 5.923	8.317
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	3.604	8.173

(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)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	40.358.483	\$ 402.581	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	37.501.526	\$ 374.400
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	\$ 176.599	192.090	Spain Government International Bond 0,150 % fällig am 30.11.2023	€ 81.026	98.362
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	120.253	126.381	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 47.991	83.504
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2032	£ 47.577	99.209	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	\$ 75.454	79.229
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$ 80.633	89.576	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b)	67.005	75.048
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025	€ 57.851	67.852	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	41.577	45.049
France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024	50.321	62.646	France Government International Bond 1,100 % fällig am 25.07.2022	€ 34.053	41.476
France Government International Bond 0,700 % fällig am 25.07.2030	40.841	56.242	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	\$ 38.920	39.605
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2026	44.548	56.125	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	32.037	36.927
France Government International Bond 1,100 % fällig am 25.07.2022	42.446	52.250	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,600 % fällig am 15.09.2023	€ 30.178	36.651
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$ 44.634	47.403	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	\$ 29.173	30.148
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2029	€ 38.409	47.241	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	27.800	29.808
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2028	£ 25.279	40.442	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2021 (b)	26.771	27.078
United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.10.2050	31.900	40.211	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£ 11.030	23.493
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	23.657	39.440	Jyske Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK 149.541	22.698
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 242.700	35.789	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$ 17.927	21.706
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	€ 26.259	33.378	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.02.2040 (b)	12.375	19.052
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.11.2036	£ 15.501	29.074	United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.10.2050	£ 14.300	17.626
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030	€ 22.000	27.022	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	\$ 16.346	17.319
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.03.2050	£ 8.377	23.946	United Kingdom Gilt 0,250 % fällig am 22.03.2052	£ 6.760	17.279
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	\$ 20.495	23.376	Japanese Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2024	¥ 1.758.960	16.370
United Kingdom Gilt 0,250 % fällig am 22.03.2052	£ 7.883	21.260	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024	€ 13.313	16.328
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 20.776	21.243	France Government International Bond 1,800 % fällig am 25.07.2040	9.346	16.325
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048	£ 8.406	20.380	Spain Government International Bond 0,650 % fällig am 30.11.2027	13.263	14.922
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2029	11.953	20.275	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2032	£ 7.778	14.304

(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 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.102.209.311	\$ 30.920.741	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.025.460.999	\$ 30.172.000
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2049	\$ 3.189.732	3.384.765	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2049	\$ 2.617.723	2.764.588
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.04.2050	959.458	1.012.190	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.10.2024	1.492.400	1.603.548
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2050	866.590	918.788	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2049	1.478.233	1.576.663
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2049	706.613	735.861	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.06.2024	1.280.800	1.354.847
U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2025	667.710	727.665	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.06.2049	1.248.934	1.326.408
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2049	644.261	674.968	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2025	1.167.710	1.272.907
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2050	594.003	633.482	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.04.2050	889.328	938.380
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.10.2048	587.004	619.831	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2049	757.500	807.271
U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.08.2045	510.010	581.858	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.12.2023	723.650	767.579
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.06.2050	551.208	581.474	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.10.2048	708.001	752.686
U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.05.2044	416.095	522.006	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2049	621.992	650.167
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.06.2049	496.779	517.331	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.10.2048	593.557	629.381
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.07.2050	481.627	508.653	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.05.2050	444.346	459.621
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2050	454.030	484.216	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.07.2024	391.500	416.688
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.10.2048	449.189	478.862	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 29.02.2024	357.100	377.898
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.05.2050	445.954	462.538	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2048	349.012	370.106
U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044	371.252	427.646	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2021	363.500	367.192
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 4.808.100	382.864	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.01.2026	318.400	354.584
U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.08.2044	\$ 311.083	380.396	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2049	318.709	332.117

(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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	4.804.641	\$ 47.905	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	4.613.139	\$ 46.000
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	\$ 4.225	4.760	Spain Government International Bond 0,150 % fällig am 30.11.2023	€ 3.178	3.841
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	4.480	4.646	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	\$ 2.862	2.985
France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024	€ 2.985	3.709		<b>AKTIEN</b>	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025	1.799	2.040	Invesco Physical Gold ETC	17.649	2.730
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.01.2027	\$ 1.600	1.593		<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 28.02.2027	1.600	1.587	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 2.388	2.675
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2026	€ 999	1.264	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	2.044	2.393
France Government International Bond 1,100 % fällig am 25.07.2022	796	979	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.02.2047 (b)	1.521	1.912
	<b>AKTIEN</b>		United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 1.048	1.830
Invesco Physical Gold ETC	6.100	953	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	\$ 1.506	1.662
	<b>PARI (000S)</b>		U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 28.02.2027	1.600	1.606
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.02.2047 (b)	\$ 761	952	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.01.2027	1.600	1.596
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	700	777	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	1.015	1.029
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	705	747	France Government International Bond 1,100 % fällig am 25.07.2022	€ 792	962
	<b>AKTIEN</b>		U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 834	935
ONEOK, Inc.	12.500	541	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2021 (b)	922	915
	<b>PARI (000S)</b>		U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2021 (b)	887	904
U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.02.2050	\$ 500	493	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	657	710
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.03.2050	£ 165	444	U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.02.2050	500	496
Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 31.10.2027	€ 300	342	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	396	403
	<b>AKTIEN</b>		Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2024	¥ 41.880	390
ONE Gas, Inc.	4.199	323			
	<b>PARI (000S)</b>				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	\$ 300	303	(a) Der Inflation Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b)	220	280	(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)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	9.786.903	\$ 97.385	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	7.365.347	\$ 73.400
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 30.04.2022	\$ 47.700	47.635	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	\$ 71.514	72.762
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	30.637	31.203	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.11.2048	48.986	52.148
Freddie Mac 0,700 % fällig am 18.08.2025	23.500	23.500	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	42.569	43.276
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,850 % fällig am 01.07.2025	€ 21.600	23.382	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	34.781	34.603
Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.08.2049	\$ 20.000	21.197	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,750 % fällig am 01.07.2024	€ 30.600	33.494
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2048	19.259	19.549		<b>AKTIEN</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2048	18.623	18.931	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	249.700	24.938
Freddie Mac 0,690 % fällig am 05.08.2025	18.500	18.500		<b>PARI (000S)</b>	
Freddie Mac 0,650 % fällig am 22.10.2025	11.800	11.800	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,850 % fällig am 01.07.2025	€ 21.600	24.038
Freddie Mac 0,650 % fällig am 27.10.2025	11.700	11.700	Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.09.2048	\$ 19.259	19.549
Freddie Mac 0,680 % fällig am 06.08.2025	11.300	11.300	Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.08.2048	18.623	18.931
Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.11.2049	9.661	10.457	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	16.269	18.149
Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.09.2049	9.063	9.600	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.12.2048	16.440	17.504
Towd Point Mortgage Funding PLC 0,955 % fällig am 20.05.2045	£ 6.820	8.895	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	13.470	13.617
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	\$ 8.139	8.604	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2048	10.260	10.931
Freddie Mac 0,800 % fällig am 28.10.2026	7.000	6.999	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2048	9.791	10.431
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	6.735	6.807	Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.09.2049	8.511	9.154
Chevron Corp. 1,141 % fällig am 11.05.2023	6.800	6.800	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.07.2048	8.227	8.764
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN 17.000	6.242	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	8.180	8.738
			Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.10.2048	6.838	7.279
			Chevron Corp. 1,141 % fällig am 11.05.2023	6.800	6.926

(a) Der Low 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.

BESCHREIBUNG	AKTIEN		KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN		ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>				<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	25.698.865	\$	256.187	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	24.599.290	\$	245.400
	<b>PARI (000S)</b>				<b>PARI (000S)</b>		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	\$	28.687	29.566	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 15.04.2022	\$	29.858	29.870
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2025	€	9.000	9.906	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 31.05.2020		26.200	26.289
U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.12.2024	\$	9.690	9.755	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)		17.499	18.115
U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 15.04.2022		9.438	9.442	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 30.11.2024		12.600	12.509
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,010 % fällig am 10.09.2025	€	5.000	5.972	U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.12.2024		9.690	10.323
Credit Agricole S.A. 0,500 % fällig am 24.06.2024		4.700	5.696	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.10.2024		4.900	5.096
U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	\$	4.900	4.888	Deutsche Bank AG 2,281 % fällig am 13.07.2020		3.700	3.704
Komatsu Finance America, Inc. 0,849 % fällig am 09.09.2023		4.700	4.700	FirstEnergy Corp. 1,600 % fällig am 15.01.2026		2.900	3.005
American Tower Corp. 1,300 % fällig am 15.09.2025		4.600	4.587	Crown Castle International Corp. 1,350 % fällig am 15.07.2025		2.900	2.942
Goldman Sachs Group, Inc. 3,375 % fällig am 27.03.2025	€	3.100	4.162	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.07.2025		2.900	2.896
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,474 % fällig am 08.07.2025	\$	3.900	3.900	Boston Scientific Corp. 1,900 % fällig am 01.06.2025		2.700	2.810
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co. 3,373 % fällig am 15.11.2025		3.500	3.601	BMW U.S. Capital LLC 2,000 % fällig am 11.04.2021		2.700	2.719
Societe Generale S.A. 1,488 % fällig am 14.12.2026		3.400	3.400	Dell International LLC 5,450 % fällig am 15.06.2023		2.300	2.543
Natwest Group PLC 2,359 % fällig am 22.05.2024		3.000	3.000	American Tower Corp. 1,300 % fällig am 15.09.2025		2.300	2.326
U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.07.2025		2.900	2.898	Westpac Banking Corp. 2,000 % fällig am 13.01.2023		2.100	2.179
FirstEnergy Corp. 1,600 % fällig am 15.01.2026		2.900	2.896	HPHT Finance Ltd. 2,875 % fällig am 05.11.2024		1.800	1.827
Crown Castle International Corp. 1,350 % fällig am 15.07.2025		2.900	2.892	Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 2,125 % fällig am 21.11.2022		1.700	1.756
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£	2.200	2.805	Medtronic Global Holdings S.C.A. 0,375 % fällig am 07.03.2023	€	1.500	1.696
Weyerhaeuser Co. 3,250 % fällig am 15.03.2023	\$	2.656	2.786	Pinnacle West Capital Corp. 1,300 % fällig am 15.06.2025	\$	1.600	1.637

(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)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	25.170.097	\$ 250.682	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	20.431.637	\$ 203.500
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	\$ 20.500	22.194	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	\$ 20.500	22.295
Citigroup Commercial Mortgage Trust 3,518 % fällig am 10.05.2035	15.420	16.049	Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	7.980	8.117
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 1,723 % fällig am 25.02.2035	13.067	13.026	U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.05.2029	4.300	4.984
Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 10.000	11.609	Nomura Holdings, Inc. 1,851 % fällig am 16.07.2025	4.700	4.848
GS Mortgage-Backed Securities Trust 3,750 % fällig am 25.10.2057	\$ 10.116	10.293	Infineon Technologies AG 0,750 % fällig am 24.06.2023	€ 3.900	4.680
Lloyds Banking Group PLC 1,326 % fällig am 15.06.2023	10.200	10.200	Broadcom, Inc. 3,150 % fällig am 15.11.2025	\$ 3.800	4.119
Polaris Holdings Ltd. 1,301 % fällig am 27.04.2057	£ 7.916	9.951	Mondelez International Holdings Netherlands BV 2,000 % fällig am 28.10.2021	3.621	3.634
Towd Point Mortgage Trust 4,750 % fällig am 25.10.2058	\$ 9.300	9.649	Credit Agricole S.A. 1,907 % fällig am 16.06.2026	3.400	3.495
Seagate HDD Cayman 3,375 % fällig am 15.07.2031	9.300	9.300	Barclays PLC 3,932 % fällig am 07.05.2025	3.100	3.382
Kraft Heinz Foods Co. 3,875 % fällig am 15.05.2027	8.545	9.003	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 1,412 % fällig am 17.07.2025	3.200	3.256
Countrywide Asset-Backed Certificates 0,358 % fällig am 25.05.2047	9.775	8.944	Pacific Gas & Electric Co. 1,699 % fällig am 16.06.2022	2.898	2.911
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,750 % fällig am 01.05.2029	8.800	8.800	AT&T, Inc. 2,750 % fällig am 01.06.2031	2.268	2.372
CIM Trust 3,015 % fällig am 25.06.2057	8.283	8.297	Alcon Finance Corp. 2,600 % fällig am 27.05.2030	2.100	2.222
Hayfin Emerald CLO DAC 1,450 % fällig am 15.02.2033	€ 7.200	8.271	VMware, Inc. 4,650 % fällig am 15.05.2027	1.670	1.959
Saudi Government International Bond 2,375 % fällig am 26.10.2021	\$ 7.980	8.106	Prologis International Funding S.A. 1,625 % fällig am 17.06.2032	€ 1.500	1.914
PetSmart, Inc. 4,500 % fällig am 11.03.2022	7.822	7.763	Equifax, Inc. 3,600 % fällig am 15.08.2021	\$ 1.800	1.856
Vendome Funding CLO DAC 1,860 % fällig am 20.07.2031	€ 6.649	7.515	Canadian Natural Resources Ltd. 3,450 % fällig am 15.11.2021	1.777	1.817
Parexel International Corp. 2,897 % fällig am 27.09.2024	\$ 7.800	7.475	Turkey Government International Bond 7,250 % fällig am 23.12.2023	1.750	1.768
Pacific Gas & Electric Co. 3,150 % fällig am 01.01.2026	7.114	7.447	Air Lease Corp. 3,750 % fällig am 01.02.2022	1.900	1.762

(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 (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	5.087.520	\$ 50.706
ONEOK, Inc.	142.800	4.252
Pembina Pipeline Corp.	120.200	2.687
	<b>PARI (000S)</b>	
ONEOK, Inc. 6,350 % fällig am 15.01.2031	\$ 2.500	2.528
	<b>AKTIEN</b>	
Equitrans Midstream Corp.	258.238	2.447
ONE Gas, Inc.	28.500	2.126
Williams Cos., Inc.	103.700	2.041
Enbridge, Inc.	68.200	2.021
	<b>PARI (000S)</b>	
Indigo Natural Resources LLC 6,875 % fällig am 15.02.2026	\$ 1.600	1.624
	<b>AKTIEN</b>	
Kinder Morgan, Inc.	111.900	1.623
	<b>PARI (000S)</b>	
Archrock Partners LP 6,875 % fällig am 01.04.2027	\$ 1.500	1.560
USA Compression Partners LP 6,875 % fällig am 01.09.2027	1.500	1.543
Buckeye Partners LP 5,850 % fällig am 15.11.2043	1.600	1.520
Occidental Petroleum Corp. 3,500 % fällig am 15.06.2025	1.600	1.512
Genesis Energy LP 6,500 % fällig am 01.10.2025	1.600	1.512
	<b>AKTIEN</b>	
CNX Resources Corp.	125.900	1.340
Targa Resources Corp.	67.100	1.321
EQT Corp.	82.900	1.275
TC Energy Corp.	28.000	1.261
American Tower Corp.	4.800	1.030

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	7.256.290	\$ 72.400
TC Energy Corp.	172.600	6.704
ONEOK, Inc.	183.070	5.313
Enbridge, Inc.	180.300	4.791
Kinder Morgan, Inc.	335.200	4.684
Cheniere Energy, Inc.	90.000	3.225
	<b>PARI (000S)</b>	
ONEOK, Inc. 6,350 % fällig am 15.01.2031	\$ 2.500	2.927
	<b>AKTIEN</b>	
Williams Cos., Inc.	184.800	2.564
Chevron Corp.	30.000	2.537
Total S.A.	64.000	2.293
BP PLC	530.000	2.205
ONE Gas, Inc.	28.500	2.106
ConocoPhillips	53.000	1.839
Canadian Natural Resources Ltd.	108.000	1.723
	<b>PARI (000S)</b>	
Indigo Natural Resources LLC 6,875 % fällig am 15.02.2026	\$ 1.600	1.620
USA Compression Partners LP 6,875 % fällig am 01.09.2027	1.500	1.564
Archrock Partners LP 6,875 % fällig am 01.04.2027	1.500	1.553
Genesis Energy LP 6,500 % fällig am 01.10.2025	1.600	1.540
Buckeye Partners LP 5,850 % fällig am 15.11.2043	1.600	1.476
Occidental Petroleum Corp. 3,500 % fällig am 15.06.2025	1.600	1.408

(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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	142.366.167	\$ 1.418.500
	<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.10.2050	\$ 77.100	82.587
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.02.2050	55.972	57.492
Uniform Mortgage-Backed Security 1,500 % fällig am 01.12.2035	43.000	44.017
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.11.2050	37.849	40.162
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.04.2050	30.000	32.150
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.03.2050	24.201	25.434
SMB Private Education Loan Trust 0,998 % fällig am 15.09.2054	25.000	24.104
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.08.2050	21.958	23.202
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.12.2050	20.567	22.491
Seasoned Loans Structured Transaction Trust 2,750 % fällig am 25.11.2029	21.521	21.995
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.01.2049	18.000	19.254
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2048	17.000	18.185
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.02.2049	17.000	18.100
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2049	16.126	17.158
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2049	16.000	17.115
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.07.2050	13.467	14.188
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.03.2050	12.960	13.770
Fannie Mae 3,840 % fällig am 01.09.2026	12.000	13.538
Harben Finance PLC 1,251 % fällig am 20.08.2056	£ 9.628	12.560

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	149.276.585	\$ 1.488.600
	<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.11.2049	\$ 76.447	75.748
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.02.2050	55.851	57.226
Uniform Mortgage-Backed Security 1,500 % fällig am 01.12.2035	42.715	43.702
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.04.2050	30.000	32.123
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.07.2049	25.377	26.891
Ginnie Mae 4,000 % fällig am 20.10.2049	24.838	26.367
Fannie Mae 2,242 % fällig am 25.12.2049	22.514	22.268
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2048	17.939	19.105
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2049	16.661	18.005
Ginnie Mae 4,500 % fällig am 20.06.2049	17.033	17.851
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	16.103	17.666
Fannie Mae 3,790 % fällig am 01.01.2029	15.033	17.426
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2049	16.000	17.025
Fannie Mae 2,480 % fällig am 01.02.2027	16.185	16.614
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2049	14.953	15.967
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.08.2048	14.527	15.539
Fannie Mae 3,840 % fällig am 01.09.2026	12.000	13.872
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.09.2048	11.918	12.749
Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.12.2049	11.939	12.612

(a) Der Mortgage 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	73.209.743	\$ 728.897	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	70.865.781	\$ 705.700
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.05.2021	\$ 129.900	132.234	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.02.2048	\$ 87.382	92.433
QNB Finance Ltd. 1,303 % fällig am 12.02.2022	14.800	14.800	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.11.2049	66.264	65.658
Towd Point Mortgage Trust 2,750 % fällig am 25.10.2057	12.585	12.948	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2049	38.928	40.814
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 30.09.2023	8.180	8.596	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.12.2049	25.001	24.773
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	7.608	8.574	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.10.2049	24.515	24.291
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 30.11.2023	7.120	7.504	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.12.2049	24.224	24.003
Atlas Senior Loan Fund Ltd. 1,088 % fällig am 20.04.2028	6.600	6.591	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.03.2048	22.407	23.702
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,130 % fällig am 08.07.2030	5.900	5.900	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.12.2047	22.379	23.673
KVK CLO Ltd. 1,129 % fällig am 14.01.2028	4.850	4.852	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.01.2048	21.050	22.267
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b)	3.647	4.626	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 30.09.2023	16.120	16.102
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.02.2044 (b)	3.126	4.446	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)	14.259	15.795
Pepper SPARKZ Trust No.3 1,067 % fällig am 17.08.2028	AUD 5.600	4.220	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2049 (b)	9.455	12.931
Wells Fargo & Co. 1,741 % fällig am 04.05.2030	€ 3.200	3.997	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.01.2048	12.095	12.794
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.05.2047	\$ 3.813	3.908	Santander UK PLC 2,875 % fällig am 18.06.2024	9.300	9.964
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,474 % fällig am 08.07.2025	3.300	3.300	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.05.2048	8.695	9.198
Nomura Holdings, Inc. 1,851 % fällig am 16.07.2025	2.900	2.900	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.06.2048	7.401	7.857
Wells Fargo & Co. 0,625 % fällig am 25.03.2030	€ 2.400	2.784	Banco Santander Chile 1,791 % fällig am 27.07.2020	7.000	7.018
European Loan Conduit 1,000 % fällig am 17.02.2030	2.400	2.649	Lloyds Banking Group PLC 2,858 % fällig am 17.03.2023	6.700	6.890
Nissan Motor Co. Ltd. 3,043 % fällig am 15.09.2023	\$ 2.600	2.600	Japan Finance Organization for Municipalities 2,000 % fällig am 08.09.2020	6.800	6.829

(a) Der StocksPLUSTM 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	50.331	\$ 501	Horse Gallop Finance Ltd. 3,250 % fällig am 30.05.2022	\$ 200	\$ 207
	<b>PARI (000S)</b>			<b>AKTIEN</b>	
QNB Finance Ltd. 1,310 % fällig am 12.02.2022	\$ 200	200	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	20.087	200
Nomura Resecuritization Trust 1,979 % fällig am 27.01.2037	150	150		<b>PARI (000S)</b>	
Aker BP ASA 3,000 % fällig am 15.01.2025	150	150	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.11.2049	\$ 199	198
Wells Fargo & Co. 1,338 % fällig am 04.05.2025	€ 100	121	Southern California Edison Co. 3,700 % fällig am 01.08.2025	100	112
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	\$ 107	109	Prestige Brands, Inc. 5,125 % fällig am 15.01.2028	100	105
Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026	104	105	VICI Properties LP 4,250 % fällig am 01.12.2026	100	103
CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 12.05.2026	€ 100	105	Kaiser Aluminum Corp. 4,625 % fällig am 01.03.2028	100	103
Southern California Edison Co. 3,700 % fällig am 01.08.2025	\$ 100	103	Arconic Corp. 6,125 % fällig am 15.02.2028	100	102
Transocean, Inc. 8,000 % fällig am 01.02.2027	100	100	WPX Energy, Inc. 4,500 % fällig am 15.01.2030	100	102
Arconic Corp. 6,125 % fällig am 15.02.2028	100	100	Albertsons Cos., Inc. 4,625 % fällig am 15.01.2027	100	101
WPX Energy, Inc. 4,500 % fällig am 15.01.2030	100	100	Occidental Petroleum Corp. 1,163 % fällig am 08.02.2021	100	101
VICI Properties LP 3,750 % fällig am 15.02.2027	100	100	Georgia Power Co. 2,650 % fällig am 15.09.2029	100	100
Pretium Mortgage Credit Partners LLC 3,179 % fällig am 27.06.2069	100	100	Transocean, Inc. 8,000 % fällig am 01.02.2027	100	50
Georgia Power Co. 2,650 % fällig am 15.09.2029	100	99			
Pacific Gas & Electric Co. 4,550 % fällig am 01.07.2030	5	6	(a) Der PIMCO StocksPLUSTM 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 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	53.867.343	\$ 537.108	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	61.840.734	\$ 616.900
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2049	\$ 22.998	24.479	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.10.2024	\$ 16.400	17.234
	<b>AKTIEN</b>		U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.12.2023	11.890	12.396
Exxon Mobil Corp.	265.476	10.686	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.06.2024	9.600	9.956
	<b>PARI (000S)</b>		Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2049	85.169	9.040
iHeartCommunications, Inc. 3,147 % fällig am 01.05.2026	\$ 9.035	9.035		<b>AKTIEN</b>	
Kraft Heinz Foods Co. 5,500 % fällig am 01.06.2050	7.323	8.772	Procter & Gamble Co.	42.522	5.185
	<b>AKTIEN</b>		Walmart, Inc.	40.629	5.168
AbbVie, Inc.	96.297	8.663	Sanofi	49.002	4.698
Altria Group, Inc.	214.171	8.551	JPMorgan Chase & Co.	48.978	4.655
	<b>PARI (000S)</b>		International Business Machines Corp.	37.739	4.577
Sprint Corp. 7,875 % fällig am 15.09.2023	\$ 7.681	8.220	HSBC Holdings PLC	864.197	4.221
	<b>AKTIEN</b>		Exxon Mobil Corp.	100.837	4.149
AT&T, Inc.	262.510	7.813	Merck & Co., Inc.	51.938	4.035
BHP Group Ltd.	293.193	7.505	American International Group, Inc.	140.102	4.017
	<b>PARI (000S)</b>		Banco Santander S.A.	1.661.437	4.009
United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.10.2027	\$ 7.022	7.022	Toyota Motor Corp.	60.800	3.973
VMware, Inc. 4,700 % fällig am 15.05.2030	5.714	6.773	Wells Fargo & Co.	147.802	3.961
Intesa Sanpaolo SpA 7,000 % fällig am 19.01.2021	€ 5.566	6.479	AT&T, Inc.	128.454	3.801
	<b>AKTIEN</b>		Roche Holding AG	11.264	3.787
Philip Morris International, Inc.	76.562	5.784		<b>PARI (000S)</b>	
International Business Machines Corp.	49.053	5.696	Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.07.2049	\$ 3.547	3.744
CenturyLink, Inc.	555.439	5.541			
Occidental Petroleum Corp.	366.575	5.252	(a) Der Strategic Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.		
	<b>PARI (000S)</b>		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.		
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.01.2050	\$ 4.506	4.796	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.		
	<b>AKTIEN</b>				
Total S.A.	118.727	4.710			
	<b>PARI (000S)</b>				
Host Hotels & Resorts LP 3,500 % fällig am 15.09.2030	\$ 4.700	4.639			

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	74.881.452	\$ 746.722
	<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.08.2050	\$ 137.800	137.287
U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	124.800	124.480
Freddie Mac 0,690 % fällig am 05.08.2025	96.900	96.900
U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	70.900	71.088
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.07.2050	55.000	58.109
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.05.2035	54.995	58.067
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.03.2050	55.000	58.016
Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.08.2049	45.996	48.876
Freddie Mac 0,650 % fällig am 22.10.2025	44.400	44.400
Freddie Mac 0,650 % fällig am 27.10.2025	39.400	39.400
Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	37.400	37.896
Uniform Mortgage-Backed Security 0,700 % fällig am 18.08.2025	35.100	35.100
U.S. Treasury Bonds 3,625 % fällig am 15.02.2044	24.700	34.991
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.11.2033	30.047	31.841
Ginnie Mae 4,000 % fällig am 20.08.2049	29.595	31.306
Jupiter Mortgage Ltd. 0,000 % fällig am 06.01.2060	23.600	31.263
CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 05.12.2026	29.600	31.242
Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.09.2049	28.668	30.453
U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 02.15.2050	26.200	30.308

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	62.602.834	\$ 625.000
	<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044	\$ 108.500	144.305
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	124.205	137.699
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	104.100	114.316
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.12.2048	88.104	93.803
Ginnie Mae 4,500 % fällig am 20.06.2049	62.960	65.853
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b)	58.482	60.273
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.03.2050	55.000	58.111
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.07.2050	51.205	53.997
Development Bank of Japan, Inc. 2,500 % fällig am 18.10.2022	50.000	52.020
American Express Co. 2,750 % fällig am 20.05.2022	38.300	39.240
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	35.223	35.829
Ginnie Mae 4,000 % fällig am 20.08.2049	29.595	31.327
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2046 (b)	23.532	30.327
Dexia Credit Local S.A. 2,375 % fällig am 20.09.2022	29.200	30.305
Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.09.2049	26.921	28.957
Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029	€ 25.600	26.945
Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 30.04.2029	22.700	25.783
Stadshypotek AB 2,500 % fällig am 05.04.2022	24.800	25.432
Fannie Mae 2,870 % fällig am 09.01.2027	\$ 22.100	24.726

(a) Der Total Return 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 (000\$)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	642.641	\$ 6.401
	<b>PARI (000\$)</b>	
Gallatin CLO Ltd. 1,537 % fällig am 15.07.2027	\$ 466	466
Citigroup, Inc. 1,322 % fällig am 17.05.2024	300	298
Sage AR Funding No. 1 PLC 0,000 % fällig am 17.11.2030	£ 200	261
Hydro One, Inc. 0,710 % fällig am 16.01.2023	CAD 300	226
Standard Chartered PLC 1,335 % fällig am 14.10.2023	\$ 200	200
SMB Private Education Loan Trust 0,448 % fällig am 15.09.2054	137	136
JPMorgan Chase & Co. 1,445 % fällig am 24.10.2023	100	102
Bank of America Corp. 1,015 % fällig am 05.03.2024	100	101

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	461.856	\$ 4.600
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	4.800	482
	<b>PARI (000\$)</b>	
Banco Santander Chile 2,594 % fällig am 25.07.2020	\$ 400	401
Citibank N.A. 0,977 % fällig am 20.05.2022	300	301
AIA Group Ltd. 0,826 % fällig am 20.09.2021	200	199
Occidental Petroleum Corp. 1,842 % fällig am 15.08.2022	200	169
EFS Volunteer LLC 1,841 % fällig am 25.10.2035	135	134
Utah State Board of Regents 0,918 % fällig am 25.01.2057	83	83

(a) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy 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)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)	159.000	£ 16.304	PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)	321.300	£ 32.613
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030	€ 8.500	7.248	Lloyds Banking Group PLC 2,250 % fällig am 16.10.2024	£ 3.600	3.721
E.ON International Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034	£ 4.300	5.589	E.ON International Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034	2.700	3.618
Abertis Infraestructuras S.A. 3,375 % fällig am 27.11.2026	5.200	5.492	Lloyds Bank Corporate Markets PLC 1,750 % fällig am 11.07.2024	3.350	3.438
HSBC Holdings PLC 3,000 % fällig am 29.05.2030	4.400	4.615	AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	€ 3.300	3.086
Credit Suisse Group AG 2,250 % fällig am 09.06.2028	4.500	4.486	GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 04.11.2020	£ 2.700	2.800
Deutsche Bank AG 2,625 % fällig am 16.12.2024	4.300	4.373	General Electric Co. 5,250 % fällig am 07.12.2028	2.100	2.434
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	4.300	4.290	Glencore Finance Europe Ltd. 6,000 % fällig am 03.04.2022	1.900	2.040
General Electric Co. 5,250 % fällig am 07.12.2028	3.289	4.155	Siemens Financieringsmaatschappij NV 0,875 % fällig am 05.06.2023	2.000	2.029
Tesco Property Finance PLC 5,411 % fällig am 13.07.2044	30.356	3.992	Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023	€ 2.100	1.964
Enel Finance International NV 1,000 % fällig am 20.10.2027	3.900	3.890	CaixaBank S.A. 0,625 % fällig am 01.10.2024	2.000	1.680
Wells Fargo & Co. 2,500 % fällig am 02.05.2029	3.600	3.835	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.11.2025	1.800	1.679
Cadent Finance PLC 2,625 % fällig am 22.09.2038	3.500	3.779	New York Life Global Funding 1,625 % fällig am 15.12.2023	£ 1.600	1.659
AT&T, Inc. 4,250 % fällig am 01.06.2043	3.000	3.726	Logicor UK PLC 1,875 % fällig am 17.11.2026	1.600	1.635
National Grid Electricity Transmission PLC 1,125 % fällig am 07.07.2028	3.700	3.683	Credit Suisse Group AG 4,194 % fällig am 01.04.2031	\$ 1.800	1.631
Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 27.03.2037	2.500	3.596	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 3,250 % fällig am 15.04.2022	€ 1.900	1.630
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 1,125 % fällig am 11.02.2027	3.600	3.573	InterContinental Hotels Group PLC 2,125 % fällig am 24.08.2026	£ 1.700	1.629
GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 18.01.2033	2.700	3.532	National Grid Electricity Transmission PLC 1,125 % fällig am 07.07.2028	1.600	1.623
Comcast Corp. 1,500 % fällig am 20.02.2029	3.500	3.524	Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 27.03.2037	1.100	1.606
London & Quadrant Housing Trust 2,000 % fällig am 20.10.2038	3.400	3.497	HSBC Holdings PLC 3,000 % fällig am 29.05.2030	1.500	1.605

(a) Der UK 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)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)	355.000	£ 36.425	United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.01.2045	£ 21.200	£ 34.949
	<b>PARI (000S)</b>			<b>AKTIEN</b>	
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.10.2061	£ 5.900	5.715	PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)	333.500	34.137
Spain Government International Bond 0,500 % fällig am 30.04.2030	€ 6.300	5.372		<b>PARI (000S)</b>	
Heathrow Funding Ltd. 4,625 % fällig am 31.10.2046	£ 3.127	4.117	United Kingdom Gilt 4,000 % fällig am 22.01.2060	£ 3.600	7.947
Pfizer, Inc. 2,735 % fällig am 15.06.2043	3.100	3.665	United Kingdom Gilt 3,250 % fällig am 22.01.2044	3.900	6.143
Verizon Communications, Inc. 3,375 % fällig am 27.10.2036	2.900	3.434	United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2046	3.200	6.068
Morhomes PLC 3,400 % fällig am 19.02.2038	3.000	3.387	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % fällig am 15.09.2026	5.000	5.055
AT&T, Inc. 4,250 % fällig am 01.06.2043	2.800	3.378	Europäische Investitionsbank 6,000 % fällig am 07.12.2028	3.400	4.754
Goldman Sachs Group, Inc. 4,411 % fällig am 23.04.2039	\$ 3.000	2.841	AT&T, Inc. 4,250 % fällig am 01.06.2043	2.750	2.763
University of Oxford 2,544 % fällig am 08.12.2117	£ 1.800	2.706	Verizon Communications, Inc. 3,375 % fällig am 27.10.2036	2.350	2.681
E.ON International Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034	2.000	2.599	E.ON International Finance BV 5,875 % fällig am 30.10.2037	1.450	2.283
GlaxoSmithKline Capital PLC 1,625 % fällig am 12.05.2035	2.500	2.494	Lloyds Bank PLC 4,875 % fällig am 30.03.2027	1.700	2.153
Society of Lloyd's 4,875 % fällig am 07.02.2047	2.100	2.306	University of Oxford 2,544 % fällig am 08.12.2117	1.946	2.129
Abertis Infraestructuras S.A. 3,375 % fällig am 27.11.2026	2.100	2.218	GlaxoSmithKline Capital PLC 1,625 % fällig am 12.05.2035	2.000	2.054
Grainger PLC 3,000 % fällig am 03.07.2030	1.900	1.973	Orsted A/S 4,875 % fällig am 12.01.2032	1.400	1.949
Cadent Finance PLC 2,625 % fällig am 22.09.2038	1.800	1.945	AT&T, Inc. 4,875 % fällig am 01.06.2044	1.800	1.943
E.ON International Finance BV 5,875 % fällig am 30.10.2037	1.300	1.940	Walmart, Inc. 5,625 % fällig am 27.03.2034	1.150	1.777
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	1.900	1.895	Lloyds Bank PLC 6,000 % fällig am 08.02.2029	1.200	1.705
Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 27.03.2037	1.300	1.858	Welltower, Inc. 4,800 % fällig am 20.11.2028	1.400	1.606
Comcast Corp. 1,875 % fällig am 20.02.2036	1.800	1.799	British Telecommunications PLC 3,125 % fällig am 21.11.2031	1.750	1.569
			BHP Billiton Finance USA Ltd. 5,000 % fällig am 30.09.2043	\$ 1.400	1.551

(a) Der UK Long Term 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)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	64.408.595	\$ 641.437	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	42.206.205	\$ 420.900
	<b>PARI (000S)</b>		PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (a)	10.469.912	102.919
Ortho-Clinical Diagnostics, Inc. 7,250 % fällig am 01.02.2028	\$ 31.500	31.986		<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030	30.000	29.857	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 31.10.2023	\$ 66.100	71.721
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	20.000	21.438	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2024	27.000	29.188
Global Medical Response, Inc. 6,500 % fällig am 01.10.2025	11.500	11.542	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 30.11.2024	20.000	21.024
CCO Holdings LLC 4,500 % fällig am 15.08.2030	11.000	11.128	U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.12.2024	10.000	10.614
Kraft Heinz Foods Co. 5,000 % fällig am 04.06.2042	10.322	10.530	Illuminate Buyer LLC 9,000 % fällig am 01.07.2028	5.875	6.269
Arches Buyer, Inc. 6,125 % fällig am 01.12.2028	10.300	10.300	Community Health Systems, Inc. 5,125 % fällig am 01.08.2021	5.500	5.507
White Cap Buyer LLC 6,875 % fällig am 15.10.2028	10.000	10.175	Trivium Packaging Finance BV 8,500 % fällig am 15.08.2027	5.000	5.473
Zayo Group Holdings, Inc. 6,125 % fällig am 01.03.2028	10.000	10.088	Chemours Co. 7,000 % fällig am 15.05.2025	5.000	5.153
CCO Holdings LLC 4,250 % fällig am 01.02.2031	10.000	10.084	SRC Energy, Inc. 6,250 % fällig am 01.12.2025	5.000	5.050
U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.12.2024	10.000	10.056	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7,000 % fällig am 30.06.2024	4.000	4.645
Scripps Escrow, Inc. 5,375 % fällig am 15.01.2031	10.050	10.050	Ally Financial, Inc. 3,875 % fällig am 21.05.2024	4.000	4.198
Graham Packaging Co., Inc. 7,125 % fällig am 15.08.2028	10.000	10.044	Shelf Drilling Holdings Ltd. 8,250 % fällig am 15.02.2025	4.000	3.868
Tenet Healthcare Corp. 6,125 % fällig am 01.10.2028	10.000	9.974	GrafTech Finance, Inc. 4,625 % fällig am 15.12.2028	3.500	3.522
MPH Acquisition Holdings LLC 5,750 % fällig am 01.11.2028	10.000	9.830	VICI Properties LP 3,750 % fällig am 15.02.2027	3.875	3.388
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	10.000	9.737	Envision Healthcare Corp. 8,750 % fällig am 15.10.2026	6.000	3.248
Western Midstream Operating LP 6,250 % fällig am 01.02.2050	11.400	9.602	CP Atlas Buyer, Inc. 7,000 % fällig am 01.12.2028	2.750	2.869
LifePoint Health, Inc. 5,375 % fällig am 15.01.2029	9.375	9.375	ADT Security Corp. 3,500 % fällig am 15.07.2022	3.000	2.680
Innophos Holdings, Inc. 9,375 % fällig am 15.02.2028	8.750	9.175	Air Methods Corp. 8,000 % fällig am 15.05.2025	3.375	2.627

(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)
<b>KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>			<b>VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	77.589.036	\$ 772.540	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	79.101.876	\$ 787.900
	<b>PARI (000S)</b>			<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	\$ 111.546	118.037	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 15.02.2030	\$ 111.546	119.710
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	77.900	77.780	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	77.900	77.542
U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.02.2050	52.550	60.881	U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 15.11.2029	51.067	53.047
U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.08.2050	32.930	31.899	U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.08.2049	30.970	35.920
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.08.2030	28.616	28.302	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.08.2030	28.616	28.000
U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030	20.900	20.810	U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.11.2049	16.266	19.816
U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.11.2049	16.266	18.623	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2049	9.998	12.963
Morgan Stanley 2,188 % fällig am 28.04.2026	11.600	11.600	U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.02.2050	11.500	12.735
U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.08.2049	9.600	10.706	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030	12.230	12.155
U.S. Treasury Bonds 1,250 % fällig am 15.05.2050	10.644	10.595	U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.08.2050	12.170	11.479
Comcast Corp. 2,800 % fällig am 15.01.2051	9.100	9.032	Comcast Corp. 2,800 % fällig am 15.01.2051	9.100	9.074
U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 15.11.2029	8.800	8.732	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,875 % fällig am 18.09.2023	4.800	4.832
Walt Disney Co. 1,750 % fällig am 13.01.2026	5.700	5.685	U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 15.08.2029	4.775	4.776
GE Capital Funding LLC 4,400 % fällig am 15.05.2030	5.050	5.253	Verizon Communications, Inc. 4,329 % fällig am 21.09.2028	3.900	4.713
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,474 % fällig am 08.07.2025	5.200	5.248	U.S. Treasury Bonds 1,250 % fällig am 15.05.2050	4.700	4.414
CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 12.05.2026	€ 4.800	5.076	Santander UK PLC 1,625 % fällig am 12.02.2023	4.100	4.208
T-Mobile USA, Inc. 2,550 % fällig am 15.02.2031	\$ 4.900	5.017	AT&T, Inc. 2,750 % fällig am 01.06.2031	3.800	3.970
Boeing Co. 5,705 % fällig am 01.05.2040	5.000	4.997	ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026	3.600	3.753
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,875 % fällig am 18.09.2023	4.800	4.795	NVR, Inc. 3,000 % fällig am 15.05.2030	3.400	3.679

(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.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung US Short-Term Fund

31. Dezember 2020 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
<b>KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	128.784.789	\$ 1.283.037
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	3.354.112	339.796
	<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.01.2022	\$ 231.100	230.820
U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 31.03.2022	230.200	230.636
Freddie Mac 0,700 % fällig am 19.08.2025	205.000	204.986
U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 30.11.2022	114.400	114.334
Freddie Mac 0,690 % fällig am 05.08.2025	80.000	80.000
Freddie Mac 0,650 % fällig am 22.10.2025	75.000	75.000
Freddie Mac 0,750 % fällig am 28.07.2025	75.000	75.000
Freddie Mac 0,700 % fällig am 12.08.2025	75.000	75.000
Freddie Mac 0,700 % fällig am 18.08.2025	65.000	65.000
Fannie Mae 0,770 % fällig am 15.07.2025	64.000	64.000
Freddie Mac 0,900 % fällig am 30.06.2025	60.000	60.000
Freddie Mac 0,750 % fällig am 04.08.2025	60.000	60.000
Freddie Mac 0,800 % fällig am 28.10.2026	60.000	59.991
Freddie Mac 0,800 % fällig am 21.07.2025	58.000	58.000
Freddie Mac 0,800 % fällig am 30.07.2025	50.000	50.000
Freddie Mac 0,800 % fällig am 27.10.2026	50.000	49.993
Canada Government International Bond 1,500 % fällig am 01.05.2022	CAD 68.000	49.314
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.10.2049	\$ 42.393	44.901

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
<b>VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2020</b>		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	142.239.991	\$ 1.418.200
	<b>PARI (000S)</b>	
U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.01.2022	\$ 231.100	235.993
U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 31.03.2022	230.200	230.989
U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.07.2021	211.500	215.598
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	93.395	104.650
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2049	50.558	53.007
Canada Government International Bond 1,500 % fällig am 01.05.2022	CAD 68.000	51.812
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.10.2049	\$ 39.522	42.063
	<b>AKTIEN</b>	
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	393.850	38.531
	<b>PARI (000S)</b>	
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.08.2049	\$ 36.651	37.894
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.06.2049	34.997	35.785
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.09.2049	34.672	35.458
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.02.2050	33.755	34.978
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.05.2049	32.514	33.616
Mexico Government International Bond 7,250 % fällig am 09.12.2021	MXN 569.830	22.902
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	\$ 18.323	18.569
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.10.2047	15.966	16.732
Mizuho Financial Group, Inc. 1,101 % fällig am 11.09.2022	16.400	16.518
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	14.605	15.864
Freddie Mac 0,700 % fällig am 12.08.2025	15.000	15.003

(a) Der US Short-Term 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.

**Portfolioumschlagsrate**

Dieser Bericht wurde zur Unterstützung der Offenlegungen gemäß der Shareholder Rights Directive II für institutionelle Anleger erstellt.

Die Länge des Zeitraums, über den ein Fonds ein bestimmtes Wertpapier enthielt, beruht nicht unbedingt auf Anlageentscheidungen. Eine Veränderung in den von einem Fonds gehaltenen Wertpapieren bezeichnet man als „Portfolio-Umschlag“. Jeder Fonds kann sich am häufigen und aktiven Handel der Portfoliowertpapiere beteiligen, um sein Anlageziel zu erreichen, insbesondere in Zeiträumen volatiler Marktbewegungen. Ein hoher Portfolioumschlag kann mit entsprechend höheren Transaktionskosten verbunden sein, darunter Maklerprovisionen oder Händleraufschläge sowie sonstige Transaktionskosten für den Verkauf von Wertpapieren und die Wiederanlage in anderen Wertpapieren, die vom Fonds getragen werden. Diese Verkäufe können ebenfalls zum Realisieren bester Kapitalerträge führen, einschließlich kurzfristiger Kapitalerträge (die gewöhnlich bei der Ausschüttung an Anteilinhaber mit den allgemeinen Einkommenssteuersätzen besteuert werden). Die mit dem Portfolioumschlag verbundenen Transaktionskosten können die Wertentwicklung eines Fonds beeinträchtigen.

Der Portfolioumschlag für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2020 und zum 31. Dezember 2019 für jeden Fonds beträgt:

Fondsbezeichnung	2020		2019	
	Portfolioumschlagsrate	Portfolioumschlagsrate	Portfolioumschlagsrate	Portfolioumschlagsrate
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	106 %		150 %	
Asia Strategic Interest Bond Fund	118 %		127 %	
PIMCO Capital Securities Fund	39 %		37 %	
PIMCO Climate Bond Fund	272 %		k. A.	
Commodity Real Return Fund	219 %		239 %	
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	74 %		102 %	
Diversified Income Fund	186 %		129 %	
Diversified Income Duration Hedged Fund	186 %		148 %	
Dynamic Bond Fund	463 %		306 %	
Dynamic Multi-Asset Fund	30 %		43 %	
Emerging Local Bond Fund	173 %		199 %	
Emerging Markets Bond Fund	110 %		66 %	
Emerging Markets Bond ESG Fund	86 %		102 %	
Emerging Markets Corporate Bond Fund	53 %		67 %	
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	262 %		208 %	
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	89 %		29 %	
Euro Bond Fund	224 %		188 %	
Euro Credit Fund	187 %		126 %	
Euro Income Bond Fund	283 %		222 %	
Euro Long Average Duration Fund	210 %		205 %	
Euro Short-Term Fund	23 %		39 %	
PIMCO European High Yield Bond Fund	130 %		k. A.	
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	251 %		103 %	
Global Advantage Fund	545 %		398 %	
Global Advantage Real Return Fund	31 %		288 %	
Global Bond Fund	569 %		414 %	
Global Bond ESG Fund	521 %		305 %	
Global Bond Ex-US Fund	529 %		292 %	
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	262 %		556 %	
Global High Yield Bond Fund	35 %		22 %	
Global Investment Grade Credit Fund	189 %		195 %	
Global Investment Grade Credit ESG Fund	167 %		257 %	
Global Libor Plus Bond Fund	375 %		295 %	
Global Low Duration Real Return Fund	212 %		284 %	
Global Real Return Fund	197 %		264 %	
Income Fund	414 %		342 %	
Inflation Strategy Fund	330 %		420 %	
Low Average Duration Fund	480 %		284 %	
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	142 %		108 %	
Low Duration Income Fund	520 %		397 %	
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	82 %		55 %	
Mortgage Opportunities Fund	991 %		852 %	
PIMCO RAE Emerging Markets Fund	66 %		95 %	
PIMCO RAE Europe Fund	100 %		58 %	
PIMCO RAE Global Developed Fund	48 %		49 %	
PIMCO RAE US Fund	124 %		19 %	
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund	45 %		32 %	
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund	34 %		36 %	
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund	37 %		42 %	
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund	121 %		39 %	
StocksPLUS™ Fund	271 %		227 %	
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	639 %		450 %	
Strategic Income Fund	375 %		269 %	
Total Return Bond Fund	540 %		562 %	
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	12 %		58 %	
UK Corporate Bond Fund	36 %		62 %	
UK Long Term Corporate Bond Fund	52 %		49 %	
US High Yield Bond Fund	32 %		29 %	
US Investment Grade Corporate Bond Fund	166 %		231 %	
US Short-Term Fund	119 %		75 %	

Folgende Wertpapierarten werden von der Berechnung der Portfolioumschlagsrate nicht berücksichtigt: Rückkäufe, kurzfristige Investmentfonds, derivative Finanzinstrumente und kurzfristige Instrumente mit einer Laufzeit von weniger als 365 Tagen.

**Abkürzungen der Kontrahenten:**

<b>AZD</b>	Australia and New Zealand Banking Group	<b>DEU</b>	Deutsche Bank Securities, Inc.	<b>MYC</b>	Morgan Stanley Capital Services LLC
<b>BCY</b>	Barclays Capital, Inc.	<b>DUB</b>	Deutsche Bank AG	<b>MVI</b>	Morgan Stanley & Co. International PLC
<b>BOA</b>	Bank of America N.A.	<b>FAR</b>	Wells Fargo Bank National Association	<b>NGF</b>	Nomura Global Financial Products, Inc.
<b>BOM</b>	Bank of Montreal	<b>FBF</b>	Credit Suisse International	<b>NOM</b>	Nomura Securities International Inc.
<b>BOS</b>	Banc of America Securities LLC	<b>FICC</b>	Fixed Income Clearing Corporation	<b>NXN</b>	Natixis New York
<b>BPG</b>	BNP Paribas Securities Corp.	<b>FOB</b>	Credit Suisse Securities (USA) LLC	<b>RBC</b>	Royal Bank of Canada
<b>BPS</b>	BNP Paribas S.A.	<b>GLM</b>	Goldman Sachs Bank USA	<b>RCY</b>	Royal Bank of Canada
<b>BRC</b>	Barclays Bank PLC	<b>GRE</b>	NatWest Markets Securities Inc.	<b>RDR</b>	RBC Capital Markets LLC
<b>BSH</b>	Banco Santander S.A. - New York Branch	<b>GSC</b>	Goldman Sachs & Co. LLC	<b>RVM</b>	Barclays Capital, Inc.
<b>BSN</b>	The Bank of Nova Scotia - Toronto	<b>GST</b>	Goldman Sachs International	<b>RYL</b>	NatWest Markets Plc
<b>BSS</b>	Banco Santander S.A.	<b>HUS</b>	HSBC Bank USA N.A.	<b>SAL</b>	Citigroup Global Markets, Inc.
<b>CBK</b>	Citibank N.A.	<b>IND</b>	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	<b>SCX</b>	Standard Chartered Bank, London
<b>CDC</b>	Natixis Securities Americas LLC			<b>SGY</b>	Societe Generale, NY
<b>CEW</b>	Canadian Imperial Bank of Commerce	<b>JLN</b>	JP Morgan Chase Bank N.A. London	<b>SOG</b>	Societe Generale Paris
<b>CFR</b>	Credit Suisse Securities (Europe) Ltd.	<b>JML</b>	JP Morgan Securities Plc	<b>SSB</b>	State Street Bank and Trust Co.
<b>CIB</b>	Canadian Imperial Bank of Commerce	<b>JPM</b>	JP Morgan Chase Bank N.A.	<b>TDM</b>	TD Securities (USA) LLC
<b>CIW</b>	CIBC World Markets Corp.	<b>JPS</b>	JP Morgan Securities, Inc.	<b>TOR</b>	The Toronto-Dominion Bank
<b>CKL</b>	Citibank N.A. London	<b>MEC</b>	HSBC Bank Plc	<b>UAG</b>	UBS AG Stamford
<b>CSN</b>	Credit Suisse AG (New York)	<b>MEI</b>	Merrill Lynch International	<b>UBS</b>	UBS Securities LLC
<b>DBL</b>	Deutsche Bank AG London	<b>MFK</b>	Millenium BCP	<b>ULO</b>	UBS Securities LLC
<b>BCY</b>	Barclays Capital, Inc.	<b>MSC</b>	Morgan Stanley & Co., Inc.	<b>WFS</b>	Wells Fargo Securities, LLC

**Währungskürzel:**

<b>AED</b>	Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	<b>GHS</b>	Ghanaischer Cedi	<b>PHP</b>	Philippinischer Peso
<b>ARS</b>	Argentinischer Peso	<b>HKD</b>	Hongkong-Dollar	<b>PLN</b>	Polnischer Zloty
<b>AUD</b>	Australischer Dollar	<b>HUF</b>	Ungarischer Forint	<b>RON</b>	Rumänischer neuer Leu
<b>BRL</b>	Brasilianischer Real	<b>IDR</b>	Indonesische Rupie	<b>RSD</b>	Serbischer Dinar
<b>CAD</b>	Kanadischer Dollar	<b>ILS</b>	Israelischer Shekel	<b>RUB</b>	Russischer Rubel
<b>CHF</b>	Schweizer Franken	<b>INR</b>	Indische Rupie	<b>SEK</b>	Schwedische Krone
<b>CLP</b>	Chilenischer Peso	<b>JPY (oder ¥)</b>	Japanischer Yen	<b>SGD</b>	Singapur-Dollar
<b>CNH</b>	Chinesische Renminbi (Offshore)	<b>KES</b>	Kenia-Schilling	<b>THB</b>	Thailändischer Baht
<b>CNY</b>	Chinesische Renminbi (Mainland)	<b>KRW</b>	Südkoreanischer Won	<b>TRY</b>	Türkische neue Lira
<b>COP</b>	Kolumbianischer Peso	<b>KZT</b>	Kasachischer Tenge	<b>TWD</b>	Taiwanesischer Dollar
<b>CZK</b>	Tschechische Krone	<b>MXN</b>	Mexikanischer Peso	<b>UAH</b>	Ukrainische Hrywnja
<b>DKK</b>	Dänische Krone	<b>MYR</b>	Malaysischer Ringgit	<b>USD (oder \$)</b>	US-Dollar
<b>DOP</b>	Dominikanischer Peso	<b>NGN</b>	Nigerianische Naira	<b>UYU</b>	Uruguayischer Peso
<b>EGP</b>	Ägyptisches Pfund	<b>NOK</b>	Norwegische Krone	<b>VND</b>	Vietnamesischer Dong
<b>EUR (oder €)</b>	Euro	<b>NZD</b>	Neuseeländischer Dollar	<b>ZAR</b>	Südafrikanischer Rand
<b>GBP (oder £)</b>	Britisches Pfund	<b>PEN</b>	Peruanischer neuer Sol		

**Börsenkürzel:**

<b>CBOT</b>	Chicago Board of Trade	<b>FTSE</b>	Financial Times Stock Exchange	<b>OTC</b>	Over the Counter
<b>CME</b>	Chicago Mercantile Exchange	<b>MSE</b>	Montreal Stock Exchange	<b>WIG20</b>	Warsaw Stock Exchange

**Index-/Spread-Kürzel:**

<b>ABX.HE</b>	Asset-Backed Securities Index - Home Equity	<b>CPTFEMU</b>	Eurozone HICP ex-Tobacco Index	<b>NASDAQ</b>	National Association of Securities Dealers
<b>AMZX</b>	Alerian MLP Total Return Index	<b>CPURNSA</b>	Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index		Automated Quotations
<b>BCOMF1T</b>	Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return	<b>DAX</b>	Deutscher Aktien Index 30	<b>OMX</b>	Stockholm 30 Index
<b>BCOMTR</b>	Bloomberg Commodity Index Total Return	<b>DWRTFT</b>	South African Performance Index	<b>PrimeX.ARM</b>	Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage
<b>BOVESPA</b>	Brazil Bovespa Index	<b>FTSE/JSE</b>	Dow Jones Wilshire REIT Total Return Index	<b>S&amp;P 500</b>	Standard & Poor's 500 Index
<b>CAC</b>	Cotation Assistée en Continu	<b>FTSE/MIB</b>	Index der 40 italienischen Aktien mit der höchsten Liquidität/Marktkapitalisierung der Borsa Italiana	<b>S&amp;P CNX Nifty</b>	Standard & Poor's Nifty 50 Index
<b>CDX.EM</b>	Credit Derivatives Index - Emerging Markets	<b>FRCPTOB</b>	Französischer Verbraucherpreisindex ohne Tabak	<b>SPI 200</b>	Australian Equity Futures Index
<b>CDX.HY</b>	Credit Derivatives Index - High Yield	<b>IBEX 35</b>	Spanish Continuous Exchange Index	<b>SXIE</b>	STOXX Insurance EUR Price
<b>CDX.IG</b>	Credit Derivatives Index - Investment Grade	<b>IBR</b>	Indicador Bancario de Referencia	<b>TOPIX</b>	Tokyo Price Index
<b>CXBSTR3</b>	Individuell zusammengestellter Rohstoffindex	<b>JMABDEWU</b>	J.P. Morgan Custom Commodity Index	<b>TRNGLU</b>	FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD
<b>CMBX</b>	Commercial Mortgage-Backed Index	<b>KOSPI</b>	Korea Composite Stock Price Index	<b>UKRP1</b>	United Kingdom Retail Prices Index
<b>CNREPOFIX</b>	China Fixing Repo Rates 7-Day	<b>MEXBOL</b>	Mexico Bolsa IPC Index	<b>USSW10</b>	Australian Equity Futures Index
<b>CPALEMU</b>	Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index	<b>MTGEFNCL</b>	FNMA 30-Year Coupon Index	<b>VSTOXX</b>	Euro Stoxx 50 Volatility Index

**Kommunalanleihen- oder Behördenkürzel:**

<b>AGM</b>	Assured Guaranty Municipal
------------	----------------------------

**Sonstige Kürzel:**

<b>ABS</b>	Asset-Backed Security (forderungsbesichertes Wertpapier)	<b>HIBOR</b>	Hong Kong Interbank Offered Rate	<b>RMBS</b>	Residential Mortgage-Backed Security
<b>ADR</b>	American Depositary Receipt	<b>JIBAR</b>	Johannesburg Interbank Agreed Rate	<b>SOR</b>	Swap Offer Rate
<b>ALT</b>	Alternate Loan Trust	<b>JSC</b>	Joint Stock Company	<b>SP - ADR</b>	Sponsored American Depositary Receipt
<b>ATM</b>	At-the-money	<b>KLIBOR</b>	Kuala Lumpur Interbank Offered Rate	<b>STIBOR</b>	Stockholm Interbank Offered Rate
<b>BABs</b>	Build America Bonds	<b>KORIBOR</b>	Korea Interbank Offered Rate	<b>TBA</b>	To-Be-Announced
<b>BBR</b>	Bank Bill Rate	<b>LIBOR</b>	London Interbank Offered Rate	<b>TBD</b>	To-Be-Determined
<b>BBSW</b>	Bank Bill Swap Reference Rate	<b>MIBOR</b>	Mumbai Interbank Offered Rate	<b>TBD%</b>	Bei Abrechnung des Darlehens oder zum Zeitpunkt der Finanzierung zu ermittelnder Zinssatz
<b>BTP</b>	Buoni del Tesoro Poliennali "Long-term Treasury Bond"	<b>MSCI</b>	Morgan Stanley Capital International	<b>TELBOR</b>	Tel Aviv Inter-Bank Offered Rate
<b>CBO</b>	Collateralized Bond Obligation	<b>NIBOR</b>	Norwegian Interbank Offered Rate	<b>THBFX</b>	Thai Baht Floating-Rate Fix
<b>CDI</b>	Brazil Interbank Deposit Rate	<b>OAT</b>	Obligations Assimilables du Trésor	<b>TIIE</b>	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio
<b>CDO</b>	Collateralised Debt Obligation (besicherte Schuldverschreibungen)	<b>OIS</b>	Overnight Index Swap		
<b>CHILIBOR</b>	Chile Interbank Offered Rate	<b>PIK</b>	Payment-in-Kind (Sachausschüttung)		
<b>CLO</b>	Collateralised Loan Obligation (durch Kreditportfolio besicherte Wertpapiere)	<b>PRIBOR</b>	Prague Interbank Offered Rate	<b>USSW</b>	USD Swap Spread (halbjährlicher Festzins vs. 3-Month LIBOR)
<b>DAC</b>	Designated Activity Company	<b>REIT</b>	Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentsfonds)	<b>WIBOR</b>	Warsaw Interbank Offered Rate
<b>EURIBOR</b>	Euro Interbank Offered Rate	<b>REMIC</b>	Real Estate Mortgage Investment Conduit		

**VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
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,  
22nd Floor, Suite 2201,  
Two International Finance Centre,  
8 Finance Street, Central,  
Hongkong.

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,  
22nd Floor, Unit 2201,  
Two International Finance Centre,  
8 Finance Street, Central,  
Hongkong.

**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 Ananthanarayanan (Indien)  
Ryan P. Blute (USA)  
John Bruton (unabhängiges  
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)  
Craig A. Dawson (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 31. Dezember 2020 abgelaufenen Geschäftsjahr 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.

<sup>1</sup> Mitarbeiter von PIMCO.

**PIMCO Europe Ltd** (Registernummer 2604517) und **PIMCO Europe Ltd — Italy** (Registernummer 07533910969) wurden von der Financial Conduct Authority (12 Endeavour Square, London, E20 1JN) in Großbritannien zugelassen und stehen unter deren Aufsicht. Die Zweigniederlassung in Italien wird zudem durch die Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) gemäß Artikel 27 des italienischen konsolidierten Finanzgesetzes reguliert. Die von PIMCO Europe Ltd erbrachten Dienstleistungen stehen nur professionellen Kunden im Sinne des Handbuchs der Financial Conduct Authority zur Verfügung und sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten.

**PIMCO Europe GmbH** (Registernummer 192083, Seidlstr. 24-24a, 80335 München, Deutschland), die italienische Zweigniederlassung der PIMCO Europe GmbH (Registernummer 10005170963) und die spanische Zweigniederlassung der PIMCO Europe GmbH (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. Die italienische und die spanische Zweigniederlassung werden zudem jeweils durch die Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) gemäß Artikel 27 des italienischen konsolidierten Finanzgesetzes, die Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) gemäß den in den Artikeln 168 und 203 bis 224 festgelegten Verpflichtungen sowie den in Teil V, Abschnitt I des Gesetzes über den Wertpapiermarkt (LSM) und in den Artikeln 111, 114 und 117 des Königlichen Erlasses 217/2008 enthaltenen Verpflichtungen reguliert. Die von PIMCO Europe GmbH erbrachten Dienstleistungen stehen nur professionellen Kunden im Sinne von § 67 Abs. 2 WpHG (Wertpapierhandelsgesetz) zur Verfügung. Sie sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten.

**PIMCO (Schweiz) GmbH** (eingetragen in der Schweiz, Registernummer CH-020.4.038.582-2), Brandschenkestrasse 41, 8002 Zürich, Schweiz, Tel: + 41 44 512 49 10. 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.